嘉实成长收益证券投资基金 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

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、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。

本基金已根据香港《证券及期货条例》第 104 条在香港获得证券及期货事务监察委员会认可及可供在香港向公众销售。证券及期货事务监察委员会认可不代表对本基金的推荐或认许,亦不代表其对本基金的商业利弊或其表现作出保证。此并不意指本基金适合所有投资者,亦并非认许本基金适合任何特定投资者或投资者类别。

本报告期自 2016 年 1 月 1 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

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实成长收益证券投资基金		
基金简称	嘉实成长收益混合		
基金主代码	070001		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2002年11月5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	4,515,194,030.35份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H	
下属分级基金的交易代码:	070001	960024	
报告期末下属分级基金的份额总额	4,514,246,485.24份	947,545.11份	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以于成长收益层台型基金,在获取稳定利润安全收益的基础上,积极追求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及有债券投资产的稳健投资来实现"稳定收益"的目标;同时通过实施"行业优选、积极轮换"的策略,实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	三年A股指数
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金,长期来看预期其相对为基金份额净值相对于基金业绩基准的平均值不超过0.75。在此期间下,本基金通过合理配置股票成长型资产类,收益型资产类和现金等大类资产之间的比例,除为实现股票市场上表现较基金资产净值表现不低于上证A股指数表现的65%,股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的55%。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡春歧	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182286	(010) 66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年		2015年		2014年	
	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H
本期已实现收益	- 194,911,693.22	- 10,165.21	2,256,621,400.70	-	400,776,848.54	-
本期利润	- 406,270,767.54	- 37,095.15	1,853,503,096.87	-	722,279,629.40	-
加权平均基金份额本期利润	- 0.0929	- 0.0584	0.4612	-	0.0989	-
本期加权平均净值利润率	- 8.00%	- 5.73%	41.14%	-	14.91%	-
本期基金份额净值增长率	- 9.06%	- 2.09%	66.86%	-	18.88%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016年末		2015年末		2014年末	
期末可供分配利润	2,572,579,728.36	- 19,795.59	2,669,229,049.32	-	881,007,416.66	-
期末可供分配基金份额利润	0.5699	- 0.0209	0.6977	-	0.1903	-
期末基金资产净值	5,246,966,042.01	927,749.52	4,934,955,914.62	-	3,622,253,790.19	-
期末基金份额净值	1.1621	0.9791	1.2899	-	0.7825	-
3.1.3 累计期末指标	2016年末		2015年末		2014年末	
基金份额累计净值增长率	914.72%	- 2.09%	1,015.80%	-	568.72%	-

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)所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)本基金自 2016 年 1 月 7 日起增加 H 类基金份额类别,仅在中国香港地区销售。

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

嘉实成长收益混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	- 4.05%	0.69%	3.32%	0.69%	- 7.37%	0.00%
过去六个月	- 3.74%	0.74%	5.97%	0.73%	- 9.71%	0.01%
过去一年	- 9.06%	1.48%	- 12.28%	1.45%	3.22%	0.03%
过去三年	80.40%	1.67%	46.74%	1.76%	33.66%	- 0.09%
过去五年	154.00%	1.42%	41.03%	1.54%	112.97%	- 0.12%
自基金合同生效起至今	914.72%	1.28%	103.06%	1.68%	811.66%	- 0.38%

嘉实成长收益混合 H

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	- 4.06%	0.69%	3.32%	0.69%	- 7.38%	0.00%
自基金合同生效起至今	- 2.09%	0.71%	4.19%	0.71%	- 6.28%	0.00%

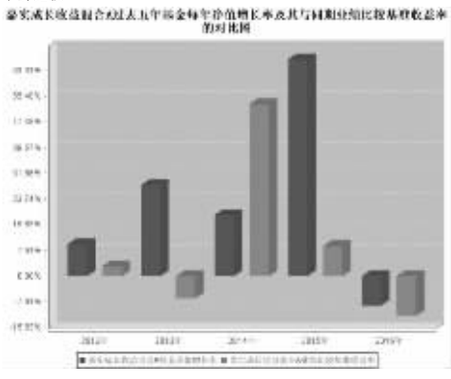
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图 1:嘉实成长收益混合 A 基金份额累计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
(2002 年 11 月 5 日至 2016 年 12 月 31 日)

图 2:嘉实成长收益混合 H 基金份额累计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
(2016 年 8 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)

注:按基金合同规定,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第十八条((二)投资范围和(六)投资组合比例限制)的约定;(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;(3)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(5)本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

3.2.3 过去五年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:嘉实成长收益混合 H 类基金份额 2016 年度的相关数据根据当年实际存续期(2016 年 8 月 1 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

单位:人民币元

嘉实成长收益混合A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	0.1000	22,129,719.85	17,354,949.84	39,484,669.69	
2015	0.0960	21,810,660.86	21,994,168.19	43,804,829.05	
2014	-	-	-	-	
合计	0.1960	43,940,380.71	39,349,118.03	83,289,498.74	

注:本基金自 2016 年 1 月 7 日起增加 H 类基金份额类别,本报告期间嘉实成长收益混合 H 无利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

