嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金 2017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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年03月28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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年3月23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2017年1月1日起至2017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	嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	嘉实惠泽定增混合
场内简称	嘉实惠泽
基金主代码	160722
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年09月29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	3,271,999,024.63份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016年12月9日

2.2 基金产品说明

投资目标	在封闭期内,本基金主要投资于定向增发的证券。基金管理人在严格控制风险的前提下,通过对定向增发证券投资价值的深入分析,力争基金资产的长期稳定增值。转为上市开放式基金(LOF)后,本基金主要在对公司股票投资价值的长期趋势和深入分析的基础上,挖掘和把握公司基本面改变所带来的阶段性投资机会,力争基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,力争确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据不同经济形势和市场环境的变化及时进行动态调整。在本基金的封闭期,基金管理人将主要采取一级市场参与定向增发策略。本基金转型为上市开放式基金(LOF)后,主要采用积极的行业配置与个股选择的投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。
风险收益特征	本基金是偏股型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金,属于中高预期风险、中高预期收益的基金品种。

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
信息披露负责人	姓名	胡腾炎	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66106799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66106798

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10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	2017年	2016年
本期已实现收益	81,968,408.91	6,628,009.27
本期利润	135,994,769.10	-8,275,066.15
加权平均基金份额本期利润	0.0416	-0.0025
本期加权平均净值利润率	4.09%	-0.25%
本期基金份额净值增长率	4.15%	-0.25%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	29,700,528.90	-8,275,066.15
期末可供分配基金份额利润	0.0091	-0.0025
期末基金资产净值	3,340,822,769.20	3,263,723,969.48
期末基金份额净值	1.0210	0.9975
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	3.89%	-0.25%

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) 上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	净值增长率①	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	0.00%	0.37%	2.33%	0.40%	-2.33%	-0.03%
过去六个月	3.86%	0.33%	5.12%	0.35%	-1.26%	-0.02%
过去一年	4.15%	0.27%	10.62%	0.32%	-6.47%	-0.05%
自基金合同生效起至今	3.89%	0.24%	11.20%	0.33%	-7.31%	-0.09%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%

沪深300指数是上海证券交易所和深圳证券交易所共同推出的沪深两市指数,该指数编制合理、透明,有一定的市场覆盖、抗操纵性强,并且有较高的知名度和市场影响力。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围全面,具有广泛的市场代表性,能够较好的反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

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)=50%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+50%*(中债综合指数(t)/中债综合指数(t-1)-1)

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

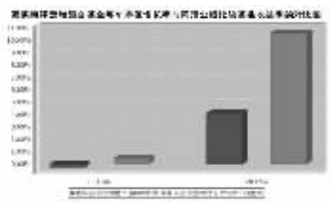
其中t=1,2,3,…。

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:嘉实惠泽定增混合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
(2016年9月29日至2017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(十三(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2016年9月29日,2016年度的相关数据根据当年实际存续期(2016年9月29日至2016年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位: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
2017年	0.1800	58,896,979.38	-	58,896,979.38	-
2016年	-	-	-	-	-
2015年	-	-	-	-	-
合计	0.1800	58,896,979.38	-	58,896,979.38	-

§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2017年12月31日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、141只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、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300ETF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)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、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、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF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、嘉实中证企边中期国债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、嘉实新消费股票基金、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、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新财富灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实稳泰债券、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、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、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、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实新添华定期混合、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实沪港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实稳愉债券、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实稳悦纯债债券、嘉实致博纯债债券、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票。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		
柏重波	本基金、嘉实智能汽车股票基金经理	2016年9月29日	-	8年	曾任兴业全球基金管理有限公司汽车、机械及电力设备研究员。2011年加入嘉实基金,历任高级行业研究员、周期组组长、硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)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;(3)2018年3月9日本基金管理人发布《关于增聘嘉实惠泽定增混合基金经理的公告》,增聘肖觅先生为本基金基金经理,与柏重波先生共同管理本基金;(4)2018年3月20日,本基金管理人发布《关于嘉实惠泽定增混合基金经理变更的公告》,柏重波先生不再担任本基金基金经理,由肖觅先生单独管理本基金。

