嘉实美国成长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

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	嘉实美国成长股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实美国成长股票(QDII)	
基金主代码	000043	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年 6 月 14 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	35, 162, 443.16 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇
下属分级基金的交易代码:	000043	000044
报告期末下属分级基金的份额总额	31, 472, 205.95 份	3, 690, 237.21 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于美国大盘成长股票,在股票选择及组合构建方面均运用量化投资方法并结合风险管理手段,力争获取长期资本增值。
投资策略	本基金采用主动的量化投资策略。本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统,构建投资组合。其中,核心模型包括成长性模型、多因子 Alpha 模型、风险预测模型、交易成本模型以及先进的投资组合优化器。嘉实量化投资团队将根据市场外在与内在变化趋势,定期或不定期地对模型进行复核,并做出相应调整,以不断改善模型的适用性。
业绩比较基准	95%× 罗素 1000 成长指数收益率 +5%× 境内银行活期存款税后利率
风险收益特征	本基金主要投资于美国大盘成长股票,属于主动投资的股票型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金,为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。

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 境外资产托管人

本基金基金托管人尚未委托任何第三方机构担任本基金的境外托管人。本基金的境外资产托管业务由基金托管人中国银行有限公司承担。

2.5 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	
	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币	嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇
本期已实现收益	3, 190, 536.69	2, 229, 069.80	2, 412, 490.99	2, 719, 751.55	2, 802, 640.12	1, 756, 903.33
本期利润	4, 450, 010.87	3, 779, 774.46	2, 596, 181.15	2, 458, 176.80	3, 377, 010.55	2, 551, 469.07
加权平均基金份额本期利润	0.1420	0.8450	0.0897	0.4691	0.0728	0.4875
本期加权平均净值利润率	10.79%	10.53%	7.19%	6.11%	6.39%	6.98%
本期基金份额净值增长率	10.88%	3.78%	6.98%	0.75%	6.84%	6.53%
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	8, 720, 116.25	9, 265, 535.87	5, 192, 462.65	8, 238, 331.70	3, 879, 046.76	5, 420, 285.66
期末可供分配基金份额利润	0.2771	2.5108	0.1823	1.7317	0.1017	1.2242
期末基金资产净值	44, 924, 492.07	32, 297, 733.98	36, 651, 824.08	37, 558, 643.56	45, 894, 343.21	32, 710, 319.63
期末基金份额净值	1.427	1.262	1.287	1.216	1.203	1.207
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	42.70%	26.20%	28.70%	21.60%	20.30%	20.70%

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)嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币份额以人民币申购获得人民币份额,赎回获得人民币赎回款;嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇份额以美元申购获得美元份额,赎回获得美元赎回款;(3)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;(4)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;(5)嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇的期末基金份额净值单位为美元。

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

嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币

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	5.00%	0.71%	0.57%	0.57%	4.43%	0.14%
过去六个月	9.26%	0.70%	4.59%	0.56%	4.67%	0.14%
过去一年	10.88%	0.82%	5.13%	0.80%	5.75%	0.02%
过去三年	26.73%	0.86%	20.98%	0.82%	5.75%	0.04%
自基金合同生效起至今	42.70%	0.83%	39.49%	0.80%	3.21%	0.03%

嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇

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	1.12%	0.65%	0.57%	0.57%	0.55%	0.08%
过去六个月	4.38%	0.65%	4.59%	0.56%	- 0.21%	0.09%
过去一年	3.78%	0.81%	5.13%	0.80%	- 1.35%	0.01%
过去三年	11.39%	0.85%	20.98%	0.82%	- 9.59%	0.03%
自基金合同生效起至今	26.20%	0.82%	39.49%	0.80%	- 13.29%	0.02%

注:本基金业绩比较基准为:95%× 罗素 1000 成长指数收益率 +5%× 境内银行活期存款税后利率

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%× 罗素 1000 成长指数收益率(t)+5%× 境内银行活期存款税后利率(t)

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

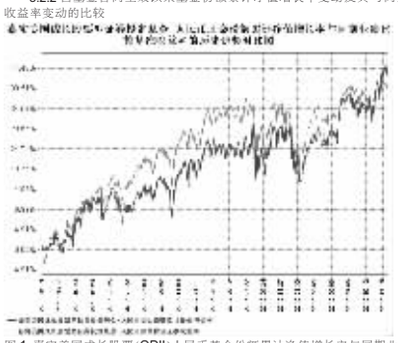


图 1:嘉实美国成长股票(QDII)人民币基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 14 日至 2016 年 12 月 31 日)

