嘉实优质企业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：上海浦东发展银行股份有限公司
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。

基金托管人上海浦东发展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》，嘉实优质企业股票型证券投资基金自 2015 年 8 月 3 日起更名为嘉实优质企业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	嘉实优质企业混合型证券投资基金
基金简称	嘉实优质企业混合
基金主代码	070099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年 12 月 8 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,685,211,945.15 份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	力争为基金份额持有人创造长期超额收益
投资策略	在具备足够多、预期收益率良好的投资标的时优先考虑股票类资产配置，剩余配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资以自下而上的个股精选策略为主，结合行业配置适度均衡策略，构造和优化组合；通过新股申购、债券投资及衍生工具等投资策略，规避风险、增强收益。
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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	朱萍
	联系电话	（010）65215588	（021）61618888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	Zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		400- 600- 8800	95528
传真		（010）65182266	021- 63602540

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	- 86,590,235.05	1,823,604,560.26	462,334,879.00
本期利润	- 503,069,054.01	2,112,991,983.90	14,079,036.79
加权平均基金份额本期利润	- 0.2281	0.9754	0.0034
本期加权平均净值利润率	- 15.66%	60.39%	0.36%
本期基金份额净值增长率	- 16.35%	77.05%	2.22%
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	637,233,466.00	1,667,153,324.69	161,601,461.56
期末可供分配基金份额利润	0.3781	0.8516	0.0567
期末基金资产净值	2,319,595,047.97	3,621,700,357.94	3,005,182,168.20
期末基金份额净值	1.376	1.850	1.055
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	57.60%	88.40%	64.41%

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	- 8.69%	0.85%	1.67%	0.67%	- 10.36%	0.18%
过去六个月	- 10.12%	0.87%	4.78%	0.72%	- 14.90%	0.15%
过去一年	- 16.35%	1.81%	- 10.50%	1.33%	- 5.85%	0.48%
过去三年	51.39%	2.18%	41.34%	1.70%	10.05%	0.48%
过去五年	96.02%	1.85%	41.15%	1.54%	54.87%	0.31%
自基金合同生效起至今	57.60%	1.74%	- 30.41%	1.77%	88.01%	- 0.03%

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

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：

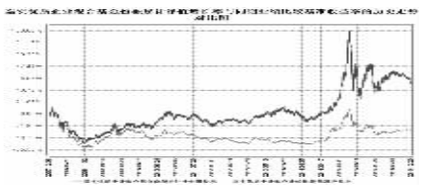
Benchmark(0)=1000

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



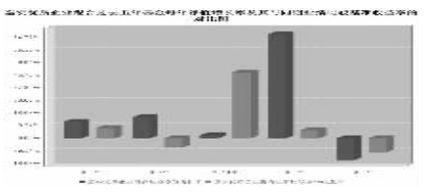
图：嘉实优质企业混合累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2007 年 12 月 8 日至 2016 年 12 月 31日）

注 1:本基金由嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金转型而成，自 2007 年 12 月 8 日（含当日）起，本基金基金合同生效，嘉实浦安保本基金基金合同失效。

注 2:按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 3 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第十八条（（二）投资范围和（八）投资组合比例限制）的规定：(1)本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；(2) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；(3)基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；(4)《基金法》及其他有关法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	1.7040	223,067,669.07	135,672,740.80	358,740,409.87	
2015	0.1140	17,233,843.79	13,003,659.78	30,237,503.57	
2014	0.0850	24,558,487.18	16,650,803.56	41,209,290.74	
合计	1.9030	264,860,000.04	165,327,204.14	430,187,204.18	

§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		
胡涛	本基金基金经理	2014 年 8 月 20 日	-	14年	曾任北京证券有限责任公司投资银行部经理、中国国际金融有限公司股票研究经理、长盛基金管理有限公司研究员、友邦华泰基金管理有限公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司专户投资部副总经理、研究部研究主管、基金经理等职务。2014 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，现任 GARP 策略组组长。美国印第安纳大学凯利商学院 MBA，具有基金从业资格，中国国籍。

