嘉实医疗保健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	嘉实医疗保健股票型证券投资基金
基金简称	嘉实医疗保健股票
基金主代码	000711
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年 8 月 13 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	1,258,512,258.70 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金优选医疗保健行业股票, 在严格控制投资风险的条件下,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金,浇化大类资产配置,主要通过医疗保健子行业间的灵活配置和行业内个股的精选实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率× 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@sfund.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 8 月 13 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	- 218,810,517.69	100,262,720.15	4,239,542.69
本期利润	- 256,004,761.52	168,100,212.23	- 36,437,438.41
加权平均基金份额本期利润	- 0.2031	0.1322	- 0.0269
本期加权平均净值利润率	- 16.26%	9.79%	- 2.65%
本期基金份额净值增长率	- 12.10%	52.63%	- 3.10%
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	- 35,141,059.90	196,378,695.25	- 41,535,271.67
期末可供分配基金份额利润	- 0.0279	0.1453	- 0.0305
期末基金资产净值	1,635,479,037.10	1,998,560,577.61	1,320,036,733.51
期末基金份额净值	1.300	1.479	0.969
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	30.00%	47.90%	- 3.10%

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	- 1.66%	0.69%	- 2.58%	0.65%	0.92%	0.04%
过去六个月	5.69%	0.76%	4.54%	0.74%	1.15%	0.02%
过去一年	- 12.10%	1.66%	- 11.35%	1.57%	- 0.75%	0.09%
自基金合同生效起至今	30.00%	2.26%	36.73%	1.95%	- 6.73%	0.31%

注:本基金业绩比较基准为:中证医药卫生指数收益率× 95%+ 中国债券总指数收益率× 5%

中证医药卫生指数是中证 800 指数 800 只样本股中按行业分类标准选出的医药卫生行业全部股票作为样本编制指数, 涵盖全市场医药行业股票中的较好投资标的。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%*(中证医药卫生指数(t)/ 中证医药卫生指数(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

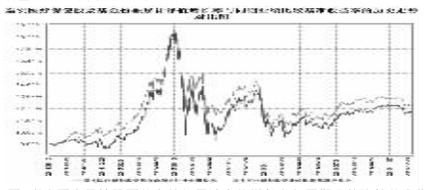
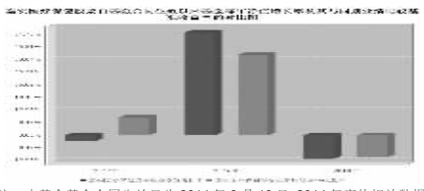


图:嘉实医疗保健股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 8 月 13 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(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

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 8 月 13 日,2014 年度的相关数据根据当年实际存续期(2014 年 8 月 13 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
齐海滔	本基金、嘉实主题新动力混合基金经理	2014 年 8 月 13 日	-	13年	曾任长城证券有限责任公司行业研究员,任银华基金管理有限公司研究员。天华证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金基金经理。2011 年 4 月加盟嘉实基金管理有限公司,曾任投资经理。硕士研究生。具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)基金经理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、《嘉实医疗保健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

报告期内,市场先跌后涨,指数的损失主要来自于年初的熔断及后续的高估值中小盘股票估值挤泡沫,上证指数最低点出现在 1 月底,之后低估值大市值板块引领市场上涨,但到年底仍未收复年初的下跌,而创业板全年均处在调整的趋势中。从全年来看,上证综指下跌 12.31%,上证 50 下跌 5.53%,中证 500 指数下跌 17.78%,深圳成指下跌 19.64%,中小板指数下跌 22.89%,创业板指数下跌 27.71%。

分行业看,食品饮料和建筑材料全年取得正收益,建筑装饰、家电、银行也显著跑赢大盘,传媒和计算机全年表现最差。从风格上看,大盘股显著跑赢小盘股,低估值显著跑赢高估值,价值显著跑赢成长。从主题上看,股权转让、PPP、国企混改表现出色。

