嘉实成长收益证券投资基金 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。

本基金已根据香港《证券及期货条例》第104条在香港获得证券及期货事务监察委员会认可及可供在香港向公众销售。证券及期货事务监察委员会认可不代表对本基金的推荐或认许,亦不代表其对本基金的商业利弊或其表现作出保证。此并不意指本基金适合所有投资者,亦并非认许本基金适合任何特定投资者或投资者类别。

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	嘉实成长收益证券投资基金
基金简称	嘉实成长收益混合
基金主代码	070001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月5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	3,436,548,311.71份
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基金简称	嘉实成长收益混合A 嘉实成长收益混合H
下属分级基金的交易代码	070001 960024
报告期末下属分级基金的份额总额	3,435,699,776.50份 848,535.21份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金定位于成长收益复合型基金,在获取稳定的现金收益的基础上,积极谋求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及对债券类资产的稳健投资来实现“稳定收益”的目标;同时通过实施“行业优选、积极轮换”的策略,实现“资本增值”目标。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金,长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的风格值不超过0.75。在此前提下,本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例,努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证A股指数涨幅的65%,股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的55%。

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@jsfund.cn	fcsd@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	(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	2017年		2016年		2015年	
	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H	嘉实成长收益混合A	嘉实成长收益混合H
本期已实现收益	319,877,449.25	61,506.90	-194,911,693.22	-10,165.21	2,256,621,400.70	-
本期利润	728,391,204.65	141,281.51	-406,270,767.54	-37,093.15	1,853,503,096.87	-
加权平均基金份额本期利润	0.1823	0.1535	-0.0929	-0.0584	0.4612	-
本期加权平均净值利润率	14.86%	14.83%	-8.00%	-5.73%	41.14%	-
本期基金份额净值增长率	16.36%	16.33%	-9.06%	-2.09%	66.86%	-
3.1.2 期末数据和指标	2017年末		2016年末		2015年末	
期末可供分配利润	2,610,968,456.55	49,022.37	2,572,579,728.36	-19,795.59	2,669,229,049.32	-
期末可供分配基金份额利润	0.7600	0.0578	0.5699	-0.0209	0.6977	-
期末基金资产净值	4,645,639,966.39	966,477.11	5,245,966,042.01	927,749.52	4,934,955,914.62	-
期末基金份额净值	1.3522	1.1390	1.1621	0.9791	1.2899	-
3.1.3 累计期末指标	2017年末		2016年末		2015年末	
基金份额累计净值增长率	1,080.72%	13.90%	914.72%	-2.09%	1,015.80%	-

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。(4)本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额类别,仅在中国香港地区销售。

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

嘉实成长收益混合A

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	7.56%	0.98%	-1.23%	0.57%	8.79%	0.41%
过去六个月	9.03%	0.80%	3.59%	0.55%	5.44%	0.25%
过去一年	16.36%	0.72%	6.58%	0.55%	9.78%	0.17%
过去三年	76.56%	1.64%	2.19%	1.67%	74.37%	-0.03%
过去五年	168.87%	1.40%	45.77%	1.48%	123.10%	-0.08%
自基金合同生效起至今	1,080.72%	1.25%	116.42%	1.61%	964.30%	-0.36%

嘉实成长收益混合H

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	7.57%	0.98%	-1.23%	0.57%	8.80%	0.41%
过去六个月	9.05%	0.80%	3.59%	0.55%	5.46%	0.25%
过去一年	16.33%	0.72%	6.58%	0.55%	9.75%	0.17%
自基金合同生效起至今	13.90%	0.72%	11.05%	0.60%	2.85%	0.12%

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1:嘉实成长收益混合A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(2002年11月5日至2017年12月31日)

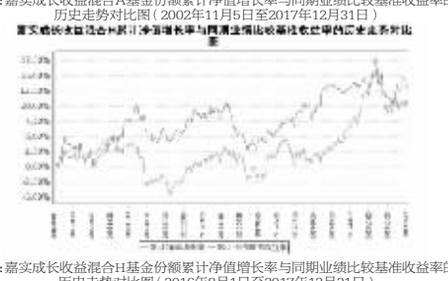
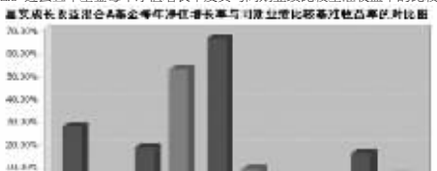


图2:嘉实成长收益混合H基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2016年8月1日至2017年12月31日)

注:1.按基金合同规定,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第十八条(二)投资范围和(六)投资组合比例限制)的约定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6) 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。