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批基金管理公司之一,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。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2016 年 12 月 31 日,基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、111 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接(LOF)、嘉实超短债债券、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、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金(QDII-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、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 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 指数研究增强、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、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、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、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安安混合、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、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、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	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周秋海	本基金、嘉实稳宝成长混合、嘉实成长增强混合基金经理,投资投资总监兼任QD组投资投资总监	2013年6月7日	-	18年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券,从事行业研发工作,先后担任研发员、高级研究员、2006年12月加盟嘉实基金管理有限公司,历任公司高级研究员,投资经理,现任投资总监兼基金经理QD兼职投资总监。金融硕士,具有基金从业资格,具备上岗证书。
谢洪明	本基金、嘉实新机遇混合发起式、嘉实策略混合基金经理	2015年12月31日	-	7年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部,曾任行业研究员一职,现任职于投资投资部,硕士研究生,具有基金从业资格。

(1)任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日;(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、《嘉实成长收益证券投资基金基金合同》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规定和约定,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、系统和制度建设、内控措施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相关环节符合公平交易的监管要求。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部集中交易。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交易,严格遵循各投资组合交易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,各投资组合按投资管理制度和流程独立决策,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细则、严格的流程控制、持续的技术改进,确保公平交易原则的实现;对投资交易行为进行监察稽核,通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息,及时完成每季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期间内、不同时间窗下(日内、3 日内、5 日内)公司管理的不同投资组合同向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

国内经济 2016 年走势平稳、通胀比较温和,GDP 增速稳定在 6.7%左右,CPI 基本在 2%上下震荡。以原油为代表的大宗商品价格触底回升,带动国内 PPI 由负转正,上游工业企业的利润触底回升。房地产、汽车行业也出现阶段性景气,对上下游产业链有一定的带动作用。

2016 年 A 股市场首先经历 1 月份的熔断暴跌,而后整体呈现震荡行情,全年上证综指下跌 12.31%、创业板指数下跌 27.71%、上证 50 指数仅下跌 5.53%。市场以结构性机会为主,呈现二八分化,即 20%的个股上涨、80%的个股下跌。整体上业绩稳健增长的大盘蓝筹跑赢中小盘,低估值个股跑赢高估值个股。成长股中,业绩成长性较好、估值合理偏低的优质企业也取得较好的正收益率,而讲故事且业绩兑现概率较低的伪成长股跌幅较大,高估值的优质成长股也在不断去估值泡沫。

本基金报告期内主要正贡献来自小间距 LED、光通信、血制品等成长性较好、估值合理偏低的行业龙头,以及部分低估值转型的优质企业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实成长收益混合 A 基金份额净值为 1.1621 元,本报告期基金份额净值增长率为 -9.06%,同期业绩比较基准收益率为 -12.28%;截至本报告期末嘉实成长收益混合 H 基金份额净值为 0.9791 元,本报告期基金份额净值增长率为 -2.09%,同期业绩比较基准收益率为 4.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2017 年,国内经济数据预计相对平稳,房地产和汽车行业的阶段性降温可能对经济增速会有一定压力。货币政策稳健中性,受制于阶段性的通胀压力,货币收紧的信号可能会逐步明确,特朗普上台后的政策变化是潜在的外部风险。中国经济仍会有很多结构性机会,传统产业和新兴产业的增速仍将继续分化,以网络安全、光通信为代表的新兴产业仍具有广阔的发展空间。预计 2017 年 A 股市场仍以结构性行情为主,整体趋势性行情不明显。从中期来看,结合市场增量资金特征、供给需求、投资者结构变化等因素,高估值的中小盘个股整体面临估值调整和分化的较大压力。

我们重点关注的投资机会包括,一是传统产业中供给侧经过优化和提升、业绩有望超预期、估值有望提升的优质企业,二是新兴产业中估值合理偏低、业绩持续快速增长的细分领域龙头企业。本基金将以严格的选股标准和估值标准,力争给持有人带来良好的投资回报。

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与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后由基金管理人对外公布。月末、年中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基金经理、估值委员,基金经理参加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;与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所,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)本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 15 日发布《嘉实成长收益证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》,收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日,每 10 份基金份额发放现金红利 0.1000 元,具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

(2)根据本基金基金合同(二十二(三)收益分配原则)约定,报告期内本基金未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

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形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在嘉实成长收益证券投资基金(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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,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地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、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:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

嘉实成长收益证券投资基金 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、注册会计师许康玮、张勇签字出具了"无保留意见的审计报告"(普华永道中天审字(2017)第 20638 号)。

