

嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金

2016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

基金管理人、董事监事会对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。本基金年度报告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，应阅读年度报告全文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	嘉实回报混合
基金代码	070016
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年8月18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
基金份额总额	397,215,932.04份
基金资产总值	人民币元

2.2 基金产品说明	
投资目标	力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	通过深入研究和分析宏观经济、政策、行业、公司等多方面的因素，精选具有投资价值的股票，同时辅以适当的债券投资，以期在控制风险的前提下，获得超越基准的收益。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中证债券指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于股票基金，低于债券基金。

2.3 基金管理人和基金托管人	
项目	基金管理人 嘉实基金管理有限公司
名称	中国银行股份有限公司
基金经理姓名	王亚伟
基金经理联系方式	(010) 65215588
电子邮箱	service@jrfund.com
客户服务电话	400-600-8800
传真	(010) 65182606

2.4 信息披露方式	
登载在中国证监会指定的信息披露媒体的基金定期报告	http://www.jrfund.cn
登载在中国证监会指定的信息披露媒体的临时公告	北京电视台都市频道《北京您早》节目、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	
金额单位：人民币元	

3.1 本期主要财务指标	
2016年	2015年
本期已实现收益 -29,425,643.51	331,950,146.19
本期利润 -47,765,000.23	279,458,560.81
年初至报告期利润 -1,016.33	-4,074.6
本期加权平均利润率 -11.76%	40.9%
本期末基金资产净值 -9.75%	30.86%
3.2 固定费用	13.94%
3.3 利润	24.81%

注：(1)本期已实现收益指基金利息收入、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，计算上实际收益水平要低于所列数宇；(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本期利润孰低。

3.2 基金净值表现

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元	
-----------	--

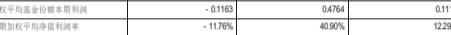


图表显示，基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年8月18日至2016年12月31日)

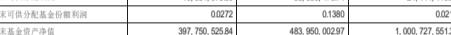
注：根据本基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

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：根据本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(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.4 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

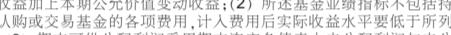


注：(1)本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现公允价值变动收益；(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算上实际收益水平要低于所列数宇；(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润孰低。

3.2.5 基金净值表现

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元	
-----------	--



图表显示，基金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

(2009年8月18日至2016年12月31日)

注：根据本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(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.6 对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：(1)本基金已实现收益指基金利息收入、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，计算上实际收益水平要低于所列数宇；(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本期利润孰低。

3.2.7 基金份额净值

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元	
-----------	--

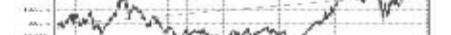


图表显示，基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年8月18日至2016年12月31日)

注：根据本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(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.8 对过去三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

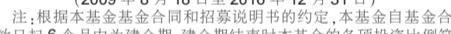


注：(1)本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现公允价值变动收益；(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算上实际收益水平要低于所列数宇；(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润孰低。

3.2.9 基金份额净值

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元	
-----------	--



图表显示，基金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

(2009年8月18日至2016年12月31日)

注：根据本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(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.10 对过去一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

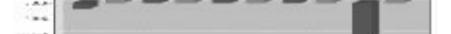


注：(1)本基金已实现收益指基金利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现公允价值变动收益；(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计算上实际收益水平要低于所列数宇；(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与本期利润孰低。

3.2.11 基金份额净值

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元	
-----------	--



图表显示，基金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

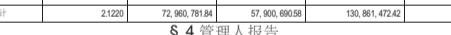
(2009年8月18日至2016年12月31日)

注：根据本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(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.12 基金份额净值

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较

金额单位：人民币元	
-----------	--



图表显示，基金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

(2009年8月18日至2016年12月31日)

注：根据本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(十四)二)投资范围和(十二)基金投资组合比例限制)的有关约定。

3.2.13 基金份额净值

3.1 基金份额净值增长率及其同期业绩比较基准收益率的比较