2.2017年7月18日,本基金管理人发布《关于嘉实成长收益混合基金经理的变更公告》,谢泽林先生不再担任本基金基金经理职务。

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



注:嘉实成长收益混合H类基金份额2016年度的相关数据根据当年实际存续期(2016年8月1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

嘉实成长收益混合A

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	-	-	-	-	-
2016年	0.1000	22,129,719.85	17,354,949.84	39,484,669.69	-
2015年	0.0960	21,810,660.86	21,994,168.19	43,804,829.05	-
合计	0.1960	43,940,380.71	39,349,118.03	83,289,498.74	

注:本基金自2016年1月7日起增加H类基金份额类别,自2016年1月7日至2017年12月31日,嘉实成长收益混合H无利润分配。

§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、嘉实稳年纯债债券、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		
邵秋涛	本基金、嘉实领先成长混合、嘉实成长增强混合基金经理、股票投资业务助理CIO兼股票投资部总监	2013年6月7日	-	19年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券,从事行业研究工作,先后担任研究员、高级研究员;2006年12月加盟嘉实基金管理有限公司,历任公司高级研究员、投资经理,现任助理CIO兼股票投资部总监。金融硕士,具有基金从业资格,澳大利亚籍。
谢泽林	本基金、嘉实策略混合、嘉实新机遇混合发起式、嘉实企业变革股票基金经理	2015年12月31日	2017年7月18日	8年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部,曾任行业研究员一职。现任职于股票投资部。硕士研究生,具有基金从业资格。

注:(1)任职日期、离职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、《嘉实成长收益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

2017年中国经济平稳运行,GDP增长达到6.9%,工业增加值增速6.4%;通胀处于较低水平,全年CPI 1.6%,但PPI达到6.3%。

中国A股市场保持稳定发展,但结构分化严重。上证综指小幅上涨6%,但创业板指数跌10%,上涨股票量较少,且集中在大盘、蓝筹、周期等领域。究其原因,一是经济降速换挡期间,大盘蓝筹业绩稳定,风险较低,更受青睐;二是A股与国际资本市场接轨,海外资金对大盘蓝筹的偏爱,直接影响了A股的市场结构;三是部分中小盘公司的历史积累风险猛烈释放,加速了风格轮换。

本组合坚守受益于中国经济转型创新的长期主线,在消费、科技、服务等领域深挖风险较低的优秀成长企业,获得了长期可持续的稳健收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实成长收益混合A的基金份额净值为1.3522,本报告期基金份额净值增长率为16.36%;截至本报告期末嘉实成长收益混合H的基金份额净值为1.1390,本报告期基金份额净值增长率为16.33%;同期业绩基准收益率为6.58%。

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2018年,A股市场面临的挑战更大。首先是全球经济和资本市场的风险在积累。经历了长达8年的经济复苏和牛市,全球经济和资本市场出现较大幅度的技术性回调,其概率越来越大。由于中国经济的出口比重较高,资本市场也已和全球接轨,不可避免的受到冲击。

其次是中国经济面临新的挑战。2017年中国经济表现较好的原因有房地产市场超预期、出口超预期、供给侧改革带来的国企效益好转等,但是在2018年这些利好因素的边际效益在递减。供给侧改革在带来上游原材料行业利润大幅飙涨的同时,也推动了原材料价格的大幅上涨,推动了全社会的成本上涨,需要在2018年及以后逐步消化。在管理层坚决去杠杆、整顿金融秩序的大背景下,市场流动性也面临考验。

最后是A股市场过去两年的风格轮动也达到了一个相对极致的水平。市场对于大盘、蓝筹、周期的追捧到了一个很热烈的地步,对于中小盘、成长的抛弃也到了钟摆的另一端。市场的波动加大在所难免。

但就长期而言,这些都只是噪音。虽然市场一直在狂热和绝望中摆动,但是我们坚信中国经济长期可持续高质量发展的大势不可阻挡;要实现高质量发展,中国经济不可能继续依赖房地产煤炭钢铁,转型创新势在必然;转型创新必然会导致一些重量级的新兴产业崛起;其中会诞生一大批十年十倍的优秀成长企业。这就是我们的投资目标。

参考已经成功跨越中等收入陷阱的其他经济体历史,以及在实地调研中已经看到的现实成功案例,我们都坚信这一投资目标是可以实现的。

市场系统性下跌导致优秀公司股价的下跌,只会给我们提供更好的买入机会,提高未来的投资收益率。

我们将继续以新消费、新服务、新科技、新改革等结构性机会为主线,深挖成长空间巨大、长期可持续快速增长、基本面扎实、估值合理、治理优秀的上市公司,长期持有,努力为投资者继续创造长期稳健的投资回报,以回馈持有人对我们的长期信任。

