嘉实价值优势混合型证券投资基金 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

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。

根据基金管理人 2015 年 8 月 3 日发布的《嘉实基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金更名的公告》,嘉实价值优势股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为嘉实价值优势混合型证券投资基金。

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,应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实价值优势混合型证券投资基金
基金简称	嘉实价值优势混合
基金主代码	070019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年 6 月 7 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	334, 014, 915.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	运用价值投资方法,精选在基本面上具备核心竞争力、且市场估值水平具备相对优势的企业投资,并持续优化投资组合中风险与收益的匹配程度,力争获取中长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	本基金以价值投资理念为核心,根据中国股票市场的投资特点进行改良应用,首先根据不同的经济周期及市场趋势研判,决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策;其次在个股选择上,通过深入研究寻找优质企业,运用估值方法估算其内在投资价值,并根据国内市场的特殊性及波动性,综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素,发现具备投资价值的个股。
业绩比较基准	沪深 300 指数 *95% + 上证国债指数 *5%。
风险收益特征	较高风险、较高预期收益

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	胡勇钦	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)65182266	(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
本期已实现收益	4, 690, 964.21	682, 743, 561.31	176, 319, 334.44
本期利润	- 81, 652, 386.36	578, 724, 156.87	165, 258, 103.51
加权平均基金份额本期利润	- 0.2198	0.8568	0.0960
本期加权平均净值利润率	- 14.75%	51.59%	8.53%
本期基金份额净值增长率	- 12.49%	32.87%	11.79%
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	166, 915, 546.21	278, 985, 192.50	276, 348, 390.52
期末可供分配基金份额利润	0.4997	0.7144	0.2425
期末基金资产净值	500, 930, 461.98	669, 476, 233.00	1, 469, 905, 314.18
期末基金份额净值	1.500	1.714	1.290
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	54.55%	76.59%	32.91%

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。

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	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	- 1.70%	0.84%	1.67%	0.67%	- 3.37%	0.17%
过去六个月	- 0.92%	0.90%	4.78%	0.72%	- 5.70%	0.18%
过去一年	- 12.49%	1.66%	- 10.50%	1.33%	- 1.99%	0.33%
过去三年	29.98%	1.92%	41.34%	1.70%	- 11.36%	0.22%
过去五年	67.41%	1.67%	41.15%	1.54%	26.26%	0.13%
自基金合同生效起至今	54.55%	1.56%	22.11%	1.50%	32.44%	0.06%

注:本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数× 95%+上证国债指数× 5%。

沪深 300 指数是沪深证券交易所联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数,由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数,具有良好的 A 股市场代表性。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本,按照国债发行量加权而成,具有良好的债券市场代表性。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%× (沪深 300 指数(t)/ 沪深 300 指数(t-1)-1)+5%× (上证国债指数(t)/ 上证国债指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return (t))× Benchmark (t-1)

其中 t=1,2,3,…。

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

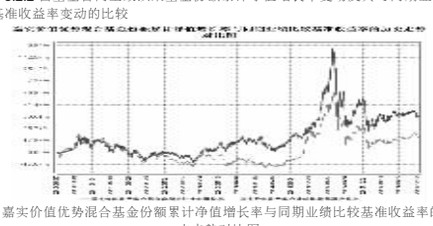
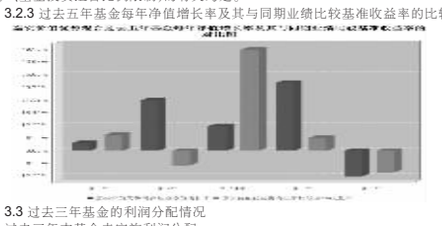


图:嘉实价值优势混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 6 月 7 日至 2016 年 12 月 31 日)

注: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(十四(二)投资范围和(七)2、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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 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		
翟琳琳	本基金、嘉实稳健混合基金经理	2014 年 11 月 26 日	-	11年	2005 年 7 月加入嘉实基金,先后担任证金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务。具有基金从业资格。

注:(1)任职日期、离职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。(3)本基金基金经理翟琳琳女士因休产假超过 30 日,在其休假期间,本基金暂由我公司基金经理焦云女士代为履行基金经理职责。该事项已于 2016 年 5 月 5 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。(4)本基金基金经理翟琳琳女士已结束休假, 自 2016 年 11 月 23 日起恢复履行基金经理职务。该事项已于 2016 年 11 月 24 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

