

# 嘉实沪港深精选股票型证券投资基金

# 2016年年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司  
基金托管人:中国银行股份有限公司  
送出日期:2017年3月29日

**§1 重要提示**

**1.1 重要提示**

基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本报告中不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告自2016年5月27日(基金合同生效日)起至2016年12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介	
<b>2.1 基金基本情况</b>	
基金名称	嘉实沪港深精选股票型证券投资基金
基金简称	嘉实沪港深精选股票
基金代码	001678
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月27日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,188,751,926.24份
报告期末资产净值	不定期
<b>2.2 基金产品说明</b>	
投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制,追求基金长期资产增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置,根据对宏观经济、市场、政策等因素进行定量与定性相结合的分析研究,确定股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的投资比例。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中债综合财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于货币型基金、债券型基金和货币市场型基金。本基金投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场风险。

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	
<b>3.1 主要会计数据和财务指标</b>	金额单位:人民币元
3.1.1 期间数据和指标	2016年5月27日(基金合同生效日)至2016年12月31日
本期累计收益	216,470.70
本期利润总额	-13,339,335.58
加权平均基金份额净利润	-0.0275
本期加权平均净值增长率	-2.39%
本期基金份额净值增长率	15.30%
3.1.2 期间数据和指标	2016年度
期末可供分配利润	42,503,461.49
期末可供分配基金份额利润	0.0358
期末基金资产净值	1,370,421,881.05
期末基金份额净值	1.153
3.1.3 累计期末指标	2016年末
基金份额累计净值增长率	15.30%

注:(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;(2)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(计入费用后实际收益水平要低于所列数字);(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数;(4)本基金合同生效日为2016年5月27日,本报告期间为2016年5月27日起至2016年12月31日止。

**3.2 基金净值表现**

**3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	份额净值增长率-业绩比较基准收益率③
过去三个月	16.8%	0.81%	-1.87%
过去六个月	14.73%	0.87%	5.00%
自基金合同生效以来	15.30%	0.80%	7.42%

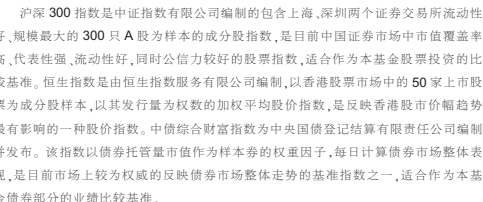
注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×45%+恒生指数收益率×45%+中债综合财富指数收益率×10%

沪深300指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的300只A股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值规模最高、代表性强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。恒生指数是由恒生指数服务有限公司编制,以香港股票市场中的50家上市股票为成分股样本,以其发行量为权数的加权平均股价数,是反映香港股市价格幅度和趋势的一种股价指数。中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数以债券托管市值数据为样本资产的权重因子,每日计算债券市场整体表现,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

本基金的业绩比较指标按照构建公式每日交易日进行计算,计算公式如下:  
 $Return(t)=0.45 \times (沪深300指数(t)-沪深300指数(t-1))+0.45 \times (恒生指数(t)-恒生指数(t-1))-10\%$   
 $Benchmark(t)=(1+Return(t)) \times Benchmark(1)$   
 其中 $t=1,2,3,\dots$

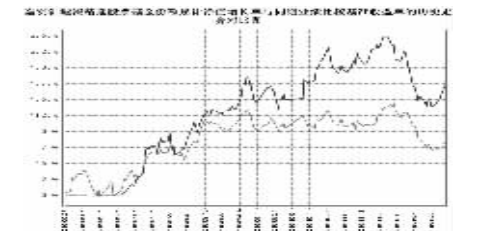
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图:嘉实沪港深精选股票基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:本基金基金合同生效日2016年5月27日至报告期末未满1年。按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二)项(二)投资范围和(四)投资限制的约定。

**3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较**



注:本基金基金合同生效日为2016年5月27日,2016年度的相关数据根据当年实际存续期间(2016年5月27日至2016年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

**§4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及其基金经理简介**

**4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验**

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一家基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司取得首批全国社保基金、企业年金投资管理人及QDII、特定资产管理业务资格。

截止2016年12月31日,基金管理人管理2只封闭式证券投资基金,111只开放式证券投资基金,具体包括嘉实多元价值封闭、嘉实安心、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优化收益混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实回报混合基金、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实丰盈50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳健回报混合、嘉实H股投资(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODI-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球视野混合、嘉实AB、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实货币债券、嘉实新混合、嘉实新常态、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接、嘉实中证医药行业ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数增强混合、嘉实逆向策略股票、

注:本基金基金合同生效日为2016年5月27日,2016年度的相关数据根据当年实际存续期间(2016年5月27日至2016年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

**§4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及其基金经理简介**

**4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验**

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一家基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司取得首批全国社保基金、企业年金投资管理人及QDII、特定资产管理业务资格。