报告期内,医药行业表现与市场类似,医药生物(申万)下跌了 13.46%,在申万一级行业中排名居中,主要原因还是行业内来自中小板、创业板的高估值股票较多。在二级子行业中,估值相对较低且有政策催化的医药商业和化学制药表现相对较好,高估值的医疗器械和医疗服务跑输,特别是医疗器械,跌幅超过 23%,大幅跑输行业指数。

组合在 2016 年并未做明显的仓位调整,损失主要出现在年初的熔断。组合在 3 月份调整了结构,增加了血液制品和优质处方药公司的持仓比例,组合业绩开始改善,不过,1-2 月份落后过多,全年业绩不佳。结构上主要按照 3 个方向来配置,即强劲的内生增长、行业变革期受益的环节以及有模式创新的公司,具体到医药子行业上,超配了医药商业、生物医药、化学制药,低配了中药和医疗服务。

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 1.300 元;本报告期基金份额净值增长率为 -12.10%,业绩比较基准收益率为 -11.35%。

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 2017 年的经济环境,预计我国处在内外再平衡的局面中,稳中求进,稳是主基调,房地产、汽车、基建增速均将有所回落,出口或受益于贬值,但美国对我国的贸易制裁具有较大不确定性,预计经济增速继续下行。工业利润的增量主要来自于价格上涨的石油、煤炭等上游行业,由于房地产、汽车、基建的需求增速减弱,主要靠需求拉动而价格上涨的定价权在国内的工业品,预计将随着终端需求的减弱而见顶。在成本快速上升的环境下,中下游工业企业的压力加大。PPI 对 CPI 的传导效应会逐渐体现,2017 年通胀是影响市场的重大变量,特别是在上半年。货币政策预计保持稳健中性,实际上偏紧。人民币贬值预计幅度可控。

2017 年的 A 股市场,更可能是一个平衡市,但中间仍可能出现阶段性的较大波动,主要风险在货币政策阶段性的扰动(通胀、汇率、房价等因素制约)、金融去杠杆的推进造成的收紧。从行业和风格上看,考虑到逐渐见顶的盈利增速和已经不再便宜的估值,价值股和强周期行业继续靠景气超预期来继续提升估值的概率不大,而小市值成长股系统性的估值挤泡沫虽然仍未结束,但是部分优质个股已经进入布局区间,因此,2017 年可能难以出现之前几年那样极其明显的市场风格特征,价值股大概率继续跑赢,但幅度不大。总体判断, 2017 年可能是一个个股结构性机会明显的市场,需要更多的从个股选择上下功夫。

随着医保控费力度的逐渐加大,医药行业增速下降,医药股业绩增速普遍性出现下滑,行业进入市场化的供给侧改革阶段,长期来看,业绩确定性高增长的公司变得稀缺,具有更大的机会。医药行业正处于变革期,变革期受益的环节是组合的重点配置领域,如处方药外流受益的医药流通领域。由于前期降价政策的冲击,部分处方药公司的估值受到了很大的压制,随着政策的逐渐消化,优质处方药公司有望在 2017 年迎来估值修复的机会。

医药行业目前整体估值依旧较高,鱼龙混杂,2017 年全年来看,行业将严重分化,传统医药白马股在 2017 年的相对收益机会在变大,一方面是传统医药白马股估值较为合理,另一方面,预计一批白马股会有积极变化,正向的变化会提升白马股的估值。

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 -256,004,761.52 元、3.1.2"期末可供分配利润"为 -35,141,059.90 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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在嘉实医疗保健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