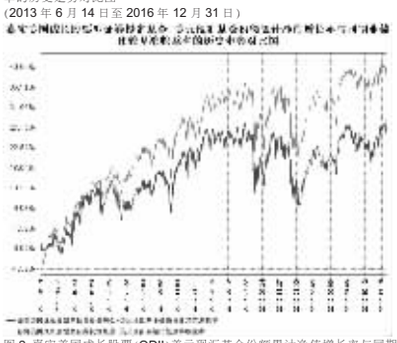
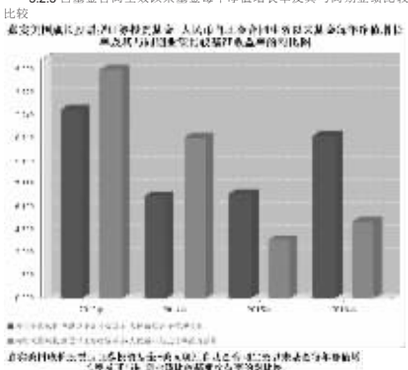


图 2:嘉实美国成长股票(QDII)美元现汇基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 14 日至 2016 年 12 月 31 日)



注:本基金基金合同生效日为 2013 年 6 月 14 日,2013 年度的相关数据根据当年实际存续期(2013 年 6 月 14 日至 2013 年 12 月 31 日)计算。

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		
张自力	本基金、嘉实事件驱动股票基金经理,人工智能投资部负责人	2013 年 6 月 14 日	-	20年	理论物理学博士,毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学,具有 19 年公募基金从业经验。曾任美国世纪投资管理公司(American Century Investments)资深副总经理,研究部总监暨基金经理,负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司,曾任定量投资部负责人,现任投资决策委员会成员、人工智能投资部负责人。

注:(1)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、《嘉实美国成长股票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,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

美国股票市场在 2016 年整体延续前几年的上涨趋势。综合全年来看,市场主要的回撤过程,出现在年初、6 月份英过脱欧的意外结果、11 月美国大选之前的市场不确定过程。受 15 年末加息等多重因素的影响,16 年初经历了较大的短期回撤,此后自 2 月份起市场启动了较为稳健的上行过程。6 月末的英国脱欧公投结果,与市场预期截然相反,引致了较为剧烈的市场波动,美股市场在短期内就完成反弹,该事件更长期的影响还在相关的外汇等市场。11 月初进行的美国总统大选投票之前,由于选情焦灼,特朗普言论过激,市场持续受压,但自大选结果落定,并且特朗普逐步公开其施政纲领,包括各领域的财政刺激计划和开支缩减计划,市场相关行业跟随上涨并带动大盘整体上行,此后不断创造历史新高。

投资业绩上,本基金纯股票头寸相对业绩基准获取了较大的正超额收益,受仓位水平、较高的交易成本和换汇成本的影响,组合净值层面的超额收益略有减损。尤其受今年美元强势的影响,本基金的人民币份额相对美元份额跑赢更多。

行业上,本基金主要配置于信息科技等行业,第二大行业为非必须消费品行业,基于国际油价的因素,低配了石油开采等行业。在 2 月初,本基金针对全球宏观风险和货币政策,配置了黄金类股票资产,为组合获取了较大超额收益。

本年度期间,本基金运作主要包括应对净申赎造成的仓位波动和实现对美国成长股的筛选与投资过程。本基金资金运作流程较长,单向包括从人民币申购、确认、换汇和掉汇等一系列步骤,涉及国内外券商和银行的多个环节,在市场大幅震荡背景下,申赎的不确定性会直接影响仓位水平并影响投资业绩,本基金在保证 90%股票仓位和 5%现金仓位的合规约束下,成功实现了流动性操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币基金份额净值为 1.427 元,本报告期基金份额净值增长率为 10.88%;截至本报告期末嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇基金份额净值为 1.262 美元,本报告期基金份额净值增长率为 3.78%;同期业绩比较基准收益率为 5.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

实体经济上,作为开放型经济体,美国实体经济在受自身内部复苏要素决定的同时,也与世界其他发达和新兴市场紧密相关,受近期国际经济发展环境的疲软,尤其是中国经济增长速度放缓和欧洲政治与经济的波动,美国实体经济增长速度相比之前略有放缓,但从经济内部的结构来看,美国依然是目前世界上最为健康的经济体。

货币政策上,受美国国内经济增长率、失业率与通胀率等各类关键指标的持续向好,美联储进行了第二次加息,并公开表示 17 年将进一步加快加息的节奏。目前,我们仍然预期美国的货币政策将继续保持稳健,美联储会综合考虑利率对实体与金融的多方面影响,稳健把握加息节奏,但 17 年的加息过程将强于 15 和 16 年。

财政政策上,新总统特朗普还未正式上任,但其胜选后披露的各类施政纲领以及重要部门人事任命,引导了较强的财政刺激预期,市场在 11 月份至年末也给予了非常积极的反应。后续将需要根据特朗普上任后的政策落地情况,做出进一步判断。

投资时机上,美国股票市场估值水平依然支持足够的投资机会,企业盈利能力继续向好,估值空间并未缩减。我们认为 2017 年美国股票市场仍将有较好的投资机会,同时已经过去的多个季度表明,美股市场在经历了波动震荡和风格转换后,依然呈现了相对稳健的趋势,我们对后市走势保持乐观向上的判断。