截止2016年12月31日,基金管理人管理2只封闭式证券投资基金,111只开放式证券投资基金,具体包括嘉实多元价值封闭、嘉实安心、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优化收益混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实回报混合基金、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实丰盈50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳健回报混合、嘉实H股投资(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODI-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球视野混合、嘉实AB、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实货币债券、嘉实新混合、嘉实新常态、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接、嘉实中证医药行业ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数增强混合、嘉实逆向策略股票、

注:本基金基金合同生效日为2016年5月27日,2016年度的相关数据根据当年实际存续期间(2016年5月27日至2016年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

**§4 管理人报告**

**4.1 基金管理人及其基金经理简介**

**4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验**

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的第一家基金管理公司之一,是中外合资基金管理公司。公司注册地上海,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司取得首批全国社保基金、企业年金投资管理人及QDII、特定资产管理业务资格。

截止2016年12月31日,基金管理人管理2只封闭式证券投资基金,111只开放式证券投资基金,具体包括嘉实多元价值封闭、嘉实安心、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优化收益混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实回报混合基金、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实丰盈50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳健回报混合、嘉实H股投资(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODI-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球视野混合、嘉实AB、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实货币债券、嘉实新混合、嘉实新常态、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接、嘉实中证医药行业ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数增强混合、嘉实逆向策略股票、

嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实科技快线股票、嘉实新能源股票、嘉实新兴产业股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实智能汽车股票、嘉实腾讯自设大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实起点混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新财富混合、嘉实稳健纯债债券、嘉实瑞瑞纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新化混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳泰债券、嘉实稳丰纯债债券、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳健债券、嘉实鑫选纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽定增混合、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优化成长混合、嘉实稳健债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介	
姓名	职务
姓名	职务
任本基金的基金经理(助理)期限	证券从业年限
任职日期	离任日期
基金名称	嘉实基金基金经理
2016年5月27日	12年
聘任中金公司研究部能源组组长、国际研究部高级副经理、国际研究部执行总经理、研究部执行总经理、2012年10月加入嘉实基金,现任国际研究部执行总经理、负责海外投资业务以及能源新材料行业研究	

注:(1)基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

**4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明**

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实沪港深精选股票型证券投资基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的约定,无损害基金份额持有人利益的行为。

**4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明**

**4.3.1 公平交易制度和内部控制方法**

公司制定了《公平交易管理制度》,按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定,从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度控制、内部控制和信息披露等多方面,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,杜绝不同投资组合之间进行利益输送,保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个关键环节符合公平交易的管理要求。各投资组合能够公平地获得投资信息,投资建议,并在投资决策委员会的制度规范下独立决策,实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离,任何组合必须经过公司交易集中交易,各组合享有平等的交易权利,共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则,保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的行为,严格遵循各投资组合事前独立确定交易要素,交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

**4.3.2 公平交易制度的执行情况**

报告期内,公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按照投资管理流程和流程独立决策,并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行规则,严格的流程控制,持续的技术改进,确保公平交易制度的实现,对投资交易行为进行全流程监控,通过IT系统和人工巡查等方式进行日常监控和事后评估并完善记录相关信息,及时完成每周度和年度公平交易专项稽核。

报告期内,公司对连续四个季度内不同时间窗口(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合间交易的交易价差进行分析,未发现违反公平交易制度的异常行为。

**4.3.3 异常交易行为的专项说明**

报告期内,公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的,合计6次,为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

**4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明**

**4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析**

本基金成立于2016年5月27日,此时上证综合指数处于2800多点的相对低位,恒生指数则在20600点附近震荡。通过对市场及个股风险回报的分析判断,我们在7月初美国股灾公布地以后迅速将股票仓位提高到80%以上,并且大部分仓位配置在港股。此后港股在三季度走出独立行情,基金净值得到较快增长。到9月底,恒生指数涨到24000点,港股市场整体估值已经趋于合理,而A股市场经历了一轮调整期后风险收益比有所提升,此时,我们降低了港股配置,增加了A股的投资,所选投资组合的表现较好,基金净值并没有跟随港股市场下跌,反而持续上涨并在十一月下旬创出年内高点。此后由于特朗普当选美国总统,短期内市场风格变化加剧,中上游周期股和金融股反弹,科技和成长股下跌,基金净值出现了明显回撤。至12月下旬,我们主动调低了调整幅度较大的港股配置,降低了A股的持仓,为2017年以来至今的收益表现奠定了良好的基础。

投资策略上,我们以价值投资为主,优先选择低估值伴有基本面临边际改善的股票,以期享受盈利和估值的提升,在股价上获利空间敞阔及时获利了结。在深入研究的支持下,致力于挖掘港股市场的投资机会。鉴于港股市场流动性较差,交易成本较高,在买入港股股票时特别注意回避有治理问题的公司。在买入流动性较差的中小盘港股时,仓位要同时兼顾风险收益和流动性指标。