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、《嘉实惠泽定增灵活配置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19次,均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,经济缓降,流动性难以明显放松。经济整体还是平稳的,企业盈利保持稳健增长。A股市场呈现震荡向上、结构分化的特征, 沪深300指数全年上涨21.78%,中证500指数全年下跌0.20%,呈现较严重的大小盘分化。分行业表现来看分化很大,食品饮料、家电、银行、钢铁等涨幅居前,纺织服装、传媒、计算机等跌幅居前。

基于外部环境以及基金流动性的考虑,本基金主要进行稳健操作,重点选择性价比较高的优质公司,风格相对均衡。同时积极通过打新和现金管理等方式增强收益。我们判断未来的宏观和流动性是趋于稳健的,在这种情况下,价值和成长类资产均有机会,主要通过个股选择获取相对收益。

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1.0210;本报告期基金份额净值增长率为4.15%,业绩比较基准收益率为10.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年,经济大概率小幅下行,继续展现韧性,企业盈利也会保持较好的增速,流动性的偏紧格局大概率还会维持一段时间,同时国内大类资产中权益配置比例仍有提高空间,全球横向看国内权益资产具备吸引力。在蓝筹估值相对合理的大背景下,部分品种估值仍然偏低,还是有相当多的选股机会。但是从全年维度,挑战应该会大于2017年,波动会加大,同行业间的个股的分化也可能会加大,需要研究得更加深入。

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2017年12月11日发布《嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金2017年第一次收益分配公告》, 收益分配基准日为2017年11月30日,每10份基金份额发放现金红利0.1800元,具体参见本报告“4.11 利润分配情况”。

(2)本基金的基金管理人于2018年1月11日发布《嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金2017年第二次收益分配公告》,收益分配基准日为2017年12月31日,每10份基金份额发放现金红利0.0640元,具体参见本报告“4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.9 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, 本基金托管人在对嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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, 嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为58,895,979.38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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金2017年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金2017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,注册会计师许薛竞、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(2018)第22386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:嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	34,790,137.50	98,016,389.70
结算备付金		24,774.78	96,863,573.63
存出保证金		81,821.22	36,385.94
交易性金融资产	7.4.7.2	3,250,208,348.49	336,708,506.34
其中:股票投资		956,848,688.49	336,708,506.34
基金投资		-	-
债券投资		2,293,359,660.00	-
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	-	2,455,500,000.00
应收证券清算款		-	279,407,502.89
应收利息	7.4.7.5	61,266,356.31	2,330,161.75
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,346,371,438.30	3,268,862,519.26
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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		-	-
应付管理人报酬		4,318,558.76	4,162,616.52
应付托管费		719,759.82	693,769.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	120,360.52	177,163.82
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	390,000.00	105,000.00
负债合计		5,548,679.10	5,138,549.77
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,271,999,024.63	3,271,999,024.63
未分配利润	7.4.7.10	68,823,734.57	-8,275,066.15
所有者权益合计		3,340,822,759.20	3,263,723,969.48
负债和所有者权益总计		3,346,371,438.30	3,268,862,519.26

注: 报告截止日2017年12月31日,基金份额净值1.0210元,基金份额总额3,271,999,024.63份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2017年1月1日 至 2017年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年09月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
一、收入		198,612,347.54	6,721,816.98
1.利息收入		70,515,615.38	21,440,644.96
其中:存款利息收入	7.4.7.11	2,017,775.30	1,243,610.98
债券利息收入		48,960,977.14	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,546,862.94	20,197,033.97
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		74,070,305.52	115,651.95
其中:股票投资收益	7.4.7.12	62,261,054.91	115,651.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	400,143.02	-
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	11,409,107.59	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	54,026,369.19	-14,903,154.52
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	6,485	68,674.57
减:二、费用		62,617,578.44	14,996,872.10
1. 管理人报酬		49,898,130.65	12,481,750.06
2. 托管费		8,316,355.23	2,080,291.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,212,400.90	293,510.40
5. 利息支出		2,543,045.11	-
其中:卖出回购金融资产支出		2,543,045.11	-
6. 其他费用	7.4.7.19	647,669.95	141,320.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		135,994,769.10	-8,275,066.15
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		135,994,769.10	-8,275,066.15