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、《嘉实价值优势混合型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, 每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

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,均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易, 不存在利益输送等异常交易行为。

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

本报告期内整个市场大幅下跌,一季度市场经历了熔断的惨烈下跌,二季度跌幅有所收窄,三四季度市场小幅回暖;一季度,由于通胀预期的上升,农业、黄金、食品饮料等板块表现较好;二季度由于经济触底,房地产和汽车等销售数据好转,建筑、家电、汽车等低估值板块表现较好;三四季度,在保险等机构增量资金入市的背景下,高 ROE、低估值和高分红的板块表现较好;全年看,传媒、计算机、军工等高估值的板块表现较差。

回顾本组合的操作, 在大类资产配置上, 权益比例一季度小幅下调到 80%-85%,其他时间基本维持在 90%左右窄幅波动;在行业配置上,增加了受益于需求持续超预期汽车及其零配件行业和受益于油价上涨的化工行业的配置, 保持了医药和食品饮料等受益于通胀的品种的配置;减持了基本面低于预期的传媒和计算机等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.500 元;本报告期基金份额净值增长率为 -12.49%,业绩比较基准收益率为 -10.50%。

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 17 年一季度,我们认为整体市场仍将保持窄幅的波动。一是,经济仍将维持窄幅的波动,16 年房地产和汽车的销售大幅度超预期带动相关的产业链都有一定的补库存的需求,基建在 PPP 项目的带动下仍能保持一定的增长;二是,金融去杠杆、PPI 超预期上涨带来的通胀压力以及美国加息带来的资金外流压力促使 17 年流动性有所收紧;三是,在两会和 19 大前后,改革的预期可能有所加强。

因此在一季度我们认为市场整体基本维持平稳, 更多的收益可能来自于个股的精选,我们看好的方向如下:一是,受益于供给侧改革和环保约束的造纸、水泥行业;二是,受益于输入性通胀的农业和化工及油气产业链;三是,估值已经调整到位且景气度仍然向上的新兴行业,如军工、汽车电子等;四是,受益于医药改革且估值合理的医药龙头企业。

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)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 -81,652,386.36 元,以及本基金基金合同(十九(三)收益分配原则)约定,因此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")在嘉实价值优势混合型证券投资基金(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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全履职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

嘉实价值优势混合型证券投资基金 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 20625 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:嘉实价值优势混合型证券投资基金

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	8, 218, 062.73	54, 108, 668.56
结算备付金		934, 823.49	1, 202, 290.49
存出保证金		207, 912.46	518, 048.55
交易性金融资产	7.4.7.2	496, 925, 785.30	612, 996, 480.01
其中:股票投资		456, 940, 782.00	572, 801, 480.01
基金投资		-	-
债券投资		39, 985, 003.30	40, 195, 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		-	6, 786, 702.24
应收利息	7.4.7.5	750, 019.57	1, 173, 513.36
应收股利		-	-
应收申购款		24, 276.47	24, 794.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		507, 060, 880.02	676, 810, 497.67
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		3, 804, 025.23	3, 395, 505.16
应付赎回款		853, 916.59	1, 761, 976.08
应付管理人报酬		647, 544.84	858, 182.42
应付托管费		107, 924.13	143, 030.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	336, 837.62	774, 793.15
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	380, 169.63	400, 777.43
负债合计		6, 130, 418.04	7, 334, 264.67
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	334, 014, 915.77	390, 491, 040.50
未分配利润	7.4.7.10	166, 915, 546.21	278, 985, 192.50
所有者权益合计		500, 930, 461.98	669, 476, 233.00
负债和所有者权益总计		507, 060, 880.02	676, 810, 497.67

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.500 元,基金份额总额 334,014,915.77 份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实价值优势混合型证券投资基金

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		- 68, 742, 722.41	609, 293, 773.83
1.利息收入		1, 431, 233.32	3, 442, 039.41
其中:存款利息收入	7.4.7.11	340, 873.63	561, 936.43
债券利息收入		1, 090, 359.69	2, 880, 102.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		16, 104, 179.43	709, 012, 303.81
其中:股票投资收益	7.4.7.12	13, 670, 239.81	703, 295, 349.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	- 418, 960.00	- 15, 350.00
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	2, 852, 899.62	5, 732, 304.20
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	- 86, 343, 350.57	- 104, 019, 404.44
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	65, 215.41	858, 835.05
减:二、费用		12, 909, 663.95	30, 569, 616.96
1. 管理人报酬		8, 307, 597.44	16, 894, 089.11
2. 托管费		1, 384, 599.56	2, 815, 681.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2, 803, 474.93	10, 398, 240.76
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	413, 992.02	461, 605.48
三、利润总额		- 81, 652, 386.36	578, 724, 156.87
减:所得税费用		-	-
四、净利润		- 81, 652, 386.36	578, 724, 156.87