行业选择上,我们相信未来很长一段时间,中国都处于经济转型期,因此产业升级和消费升级是长期发展方向,能够主动进行产业升级方向、符合消费升级方向的公债值得长期关注。报告期内,基金大幅超配了汽车和电子这两个行业,获得一定的超额回报。对于周期股,我们的投资也是基于深入研究的基础上进行投资,对于持续性存疑的周期股保持谨慎。

**4.4.2 报告期内基金的投资表现**

截至本报告期末本基金份额净值为1.153元;本报告期基金份额净值增长率为15.30%,业绩比较基准收益率为7.42%。

**4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

A股市场展望

A股市场经历了2015到2016年的大起大落后,展望2017年,盈利仍能维持正增长,但增速可能见顶回落。股票市场资金面,资金去杠杆大背景下,股票市场也不受杠杆抽离冲击过快,压力最大的资产,股市资金面有望因相对吸引力的提升而面临改善。因此,A股市场自身的总体盈利和流动性趋势尚好,两者都有经历过往两年的超高风险波动后向一个比较温和的平稳趋势过渡的可能。两大因素相互抵消下市场处于平衡状态,全年上证指数涨跌幅可能落在一个较窄区间。但全年的市场过程可能仍将十分曲折,主要的风险在于货币政策阶段性收紧过程(通胀、汇率、房价等因素牵制),以及金融去杠杆的加速造成金融体系整体的流动性收紧。外部主要风险在于地缘政治风险。

结构上看,2017年的A股市场相比2015和2016年也是一个更青睐寻找错杀机会的市场——低估值价值和强周期类股票经历了一整年的估值修复和业绩上升,但考虑到近期利润的盈利增长和告别底部的市股率,要赚取大大幅超额利润来继续提升估值的机会不大。另一方面,小市值成长股系统性的估值消化尽管2016年已经有了较大进展,但其外延并购业绩在2017年以后存在较大不确定性,且当前估值在一个流动性偏于收紧的市场预计尚未告别继续去化化的阶段,预计仍在上半年的时间内徘徊在消化估值泡沫的道路上。全年收益而言,我们认为大市值风格仍将整体占优,但优势占比在2016年要弱,应当深入行业个股仔细分辨相对收益的机会。

港股市场展望

港股市场在2016年四季度经历了比较充分的调整,到2016年底整体估值重新具有了吸引力,加上盈利有望持续增长,这使得我们对2017年港股市场比较乐观。我们预期恒生指数将在2017年继续获得回报,并且有较大的机会跑赢A股,这是因为港股估值水平仍较A股便宜,国内资金对海外资产配置的热情不减,而在其他渠道不通畅的情况下,资金仍会通过港股通南下,从而逐渐抬高港股的估值水平和交易活跃度。此外在经历了特朗普上台影响之后,国际资金也有望回流香港市场,进一步推动港股的行情。我们相对看好上半年,特别是一季度的港股市场,在二季度以来,中国经济增速可能会逐步回落,而港股仍处于相对较高的位置,加上美元继续加息的压力持续存在,股指可能会有一定的调整压力。

我们将继续以价值投资为主要策略,深入研究行业发展趋势,挖掘长期性的投资机会。行业选择上,我们将继续关注产业升级和消费升级这两个长期方向,同时加大对深度价值的周期性投资机会的研究。在2017年相对看好港股电子、医药、博彩、保险、农业和原材料等行业的投资机会。

**4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误并由基金管理人对外公布。月末、年中度和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任估值委员会、估值委员,基金估值委员会估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务,参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突,与估值相关的机构均严格限于上海、深圳证券交易场所、中国证券登记结算有限责任公司、中央国债登记结算公司、中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

**4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

(1)报告期内本基金未实施利润分配;

(2)根据本报告3.1.1“本期利润”为-13,339,335.58元,以及本基金基金合同(十六)(三)基金收益分配原则“(三)基金收益分配后基金净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值”的约定,报告期内本基金未实施利润分配,符合基金合同的约定。

**4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情况的说明**

无。

**§5 托管人报告**

一、报告期内本基金托管人遵守法律法规的情况

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在嘉实沪港深精选股票型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人进行了必要的监督、复核,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真复核,未发现本基金管理人在托管基金实施过程中有违反法律法规的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中“金融工具风险及管理”部分不在托管人监督范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

**§6 审计报告**

嘉实沪港深精选股票型证券投资基金2016年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师张明、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”(普华永道中天字(2017)第20692号)。

投资者可通过登录于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

**§7 年度财务报表**

**7.1 资产负债表**

会计主体:嘉实沪港深精选股票型证券投资基金  
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元	
资产	附注
货币资金	74.71
交易性金融资产	1,236,359,762.19
其中:股票投资	1,236,359,762.19
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	-
应收款项类金融资产	-
其他金融资产	-
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-