注:本基金合同生效日为2016年9月29日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2016年9月29日至2016年12月31日。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实惠泽定增灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2017年1月1日 至 2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日 至 2017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)	3,271,999,024.63	-8,275,066.15	3,263,723,969.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	135,994,769.10	135,994,769.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-58,895,979.38	-58,895,979.38
五、期末所有者权益(基金净值)	3,271,999,024.63	68,823,734.57	3,340,822,759.20

项目	上年度可比期间 2016年09月29日(基金合同生效日)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)	3,271,999,024.63	-	3,271,999,024.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-8,275,066.15	-8,275,066.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,271,999,024.63	-8,275,066.15	3,263,723,969.48

注:本基金合同生效日为2016年9月29日,上年度可比期间是指自基金合同生效日2016年9月29日至2016年12月31日。

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:

经理	王红	张公允
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不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布(证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行))的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》,对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票, 基金自2017年12月26日起改为按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。该估值技术变更使本基金本期末 (2017年12月31日)的基金资产净值及本期(2017年1月1日至2017年12月31日)的净利润减少29,440,675.38元。

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、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年9月29日(基金合同生效日)至2016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 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年09月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	49,898,130.65	12,481,750.06
其中:支付销售机构的客户维护费	5,466,720.69	1,146,258.32

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 2017年1月1日 至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年09月29日(基金合同生效日)至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,316,355.13	2,080,291.64

注: 支付基金托管人中国工商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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年9月29日(基金合同生效日)至2016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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年9月29日(基金合同生效日)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。

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(2017年12月31日)及上年度末(2016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 2017年1月1日 至 2017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
中国工商银行股份有限公司	34,790,137.50	1,491,896.20	98,016,389.70	1,030,101.51

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年9月29日(基金合同生效日)至2016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(2017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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
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
000666	神州信息	2016年12月28日	2018年12月11日	非公开发行有限条件流通受限	25.57	10.93	1,759,875	45,000,003.75	19,235,433.75	-
002171	楚江新材	2017年1月19日	2018年1月22日	非公开发行有限条件流通受限	15.06	7.10	1,920,946	14,456,111.12	13,638,709.50	-
002171	楚江新材	2017年1月19日	2019年1月21日	非公开发行有限条件流通受限	15.06	6.71	1,920,946	14,456,111.13	12,889,540.95	-
002344	海宁皮城	2016年12月22日	2018年01月23日	非公开发行有限条件流通受限	10.70	7.93	4,672,897	49,999,997.90	37,056,073.21	-
002344	海宁皮城	2016年12月22日	2018年12月26日	非公开发行有限条件流通受限	10.70	7.59	4,672,897	49,999,997.90	35,467,298.23	-
002705	新宝股份	2017年3月30日	2018年4月2日	非公开发行有限条件流通受限	17.86	11.94	1,035,842	14,230,876.85	12,367,953.48	-
002705	新宝股份	2017年3月30日	2019年4月1日	非公开发行有限条件流通受限	17.86	11.39	1,035,843	14,230,890.59	11,798,251.77	-
002923	润都股份	2017年12月28日	2018年1月5日	未上市	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	网下中购
300195	长荣股份	2017年4月20日	2018年4月23日	非公开发行有限条件流通受限	15.51	13.68	4,835,590	75,000,000.90	66,150,871.20	-
300195	长荣股份	2017年4月20日	2019年4月22日	非公开发行有限条件流通受限