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实价值优势混合型证券投资基金

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)	390, 491, 040.50	278, 985, 192.50	669, 476, 233.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	- 81, 652, 386.36	- 81, 652, 386.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 56, 476, 124.73	- 30, 417, 259.93	- 86, 893, 384.66
其中:1.基金申购款	30, 617, 194.35	14, 550, 091.36	45, 167, 285.71
2.基金赎回款	- 87, 093, 319.08	- 44, 967, 351.29	- 132, 060, 670.37
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	334, 014, 915.77	166, 915, 546.21	500, 930, 461.98
项目	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)	1, 139, 537, 232.16	330, 368, 082.02	1, 469, 905, 314.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	578, 724, 156.87	578, 724, 156.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 749, 046, 191.66	- 630, 107, 046.39	- 1, 379, 153, 238.05
其中:1.基金申购款	273, 120, 074.11	233, 684, 148.28	506, 804, 222.39
2.基金赎回款	- 1, 022, 166, 265.77	- 863, 791, 194.67	- 1, 885, 957, 460.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	390, 491, 040.50	278, 985, 192.50	669, 476, 233.00

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 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相一致。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间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
德意志资产管理(亚洲)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	8, 307, 597.44	16, 894, 089.11
其中:支付销售机构的客户维护费	1, 702, 553.46	2, 798, 769.99

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 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托管费	1, 384, 599.56	2, 815, 681.61

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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:日托管费=前一日基金资产净值× 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	10, 376, 214.93	-	-	-	-

注:本期(2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内 (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), 基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2016 年 12 月 31 日)及上年度末(2015 年 12 月 31 日),其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	8, 218, 062.73	322, 386.27	54, 108, 668.56	489, 732.64

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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), 本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末(2016 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票

金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002838	道恩股份	2016年12月28日	2017年1月6日	未上市	15.28	15.28	681	10, 405.68	10, 405.68	网下申购
002840	华统股份	2016年12月29日	2017年1月10日	未上市	6.55	6.55	1, 814	11, 881.70	11, 881.70	网下申购
300583	赛托生物	2016年12月29日	2017年1月6日	未上市	40.29	40.29	1, 582	63, 738.78	63, 738.78	网下申购
300586	美联新材	2016年12月26日	2017年1月4日	未上市	9.30	9.30	1, 006	9, 355.80	9, 355.80	网下申购
300587	天铁股份	2016年12月28日	2017年1月5日	未上市	14.11	14.11	1, 438	20, 290.18	20, 290.18	网下申购
300588	熙菱信息	2016年12月27日	2017年1月5日	未上市	4.94	4.94	1, 380	6, 817.20	6, 817.20	网下申购
300591	万里马	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市	3.07	3.07	2, 397	7, 358.79	7, 358.79	网下申购
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	未上市	4.00	4.00	26, 695	106, 780.00	106, 780.00	网下申购
603035	常熟汽饰	2016年12月27日	2017年1月5日	未上市	10.44	10.44	2, 316	24, 179.04	24, 179.04	网下申购
603186	华正新材	2016年12月26日	2017年1月3日	未上市	5.37	5.37	1, 874	10, 063.38	10, 063.38	网下申购
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	未上市	23.16	23.16	2, 109	48, 844.44	48, 844.44	网下申购
603266	天龙股份	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市	14.63	14.63	1, 562	22, 852.06	22, 852.06	网下申购
603689	皖天然气	2016年12月30日	2017年1月10日	未上市	7.87	7.87	4, 818	37, 917.66	37, 917.66	网下申购
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	未上市	21.30	21.30	3, 180	67, 734.00	67, 734.00	网下申购

7.4.5.1.2 受限证券类别:债券

本期末(2016 年 12 月 31 日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的债券。

7.4.5.1.3 受限证券类别:其他

本期末(2016 年 12 月 31 日),本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的其他证券。

7.4.5