嘉实新兴产业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：中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	嘉实新兴产业股票型证券投资基金
基金简称	嘉实新兴产业股票
基金主代码	000751
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 9 月 17 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	126,426,583.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，分享新兴产业带来的投资机会，力求获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金重点配置股票资产，同时从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。 本基金相对淡化宏观指标，从中观层面分析各行业和上市公司的不同特征，识别经济发展过程中具有良好发展前景、竞争结构相对稳定的行业，从中挑选具备卓越商业模式和较强竞争力的优质企业。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率× 95%+中国债券总指数收益率× 5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种。其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	林霄
	联系电话	（010）65215588	（010）66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400- 600- 8800	95599
传真		（010）65182266	（010）68121816

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 9 月 17 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	- 163, 826, 815.93	297, 975, 424.24	27, 952, 755.86
本期利润	- 110, 951, 205.82	252, 722, 266.17	19, 065, 317.75
加权平均基金份额本期利润	- 0.4709	0.4921	0.0336
本期加权平均净值利润率	- 33.31%	32.17%	3.28%
本期基金份额净值增长率	- 7.71%	56.78%	1.80%
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	43, 457, 200.18	323, 656, 008.71	7, 724, 704.55
期末可供分配基金份额利润	0.3437	0.5958	0.0182
期末基金资产净值	186, 259, 581.91	866, 842, 133.50	432, 468, 152.64
期末基金份额净值	1.473	1.596	1.018
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	47.30%	59.60%	1.80%

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	- 4.60%	0.81%	- 2.04%	0.75%	- 2.56%	0.06%
过去六个月	0.41%	0.85%	0.70%	0.84%	- 0.29%	0.01%
过去一年	- 7.71%	1.40%	- 17.27%	1.65%	9.56%	- 0.25%
自基金合同生效起至今	47.30%	1.75%	25.94%	2.14%	21.36%	- 0.39%

注：本基金业绩比较基准为：中证新兴产业指数收益率× 95%+ 中国债券总指数收益率× 5%

中证新兴产业指数是由中证指数有限公司编制，选择沪深市中规模大、流动性好的 100 家上市的新兴产业的公司组成，能够综合反映沪深市中新兴产业公司的整体表现。其中，新兴产业股票是指产品有稳定并有发展前景的市场需求；有良好的经济技术效益；能带动一批产业的兴起。

中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券(如交易所和银行间国债、银行间金融债等)。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

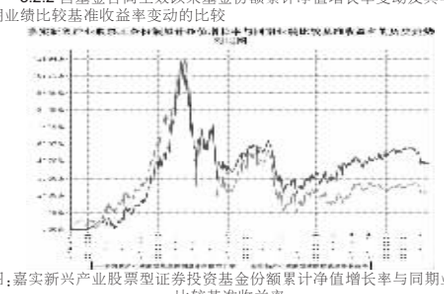
Benchmark(0)=1000

Return (t)=95%* 中证新兴产业指数 (t)/ 中证新兴产业指数(t-1)-1) +5%*(中国债券总指数(t)/ 中国债券总指数(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：嘉实新兴产业股票型证券投资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

（2014 年 9 月 17 日至 2016 年 12 月 31 日）

注 1：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(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

注 2：2016 年 3 月 15 日，本基金管理人发布《关于嘉实新兴产业股票基金经理变更的公告》，王汉博先生不再担任本基金基金经理职务，聘请季文华先生担任本基金基金经理职务。

3.2.3 自基金合同生效以来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：本基金基金合同生效日为 2014 年 9 月 17 日，2014 年度的相关数据根据当年实际存续期（2014 年 9 月 17 日至 2014 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§ 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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
季文华	本基金、嘉实优化红利混合基金经理	2016年 3 月 15 日	-	5年	曾任兴业证券证券研究分析师。2012 年加入嘉实基金管理有限公司，任研究部研究员一职。现任职于股票投资部。
王汉博	本基金、嘉实泰和混合基金经理	2014年 9 月 17 日	2016年 3 月 15 日	7年	2008年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、研究部新兴产业组组长、基金经理助理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)基金经理王汉博的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理季文华的任职日期是指公司作出决定后公告之日，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、《嘉实新兴产业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。对交易所开充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

