

## 嘉实周期优选混合型证券投资基金

## 2016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:中国工商银行股份有限公司  
送出日期:2017年3月29日

## § 1 重要提示

1.1 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。

本基金托管人中国工商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5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》，嘉实周期优选股票型证券投资基金自2015年8月3日起更名为“嘉实周期优选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。

本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，应阅读年度报告全文。

## § 2 基金简介

2.1 基金基本情况	
基金名称	嘉实周期优选混合型证券投资基金
基金简称	嘉实周期优选混合
基金主代码	070027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011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	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,263,276,304.76份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	
本基金在遵循股票型基金，在严格控制投资风险的情况下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。	
本基金将公司投资资源向具有明显行业优势的头部企业配置资金，在对宏观经济及行业景气周期的研判基础上，挑选成长性较好的股票，寻找具备基本面健康、估值优势、竞争优势强、普遍具备高分红投资价值的，在严格控制投资风险的情况下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，适合风险承受能力较高且愿意分享牛市收益的客户，具有较高的股票仓位，较稳健的风险、较高的收益。

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 中国工商银行股份有限公司
地址	北京市建国门北大街1号中国银行大厦9层 嘉实基金管理有限公司
信息披露负责人	联系人: 010-65215598
电子邮箱	service@jrfund.cn custody@cboc.com.cn
客户服务电话	400-800-8800 9588
传真	010-65162266 01066105798

## 2.4 信息披露方式

基金年度报告全文的管理人互联网网址	http://www.jrfund.cn
基金年度报告置备地点	北京市建国门北大街1号中国银行大厦9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
本期初至报告期	-455,405,926.90	1,809,580,478.17	93,019,814.33
本期末	-469,842,071.99	1,228,472,615.70	562,810,897.42
加权平均基金份额本期利润	-0.3343	0.4599	1.1396
本期平均基金份额净值	-17.85%	20.63%	78.07%
本期基金份额净值增长率	-10.45%	26.29%	49.32%
3.1.2 期末未到期的定期基金份额指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	758,826,439.13	1,562,204,923.90	941,914,077.94
期末可供分配基金份额利润	0.6907	0.8968	0.3384
期末基金资产净值	2,499,588,340.33	3,849,816,888.90	4,870,487,647.74
期末基金份额净值	1.979	2.210	1.750
3.1.3 计算期末数	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额净值增长率	109.9%	133.9%	85.24%

注: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，本期利润即为本期实现收益加上本期初的应收股利；(2)所述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金时产生的费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润之和除以当前总份额。

3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格按照证监会《证券投资基金公平交易行为评价指导意见》及公司《公平交易管理制度》，在不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

3.3 主要会计数据和财务指标

注:本基金业绩基准为:沪深300指数收益率×95%+上证国债指数收益率×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指数收益率(t)+5%×上证国债指数收益率(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的比较



注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×95%+上证国债指数收益率×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指数收益率(t)+5%×上证国债指数收益率(t)

Benchmark(t)(1+Return(t))=Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3...。

3.2.3 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

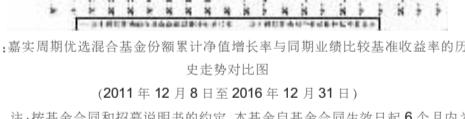


注:本基金合同约定和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同(第十一部分二、投资范围和五、投资限制(二)投资组合限制)的有关约定。

3.2.4 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

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.5 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比



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之日起6个月内为建仓期，建仓期结束后本基金的各项投资比例符合基金合同(第十一部分二、投资范围和五、投资限制(二)投资组合限制)的有关约定。

3.2.6 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

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.7 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.8 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.9 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.10 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.11 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.12 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.13 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.14 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.15 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.16 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.17 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.18 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.19 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.20 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.21 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.22 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.23 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.24 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.25 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.26 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.27 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比

注:本基金每年度报告中披露的过去五年净值增长率为最近五年每年度报告期结束后的净值增长率。

3.2.28 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比