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 管理人对报告期内本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)本基金的基金管理人于2018年1月11日发布《嘉实成长收益证券投资基金2017年年度收益分配公告》,收益分配基准日为2017年12月31日,本期A类份额每10份基金份额发放现金红利0.1000元,本期H类份额每10份基金份额发放现金红利0.0290元,具体参见本报告“7.4.11 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,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在对嘉实成长收益证券投资基金(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

嘉实成长收益证券投资基金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22454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:嘉实成长收益证券投资基金

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	314,244,503.21	784,012,958.06
结算备付金		2,252,770.33	3,583,717.89
存出保证金		983,589.91	1,356,581.02
交易性金融资产	7.4.7.2	4,285,614,224.68	4,441,664,810.86
其中:股票投资		3,313,932,970.78	3,251,730,810.86
基金投资		-	-
债券投资		971,681,253.90	1,189,934,000.00
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	-	-
应收证券清算款		33,503,887.28	5,532,689.32
应收利息	7.4.7.5	24,796,461.20	22,667,649.03
应收股利		-	-
应收申购款		3,066,933.67	1,125,501.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		4,664,462,370.28	5,259,943,908.09
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		8,767,365.16	2,964,372.39
应付管理人报酬		5,847,687.26	6,754,592.75
应付托管费		974,614.51	1,125,765.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,840,413.55	1,788,066.86
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	425,846.30	417,319.12
负债合计		17,855,926.78	13,050,116.56
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,035,520,045.05	2,674,333,858.76
未分配利润	7.4.7.10	2,611,086,398.45	2,572,559,932.77
所有者权益合计		4,646,606,443.50	5,246,893,791.53
负债和所有者权益总计		4,664,462,370.28	5,259,943,908.09

注:报告截止日2017年12月31日,嘉实成长收益混合A份额净值1.3522元,基金份额总额3,435,699,776.50份;嘉实成长收益混合H份额净值1.1390元,基金份额总额848,535.21份。基金份额合计为3,436,548,311.71份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金

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1月1日 至 2016年12月31日
一、收入		830,843,515.52	-301,301,666.44
1.利息收入		41,186,663.58	35,662,877.04
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,064,928.69	3,517,485.48
债券利息收入		37,786,391.36	31,591,376.45
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		335,343.53	554,015.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		379,251,855.33	-128,144,817.08
其中:股票投资收益	7.4.7.12	347,275,078.13	-139,636,819.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,087,044.55	-5,762,074.78
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	36,063,821.75	17,254,077.14
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	408,593,530.01	-211,386,002.26
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	1,811,466.60	2,566,275.86
减:二、费用		102,311,029.36	105,006,194.25
1. 管理人报酬		73,547,047.73	76,183,870.41
2. 托管费		12,257,841.21	12,697,311.72
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	16,022,827.30	15,643,755.36
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	483,313.12	481,256.76
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		728,532,486.16	-406,307,860.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净号损以“-”号填列)		728,532,486.16	-406,307,860.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金

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)	2,674,333,858.76	2,572,559,932.77	5,246,893,791.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	728,532,486.16	728,532,486.16
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)	-638,813,813.71	-690,006,020.48	-1,328,819,834.19
其中:1.基金申购款	449,549,291.55	482,006,263.41	931,555,554.96
2.基金赎回款	-1,088,363,105.26	-1,172,012,283.89	-2,260,375,389.15
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)	2,035,520,045.05	2,611,086,398.45	4,646,606,443.50
项目	上年度可比期间 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)	2,265,726,865.30	2,669,229,049.32	4,934,955,914.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-406,307,860.69	-406,307,860.69
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)	408,606,993.46	349,123,413.83	757,730,407.29
其中:1.基金申购款	1,643,822,633.48	1,552,158,884.04	3,195,981,517.52
2.基金赎回款	-1,235,215,640.02	-1,203,035,470.21	-2,438,251,110.23
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)	-	-39,484,669.69	-39,484,669.69
五、期末所有者权益(基金净值)	2,674,333,858.76	2,572,559,932.77	5,246,893,791.53

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:

经需	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相一致。

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(2017年1月1日至2017年12月31日)及上年度可比期间(2016年1月1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1月1日 至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	73,547,047.73	76,183,870.41
其中:支付销售机构的客户维护费	5,484,668.22	4,911,479.16

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1月1日 至 2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,257,841.21	12,697,311.72

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

单位:人民币元

本期 2017年1月1日 至 2017年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	344,469,464.05	-	-	-	-	-

注:上年度可比期间(2016年1月1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。

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