投资者可通过登载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:嘉实成长收益证券投资基金
报告截止日:2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	794,012,958.06	501,212,929.41
结算备付金		3,583,717.89	4,776,938.02
存出保证金		1,356,581.02	1,498,642.82
交易性金融资产	7.4.7.2	4,441,664,810.86	4,418,909,812.31
其中:股票投资		3,251,730,810.86	3,316,000,812.31
基金投资		-	-
债券投资		1,189,934,000.00	1,102,909,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,532,689.32	-
应收利息	7.4.7.5	22,667,649.03	27,133,264.23
应收股利		-	-
应收申购款		1,125,501.91	4,816,935.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产合计		5,259,943,908.09	4,958,348,522.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,964,372.39	13,672,928.10
应付管理人报酬		6,754,592.75	6,195,289.86
应付托管费		1,125,765.44	1,032,548.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,788,066.86	2,041,957.43
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	417,319.12	449,884.14
负债合计		13,050,116.55	23,392,607.86
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,674,333,858.76	2,265,726,865.30
未分配利润	7.4.7.10	2,572,559,932.77	2,669,229,049.32
所有者权益合计		5,246,893,791.53	4,934,955,914.62
负债和所有者权益合计		5,259,943,908.09	4,958,348,522.48

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,嘉实嘉实成长收益混合 A 基金份额净值 1.1621 元,基金份额总额 4,514,246,485.24 份;嘉实成长收益混合 H 基金份额净值 0.9791 元,基金份额总额 947,545.11 份。嘉实成长收益混合基金份额总额合计为 4,515,194,030.35 份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金
本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		- 301,301,666.44	1,954,287,277.03
1.利息收入		35,662,877.04	44,507,965.87
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,517,485.68	2,976,514.29
债券利息收入		31,591,376.45	41,462,199.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		554,015.11	69,252.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益		- 128,144,817.08	2,305,640,505.78
其中:股票投资收益	7.4.7.12	- 139,636,819.44	2,295,523,379.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	- 5,762,074.78	871,086.29
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	17,254,077.14	9,246,039.61
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	- 211,386,002.26	- 403,118,303.83
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	2,566,275.86	7,257,109.21
减:二、费用		105,006,194.25	100,784,180.16
1. 管理人报酬		76,183,870.41	67,053,028.14
2. 托管费		12,697,311.72	11,175,504.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	15,643,755.36	21,645,685.08
5. 利息支出		-	417,472.97
其中:卖出回购金融资产支出		-	417,472.97
6. 其他费用	7.4.7.19	481,256.76	492,489.32
三、利润总额		- 406,307,860.69	1,853,503,096.87
减:所得税费用		-	-
四、净利润		- 406,307,860.69	1,853,503,096.87

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,嘉实嘉实成长收益混合 A 基金份额净值 1.1621 元,基金份额总额 4,514,246,485.24 份;嘉实成长收益混合 H 基金份额净值 0.9791 元,基金份额总额 947,545.11 份。嘉实成长收益混合基金份额总额合计为 4,515,194,030.35 份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金
本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		- 301,301,666.44	1,954,287,277.03
1.利息收入		35,662,877.04	44,507,965.87
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,517,485.68	2,976,514.29
债券利息收入		31,591,376.45	41,462,199.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		554,015.11	69,252.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益		- 128,144,817.08	2,305,640,505.78
其中:股票投资收益	7.4.7.12	- 139,636,819.44	2,295,523,379.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	- 5,762,074.78	871,086.29
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	17,254,077.14	9,246,039.61
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	- 211,386,002.26	- 403,118,303.83
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	2,566,275.86	7,257,109.21
减:二、费用		105,006,194.25	100,784,180.16
1. 管理人报酬		76,183,870.41	67,053,028.14
2. 托管费		12,697,311.72	11,175,504.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	15,643,755.36	21,645,685.08
5. 利息支出		-	417,472.97
其中:卖出回购金融资产支出		-	417,472.97
6. 其他费用	7.4.7.19	481,256.76	492,489.32
三、利润总额		- 406,307,860.69	1,853,503,096.87
减:所得税费用		-	-
四、净利润		- 406,307,860.69	1,853,503,096.87

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金
本报告期:2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,265,726,865.30	2,669,229,049.32	4,934,955,914.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	- 406,307,860.69	- 406,307,860.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	408,606,993.46	349,123,411.83	757,730,407.29
其中:1.基金申购款	1,643,622,633.48	1,552,158,864.04	3,195,981,517.52
2.基金赎回款	- 1,235,215,640.02	- 1,203,035,470.21	- 2,438,251,110.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 39,484,669.69	- 39,484,669.69
五、期末所有者权益(基金净值)	2,674,333,858.76	2,572,559,932.77	5,246,893,791.53
	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,741,246,373.53	881,007,416.66	3,622,253,790.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,853,503,096.87	1,853,503,096.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 475,519,508.23	- 21,476,635.16	- 496,996,143.39
其中:1.基金申购款	3,470,685,524.90	3,870,026,754.96	7,340,712,279.86
2.基金赎回款	- 3,946,205,033.13	- 3,891,503,390.12	- 7,837,708,423.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 43,804,829.05	- 43,804,829.05
五、期末所有者权益(基金净值)	2,265,726,865.30	2,669,229,049.32	4,934,955,914.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

_____ 赵学军 _____ _____ 王红 _____ _____ 常旭 _____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
银联证券资产管理(深圳)有限公司	基金管理人的股东

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日)及上年度可比期间(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	76,183,870.41	67,053,028.14
其中:支付销售机构的客户维护费	4,911,479.16	3,937,399.41

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值× 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月