2016 年资本市场是不平静的一年。年初受到熔断的影响，市场出现大幅调整，投资者情绪受到较大的挫伤。年末由于货币政策转向，利率飙升，债券市场跌幅巨大。这对于基金管理人带来了一定的挑战。

从宏观层面来看，虽然中国宏观经济数据和企业盈利短期转好，但其持续性有待观察。需求端持续性不强，未来房地产市场逐步降温后，经济下行压力会逐步显现。展望未来一段时间，投资环境总体面临较多挑战，通胀压力迅速加大，增长持续性存疑，“类滞胀”的格局可能出现。近期债券市场的猛烈调整与利率的上升可能产生传导效应。与此同时，联储货币政策进一步对汇率带来压力，同时压缩货币政策进一步宽松的空间。美国民选总统川普的执政历年，也可能加剧全球贸易和地缘政治摩擦，进一步影响风险偏好。

从投资策略来看，我们判断总体投资环境偏谨慎，因此适度控制仓位水平。在精选成长股的同时，也积极关注低估值、可能超预期的行业与个股的投资机会，对于业绩有超预期可能或存在“举牌”可能的低估值个股也有布局。在深港通的背景下，我们密切重视 A 股机构化比例持续提升这一大的趋势，这将对资本市场带来深远的影响。在个股选择上大幅提高对成长股的投资标准和要求，防范可能的估值收缩风险。从新增资金选择、估值包括供给等因素来看，成长类个股面临的负面因素可能较大，未来的分化会进一步加大。未来我们将持续关注高景气的子行业和拥有核心竞争力的公司。

回顾本组合的操作，一季度我们持谨慎的观点，本着积极防御的态度。二季度参与反弹，精选个股。三季度我们通过行业比较，在中观层面对高景气的子行业进行前瞻性布局，寻找一些基本面有重大变化的优质公司。四季度我们相对谨慎，不仅控制了仓位，在资产配置上优先布局防御性较强的食品饮料和医疗保健板块。从配置的结构来看，高景气的电子行业，石化行业，以及受益于供给侧改革的化工行业均有所涉及。尽量保持组合的均衡，减少波动。

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 1.473 元；本报告期基金份额净值增长率为 -7.71%，业绩比较基准收益率为 -17.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然中国宏观经济数据和企业盈利短期转好，但其持续性有待观察。需求端持续性不强，未来房地产市场逐步降温后，经济下行压力会逐步显现。

展望未来一段时间，投资环境总体偏负面的格局将会持续，通胀压力迅速加大，增长持续性存疑，货币政策收紧的信号越发明确。在特朗普当选后外部因素的扰动可能进一步加大，贸易战的可能性会加大。

从中期来看，结合市场增量资金、供给需求、投资者结构变化等因素，高估值中小盘成长股整体面临估值调整和分化的较大压力。虽不排除春季行情的可能性，但如果市场在春节后出现季节性修复性反弹将是非常好的调整组合结构的时间窗口。

我们也注意到，目前新股发行加速，上市公司的稀缺性减弱，而优质公司可能会更受到投资者的认可。此外，在沪港通和深港通融的大背景下，机构投资者的比重空前加大，这将对于 A 股投资带来深远的影响，未来投资行为将更为规范。

因此，本组合的仓位相对较低，积极防御，伺机而动。在资产配置上，医药生物、食品饮料、银行以及电子是配置比例较高的板块。在个股选择上，尽量回避高估值的个股，远离壳资源、概念股等没有安全边际的公司。以低估值的价值股和估值合理的成长股为主，精选有竞争力的优质公司。

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 -110,951,205.82 元，以及本基金基金合同(十六(三)基金收益分配原则)的约定，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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 报告期内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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