注：(1)任职日期、离任日期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、《嘉实优质企业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，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 年市场下跌较多，结构上分化也较大。上证 50 指数相对中小创业板跌幅较少表现出较大的超额收益。市场下跌较多主要因为投资者对宏观系统性风险因素的过度悲观，如人民币贬值，美国加息导致的国内货币宽松政策受限，大宗商品上涨导致滞涨担忧，利率上升以及中小盘创业板股票 2015 年涨幅过大估值较高等多因素叠加。

四季度市场在 FPI 涨价和险资举牌预期下表现出明显的结构分化行情，大盘周期价值股明显跑赢中小盘成长股。最后虽然在煤炭复产以及险资举牌受到一定限制情况下，分化行情有所收敛，但是在 FPI 涨价预期以及金融降杠杆的压力下大盘表现为持续下跌，很多个股特别是中小盘成长股累计跌幅较大。

我们认为市场一定程度上过度悲观预期了通胀、贬值、去杠杆等负面压力。随着终端需求房地产、汽车等增速已经开始放缓，以及供给端在价格上涨预期下的扩产，通胀压力预计在明年一季度末会减小。美元在加息预期下目前升值较多，随着加息落定后预计升值压力也会减小。金融去杠杆对目前杠杆较大的商品以及债券会影响较大，股票可能会在资金在大类资产配置中流动有所受益。

本基金投资策略基本对市场不悲观，积极捕捉结构性投资机会。我们认为市场的投资机会就来源于投资者情绪的过度悲观，操作上基本还是延续以前的风格，以自下而上选股为主，基本不调整仓位，组合中股票基本还是基于长期基本面的质地优秀而投资，短期波段操作考虑较少。主要增持了业绩超预期并且估值合理的个股，减持了基本面不达预期的个股。

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 1.376 元；本报告期基金份额净值增长率为 -16.35%，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 2017 年，宏观经济方面我们预计 GDP 目标将由 6.5%至 7%调整到 6.5%左右，房地产受调控影响投资和销售将下降；汽车受购置税优惠政策退坡影响销量和产量将下降；基建投资受限于财政支出但倚重于 PPP 等模式，或处高位但难再上行；出口受益于持续贬值影响会有所恢复，但美对华贸易如何制裁有不确定性。预计全年 GDP 增速 6.5%左右。预计上市公司盈利仍能维持正增长，但增速见顶回落。

金融去杠杆大背景下，股票市场也不是受杠杆抽离冲击最快，压力最大的资产。股市资金面有望因相对吸引力的提升而临改善。主要的风险在于货币政策阶段性收紧过度（通胀、汇率、房价等因素牵制），以及金融去杠杆的加速推进造成金融体系整体的流动性收紧。外部主要的风险在于地缘政治风险。上行空间主要考虑年中或有的通胀见顶、美元见顶、政策重新摆向稳增长的情景。

结构上看，低估值价值股和强周期类股票经历了一整年的估值修复和业绩上升，但考虑到逐渐见顶的盈利增速和告别底部的市盈率，要靠景气度大幅超预期来继续提升估值的机会不大。

成长型风格少数优质个股进入布局区间，预计在创业板指数进一步的估值消化后将出现系统性机会。

投资策略上我们对前期已经下跌的优质成长股不过度悲观，目前很多优质价值成长股已经很便宜，本基金操作上主要对下跌中优质成长股逐渐加仓。

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)本基金的基金管理人于 2016 年 1月 15 日发布《嘉实优质企业混合型证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31日，每 10 份基金份额发放现金红利 1.704 元，具体参见本报告“7.4.11利润分配情况”。

(2)报告期内本基金未实施利润分配。

(3) 根据本报告 3.1.1“本期利润”为 -503,069,054.01以及本基金基金合同（二十三（三）收益分配原则）“3、如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配”，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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对嘉实优质企业混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对嘉实优质企业混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了一次利润分配，分配金额为 358,740,409.87 元。

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

本报告期内，由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的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）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6审计报告