嘉实医疗保健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 20673 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:嘉实医疗保健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	112,670,643.45	122,998,935.38
结算备付金		1,541,147.81	212,021.02
存出保证金		186,668.57	1,068,119.86
交易性金融资产	7.4.7.2	1,521,636,128.30	1,882,435,310.81
其中:股票投资		1,521,636,128.30	1,882,435,310.81
基金投资		-	-
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	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,089,493.55	-
应收利息	7.4.7.5	30,486.15	28,635.95
应收股利		-	-
应收申购款		344,609.47	1,824,786.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,639,499,177.30	2,008,567,809.55
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		-	1,980.00
应付赎回款		854,579.36	6,129,903.01
应付管理人报酬		2,086,406.12	2,509,765.06
应付托管费		347,734.37	418,294.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	339,904.42	543,221.98
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	391,515.93	404,067.71
负债合计		4,020,140.20	10,007,231.94
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,258,512,258.70	1,351,552,552.50
未分配利润	7.4.7.10	376,966,778.40	647,008,025.11
所有者权益合计		1,635,479,037.10	1,998,560,577.61
负债和所有者权益总计		1,639,499,177.30	2,008,567,809.55

注:报告截止日 2016 年 12 月 31 日,基金份额净值 1.300 元,基金份额总额 1,258,512,258.70 份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实医疗保健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		- 225,796,301.64	205,239,761.39
1.利息收入		907,402.28	942,110.02
其中:存款利息收入	7.4.7.11	907,402.28	942,110.02
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		- 191,028,339.46	110,184,710.10
其中:股票投资收益	7.4.7.12	- 200,833,239.20	104,485,618.78
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	9,804,899.74	5,699,091.32
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	- 37,194,243.83	67,837,492.08
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	1,518,879.37	26,275,449.19
减:二、费用		30,208,459.88	37,139,549.16
1. 管理人报酬		23,633,013.58	25,569,497.48
2. 托管费		3,938,835.64	4,261,582.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,213,148.81	6,857,063.09
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	423,461.85	451,405.75
三、利润总额		- 256,004,761.52	168,100,212.23
减:所得税费用		-	-
四、净利润		- 256,004,761.52	168,100,212.23

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实医疗保健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)	1,351,552,552.50	647,008,025.11	1,998,560,577.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	- 256,004,761.52	- 256,004,761.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 93,040,293.80	- 14,036,485.19	- 107,076,778.99
其中:1.基金申购款	501,415,388.97	135,220,545.88	636,635,934.85
2.基金赎回款	- 594,455,682.77	- 149,257,031.07	- 743,712,713.84
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)	1,258,512,258.70	376,966,778.40	1,635,479,037.10
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)	1,361,572,005.18	- 41,535,271.67	1,320,036,733.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	168,100,212.23	168,100,212.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 10,019,452.68	520,443,084.55	510,423,631.87
其中:1.基金申购款	3,622,991,949.81	1,755,860,835.65	5,378,852,785.46
2.基金赎回款	- 3,633,011,402.49	- 1,235,417,751.10	- 4,868,429,153.59
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)	1,351,552,552.50	647,008,025.11	1,998,560,577.61

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	23,633,013.58	25,569,497.48
其中:支付销售机构的客户维护费	8,104,716.57	8,902,376.01

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	3,938,835.64	4,261,582.84

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

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

份额单位:份

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
期初持有的基金份额	7,860,849.05	-
期间申购 / 买入总份额	-	7,860,849.05
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回 / 卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,860,849.05	7,860,849.05
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.62%	0.58%

注:(1)本报告期内(2016 年 1 月 1 日至 2016 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。

(2)上年度可比期间(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日),本基金管理人于 2015 年 7 月 7 日申购本基金基金份额 7,860,849.05 份,申购费 1000 元。

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	112,670,643.45	883,120.00	122,998,935.38	864,707.89

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
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
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

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。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002462	嘉事堂	2016年 9 月 28 日	重大事项停牌	43.68	2017年 1 月 12 日	38.98	1,287,223	54,480,693.05	56,225,900.64	-
000411	英特集团	2016年 12 月 27 日	重大事项停牌	22.10	2017年 1 月 11 日