嘉实新兴产业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 20679 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：嘉实新兴产业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	15, 894, 235.00	146, 396, 592.68
结算备付金		745, 609.02	-
存出保证金		273, 075.71	710, 919.85
交易性金融资产	7.4.7.2	161, 820, 648.29	721, 421, 811.13
其中：股票投资		150, 858, 048.29	721, 421, 811.13
基金投资		-	-
债券投资		10, 962, 600.00	-
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	9, 300, 000.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	104, 196.43	30, 138.46
应收股利		-	-
应收申购款		43, 530.75	1, 071, 268.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		188, 181, 295.20	869, 630, 730.12

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		927, 479.46	-
应付赎回款		37, 803.51	970, 110.93
应付管理人报酬		243, 101.35	1, 107, 783.36
应付托管费		40, 516.92	184, 630.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	312, 724.81	153, 686.39
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	360, 087.24	372, 385.37
负债合计		1, 921, 713.29	2, 788, 596.62
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	126, 426, 583.51	543, 186, 124.79
未分配利润	7.4.7.10	59, 832, 998.40	323, 656, 008.71
所有者权益合计		186, 259, 581.91	866, 842, 133.50
负债和所有者权益总计		188, 181, 295.20	869, 630, 730.12

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.473 元，基金份额总额 126,426,583.51 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实新兴产业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		- 101, 083, 762.10	271, 029, 662.44
1.利息收入		493, 115.12	1, 023, 571.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	371, 163.74	1, 023, 571.98
债券利息收入		84, 486.03	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		37, 465.35	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		- 155, 419, 611.62	310, 224, 943.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	- 156, 543, 639.80	303, 843, 237.76
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
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	1, 124, 028.18	6, 381, 705.71
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	52, 875, 610.11	- 45, 253, 158.07
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	967, 124.29	5, 034, 305.06
减：二、费用		9, 867, 443.72	18, 307, 396.27
1. 管理人报酬		5, 075, 040.60	11, 699, 023.86
2. 托管费		845, 840.15	1, 949, 837.32
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3, 558, 924.61	4, 250, 636.71
5. 利息支出		5, 574.72	-
其中：卖出回购金融资产支出		5, 574.72	-
6. 其他费用	7.4.7.19	382, 063.64	407, 898.38
三、利润总额		- 110, 951, 205.82	252, 722, 266.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润		- 110, 951, 205.82	252, 722, 266.17

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实新兴产业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）	543, 186, 124.79	323, 656, 008.71	866, 842, 133.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	- 110, 951, 205.82	- 110, 951, 205.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 416, 759, 541.28	- 152, 871, 804.49	- 569, 631, 345.77
其中：1.基金申购款	47, 553, 222.16	21, 504, 930.41	69, 058, 152.57
2.基金赎回款	- 464, 312, 763.44	- 174, 376, 734.90	- 638, 689, 498.34
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）	126, 426, 583.51	59, 832, 998.40	186, 259, 581.91

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）	424, 743, 448.09	7, 724, 704.55	432, 468, 152.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	252, 722, 266.17	252, 722, 266.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	118, 442, 676.70	63, 209, 037.99	181, 651, 714.69
其中：1.基金申购款	997, 032, 160.83	492, 084, 661.10	1, 489, 116, 821.93
2.基金赎回款	- 878, 589, 484.13	- 428, 875, 623.11	- 1, 307, 465, 107.24
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）	543, 186, 124.79	323, 656, 008.71	866, 842, 133.50

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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	5, 075, 040.60	11, 699, 023.86
其中，支付销售机构的客户维护费	620, 248.21	1, 011, 765.66

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	845, 840.15	1, 949, 837.32

注：支付基金托管人中国农业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

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
中国农业银行	15, 894, 235.00	349, 949.49	146, 396, 592.68	961, 613.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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
002643	万润股份	2016年 8 月 17 日	2017年 8 月 18 日	非公开发行流通受限	43.31	36.30	60, 263	2, 609, 990.53	2, 187, 546.90	-
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