嘉实优质企业混合型证券投资基金 2016 年度财务会计报告已由安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师汤骏、贺耀签字出具了“无保留意见的审计报告”（安永华明(2017)审字第 60468756_A02 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：嘉实优质企业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	148,668,713.41	229,386,235.31
结算备付金		-	312,557.77
存出保证金		696,564.87	1,234,290.11
交易性金融资产	7.4.7.2	2,178,793,714.56	3,386,548,478.45
其中：股票投资		2,178,793,714.56	3,386,548,478.45
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		-	14,704,631.10
应收利息	7.4.7.5	61,797.34	97,160.47
应收股利		-	-
应收申购款		489,102.60	2,604,969.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,328,709,892.78	3,634,888,323.14
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		-	-
应付赎回款		4,240,659.10	6,735,669.01
应付管理人报酬		2,959,186.66	4,575,926.12
应付托管费		493,197.78	762,654.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	509,599.69	194,978.00
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	912,201.58	918,737.69
负债合计		9,114,844.81	13,187,965.20
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,682,361,581.97	1,954,547,033.25
未分配利润	7.4.7.10	637,233,466.00	1,667,153,324.69
所有者权益合计		2,319,595,047.97	3,621,700,357.94
负债和所有者权益总计		2,328,709,892.78	3,634,888,323.14

注：报告截止日 2016 年 12 月 31日，基金份额净值 1.376 元，基金份额总额 1,685,211,945.15 份。

7.2利润表

会计主体：嘉实优质企业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		- 440,229,167.70	2,187,224,855.27
1.利息收入		4,196,568.84	5,263,827.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,188,358.84	3,117,540.33
债券利息收入		-	2,146,286.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,210.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		- 30,737,599.51	1,888,504,048.39
其中：股票投资收益	7.4.7.12	- 47,719,099.76	1,873,999,768.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	317,390.00
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	16,981,500.25	14,186,889.49
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	- 416,478,818.96	289,387,423.64
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	2,790,681.93	4,069,556.23
减：二、费用		62,839,886.31	74,232,871.37
1、管理人报酬		48,225,091.31	52,127,528.90
2、托管费		8,037,515.23	8,687,921.42
3、销售服务费		-	-
4、交易费用	7.4.7.18	6,136,715.06	12,956,144.77
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	440,564.71	461,276.28
三、利润总额		- 503,069,054.01	2,112,991,983.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润		- 503,069,054.01	2,112,991,983.90

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实优质企业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）	1,954,547,033.25	1,667,153,324.69	3,621,700,357.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	- 503,069,054.01	- 503,069,054.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 272,185,451.28	- 168,110,394.81	- 440,295,846.09
其中：1.基金申购款	1,486,489,279.76	663,694,627.58	2,150,183,907.34
2.基金赎回款	- 1,758,674,731.04	- 831,805,022.39	- 2,590,479,753.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 358,740,409.87	- 358,740,409.87
五、期末所有者权益（基金净值）	1,682,361,581.97	637,233,466.00	2,319,595,047.97
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）	2,843,580,706.64	161,601,461.56	3,005,182,168.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,112,991,983.90	2,112,991,983.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 889,033,673.39	- 577,202,617.20	- 1,466,236,290.59
其中：1.基金申购款	2,628,632,941.05	1,832,541,318.78	4,461,174,259.83
2.基金赎回款	- 3,517,666,614.44	- 2,409,743,935.98	- 5,927,410,550.42
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 30,237,503.57	- 30,237,503.57
五、期末所有者权益（基金净值）	1,954,547,033.25	1,667,153,324.69	3,621,700,357.94

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、基金注册登记人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	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

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	48,225,091.31	52,127,528.90
其中：支付销售机构的客户维护费	5,914,923.48	7,549,529.89

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 15%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× 15%/ 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	8,037,515.23	8,687,921.42

注：支付基金托管人上海浦东发展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
上海浦东发展银行股份有限公司	148,668,713.41	4,117,626.53	229,386,235.31	2,992,040.05

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司保管，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

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
603111	康尼机电	2016年12月26日	重大事项停牌	14.70	-	-	14,227,265	171,859,533.46	209,140,795.50	-
300271	华宇软件	2016年12月19日	重大事项停牌	17.45	-	-	3,501,983	67,416,331.63	61,109,603.35	-

7.4.5.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1银行间市场债券正回购

本期末（2016 年 12 月 31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2交易所市场债券正回购

本期末（2016 年 12 月 31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,178,793,714.56	93.56
	其中：股票	2,178,793,714.56	93.56
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计