

信息披露 Disclosure

嘉实稳健开放式证券投资基金 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

基金管理人承诺，就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，并由基金托管人复核。

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。

本基金为嘉实理财系列证券投资基金之一，嘉实理财系列证券投资基金由具有不同风险收益特征的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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。

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
基金简称	嘉实稳健混合
基金代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期限	2007年7月9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	3,360,747,642.92份
报告期末基金份额持有人数量	47,881

2.2 基金产品说明

投资目标	稳健增值，满足基金持有人资产增值需求，以获取本基金收益和基金资产增值收益为主要目标，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。本基金采取积极资产配置策略，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券综合指数收益率
风险收益特征	本基金为证券投资基金，属于证券投资基金中风险收益特征较高的品种，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券基金、混合基金等品种。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	魏善春	王冠
信息披露负责人	曹永祥	王冠
客户服务电话	400-600-8880	95566
传真	(010) 65182266	(010) 65182266

2.4 信息披露方式

基金年度报告正文的披露网站及查阅地址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告摘要披露网站	北京市西城区大街8号中国工商银行大厦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

项目	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-196,355,102.01	3,849,260,436.48	319,344,583.32
本期利润	-482,347,123.96	2,744,180,374.19	824,635,538.57
加权平均基金份额净收益	-0.1292	0.8221	0.6825
加权平均基金份额净收益	-0.1292	0.8221	0.6825
本期基金份额净值增长率	-11.17%	20.77%	12.34%
312期末基金份额总额	3,360,747,642.92	3,360,747,642.92	3,360,747,642.92
期末可供分配基金份额利润	1,827,711,689.30	2,580,272,002.18	1,530,674,901.31
期末可供分配基金份额利润	0.578	0.774	0.470
期末基金资产净值	3,366,617,603.17	4,352,758,570.35	8,107,262,766.57
期末基金份额净值	1.008	1.214	1.080
312期末基金份额净值	1.008	1.214	1.080
312期末基金份额净值增长率	36.77%	35.71%	25.02%

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)扣除相关费用后的净额，本期利润为本期已实现收益加上公允价值变动收益；(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

期间	基金份额净值增长率	业绩比较基准收益率	差额
过去1个月	-1.02%	0.86%	-0.06%
过去3个月	-1.26%	0.69%	-0.27%
过去6个月	-11.17%	12.61%	-23.78%
过去12个月	36.77%	15.5%	21.27%
过去24个月	40.43%	13.9%	26.54%
过去36个月	36.77%	12.6%	24.17%

注：本基金业绩比较基准为：60%×沪深300指数收益率+40%×中债总指数收益率。

3.2.2 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.3 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.4 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.5 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.6 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.7 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.8 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.9 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.10 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.11 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.12 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.13 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.14 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.15 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.16 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.17 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.18 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.19 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.20 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.21 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.22 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.23 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

3.2.24 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

4.1.2 基金业绩归因分析

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

本基金业绩归因分析采用多因素模型，将基金净值增长率归因于资产配置、行业配置、个股选择等因素。

4.1.2.1 受限证券类别：债券

本期未(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。

4.1.2.2 受限证券类别：其他

本期未(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。

4.1.2.3 受限证券类别：股票

本期未(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股票。

4.1.2.4 受限证券类别：其他

本期未(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。

4.1.2.5 受限证券类别：其他

本期未(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。

4.1.2.6 受限证券类别：其他

本期未(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。

4.1.2.7 受限证券类别：其他

本期未(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。

4.1.2.8 受限证券类别：其他