资产类别上,我们早先做出的强势美元的判断被证实,各类美元资产都不同程度的升值。从资产配置的角度,以及从规避货币汇率风险的角度,美元资产都是目前更为有效的投资标的。

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;与估值相关的机构为纽约、纳斯达克交易所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同(十九(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")在嘉实美国成长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

嘉实美国成长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 20652 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:嘉实美国成长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	6, 900, 876.87	5, 104, 345.85
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	71, 767, 975.51	70, 033, 343.54
其中:股票投资		66, 413, 768.88	67, 876, 009.35
基金投资		5, 354, 206.63	2, 157, 334.19
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	27, 530.59	25, 770.89
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	330.57	823.52
应收股利		29, 969.09	29, 911.27
应收申购款		-	128, 911.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	1, 096.05	-
资产总计		78, 727, 778.68	75, 323, 106.10
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		739, 207.76	718, 475.41
应付赎回款		470, 645.96	116, 296.80
应付管理人报酬		120, 824.14	106, 819.93
应付托管费		23, 493.58	20, 770.56
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
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	151, 381.19	150, 275.76
负债合计		1, 505, 552.63	1, 112, 638.46
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	54, 206, 321.68	57, 809, 846.07
未分配利润	7.4.7.10	23, 015, 904.37	16, 400, 621.57
所有者权益合计		77, 222, 226.05	74, 210, 467.64
负债和所有者权益总计		78, 727, 778.68	75, 323, 106.10

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 人民币基金份额净值 1.427 元,基金份额总额 31,472,205.95 份;嘉实美国成长股票型证券投资基金 - 美元现汇基金份额净值 1.262 美元,基金份额总额 3,690,237.21 份。嘉实美国成长股票(QDII)基金份额总额合计为 35,162,443.16 份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实美国成长股票型证券投资基金

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		10, 054, 531.64	6, 956, 211.08
1.利息收入		15, 862.40	22, 123.90
其中:存款利息收入	7.4.7.11	15, 862.40	22, 123.90
债券利息收入		-	-
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		6, 994, 835.90	6, 663, 836.46
其中:股票投资收益	7.4.7.12	5, 926, 581.22	6, 071, 440.09
基金投资收益	7.4.7.13	47, 238.68	- 348, 310.98
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1, 021, 016.00	940, 707.35
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	2, 810, 178.84	- 77, 884.59
4.汇兑收益	7.4.7.21	189, 943.57	270, 967.04
5.其他收入	7.4.7.18	43, 710.93	77, 168.27
减:二、费用		1, 824, 746.31	1, 901, 853.13
1. 管理人报酬		1, 385, 130.14	1, 374, 885.16
2. 托管费		269, 330.88	267, 338.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	14, 168.48	80, 244.44
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.20	156, 116.81	179, 384.77
三、利润总额		8, 229, 785.33	5, 054, 357.95
减:所得税费用		-	-
四、净利润		8, 229, 785.33	5, 054, 357.95

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实美国成长股票型证券投资基金

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)	57, 809, 846.07	16, 400, 621.57	74, 210, 467.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	8, 229, 785.33	8, 229, 785.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 3, 603, 524.39	- 1, 614, 502.53	- 5, 218, 026.92
其中:1.基金申购款	31, 931, 564.82	10, 128, 130.46	42, 059, 695.28
2.基金赎回款	- 35, 535, 089.21	- 11, 742, 632.99	- 47, 277, 722.20
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)	54, 206, 321.68	23, 015, 904.37	77, 222, 226.05
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)	65, 429, 664.91	13, 174, 997.93	78, 604, 662.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	5, 054, 357.95	5, 054, 357.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 7, 619, 818.84	- 1, 828, 734.31	- 9, 448, 553.15
其中:1.基金申购款	52, 504, 824.93	12, 888, 344.66	65, 393, 169.59
2.基金赎回款	- 60, 124, 643.77	- 14, 717, 078.97	- 74, 841, 722.74
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)	57, 809, 846.07	16, 400, 621.57	74, 210, 467.64

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	基金管理人股东
立信投资有限责任公司	基金管理人股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人股东
德意志证券亚洲有限公司	与基金管理人股东处于同一控股集团

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

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位: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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	165, 082, 293.37	91.34%	31, 488, 765.80	22.44%

7.4.4.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.4.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.4.1.4 基金交易

金额单位: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	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	17, 764, 492.69	89.28%	260, 778.12	1.49%

7.4.4.1.5 权证交易

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权证交易。

7.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	10, 365.05	50.74%	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
德意志证券亚洲有限公司	16, 079.35	20.44%	-	-

注:上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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	1, 385, 130.14	1, 374, 885.16
其中:支付销售机构的客户维护费	482, 787.23	480, 499.56

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8%的年费率计提,逐日累计