嘉实优化红利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。

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》，嘉实优化红利股票型证券投资基金自2015年8月3日起更名为嘉实优化红利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	嘉实优化红利混合型证券投资基金
基金简称	嘉实优化红利混合
基金主代码	070032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26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	1,836,728,970.67份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，通过严格执行投资风险管理图化和明晰基金的风格特征，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。同时，以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、较高收益的品种。

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	fcid@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

2.5其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街8号华润大厦8层

§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
本期已实现收益	73,972,424.48	-14,565,901.08	23,705,057.58
本期利润	357,826,362.69	-50,427,483.32	44,309,486.04
加权平均基金份额本期利润	0.4594	-0.0720	0.3257
本期加权平均净值利润率	35.31%	-7.26%	29.09%
本期基金份额净值增长率	55.03%	-13.58%	81.03%
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	-57,456,025.23	-69,857,451.96	-42,304,478.34
期末可供分配基金份额利润	-0.0313	-0.1328	-0.1067
期末基金资产净值	2,772,554,177.99	512,218,144.71	446,889,972.71
期末基金份额净值	1.510	0.974	1.127
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	195.67%	90.72%	120.67%

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	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	13.88%	1.37%	1.61%	0.59%	12.27%	0.78%
过去六个月	23.47%	1.12%	4.71%	0.54%	18.76%	0.58%
过去一年	55.03%	1.03%	16.69%	0.56%	38.34%	0.47%
过去三年	142.55%	1.60%	37.00%	1.68%	105.55%	-0.08%
过去五年	190.73%	1.43%	84.86%	1.52%	105.87%	-0.09%
自基金合同生效起至今	195.67%	1.40%	95.13%	1.49%	100.54%	-0.09%

注：本基金业绩比较基准为：中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%。

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本，指数加权方式同沪深300指数，以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。

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：

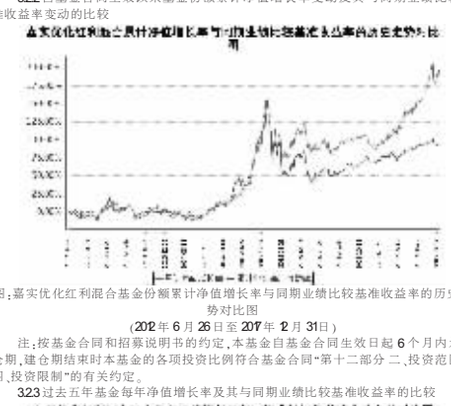
Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中证红利指数收益率(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变动的比较

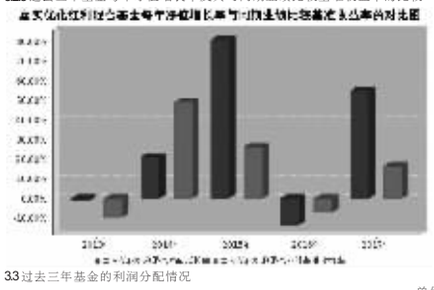


图：嘉实优化红利混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月26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“第十二部分 二、投资范围和四、投资限制”的有关约定。

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：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	-	-	-	-	-
2016年	-	-	-	-	-
2015年	8.5340	47,786,942.78	18,869,422.88	66,656,365.66	-
合计	8.5340	47,786,942.78	18,869,422.88	66,656,365.66	-

§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、嘉实新金宝货币、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		
季文华	本基金、嘉实增长混合、嘉实新兴产业股票基金经理	2016年10月10日	-	6年	曾任兴业证券证券研究分析师。2012年加入嘉实基金管理有限公司，任研究部研究员一职。

注：(1)任职日期、离任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、《嘉实优化红利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9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

我们对中国市场的中长期表现持更加积极的态度，未来出现牛市行情的基础正在巩固。在经济保持平稳的情况下，一方面场内资金活跃度增加，海外、机构资金不断入市的趋势将持续，流动性在金融监管平稳推进的情况下不会对市场造成明显扰制；另一方面，目前市场整体、尤其是大市值蓝筹板块的估值水平并不高，市场整体盈利水平的平稳增长将逐步推升指数水平。市场环境、供需以及海外投资者“北上”等因素对市场结构性的影响在2017年已经有很大程度的体现。A股纳入MSCI指数将对资本市场产生深远的影响，真正的价值投资会迎来春天。高估值中小盘成长股整体面临估值调整和分化的较大压力，不宜轻言见底。

从投资策略来看，我们看好受益于供给侧改革的周期股，这些周期性板块在经历了前几年经济下行，产能退出，行业集中度提升，盈利能力改善，因此周期性板块具有良好的投资价值，如煤炭、钢铁、有色等。此外，我们也在积极关注成长投资机会，传统行业是供给侧改革的上半场，下半场将大力“补短板”，发展新动能、实现产业升级，经济和政策环境也将为成长投资提供有力支撑。成长板块经历三年的估值消化，目前已涌现出大量与盈利增速匹配度较好的个股。

回顾本组合的运作，我们的策略积极寻找结构性机会。至上而下两条思路：一是放眼全球范围内，中国有竞争力的制造业，比如家电制造、电子制造等。二是看好国内巨大的消费市场，消费升级是一个大的趋势。因此在资产配置上，我们重点布局了大消费和电子板块。大消费领域重点配置了食品饮料、家电家具、医疗保健和保险板块，电子领域重点配置了苹果产业链和安防。从2017年的结果来看，这些板块均取得了良好的超额收益。

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1.510；本报告期基金份额净值增长率为55.03%，业绩比较基准收益率为16.69%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观层面来看，2017年经济超出年初的预期，一方面房地产投资增速接近两位数；另一方面，全球经济复苏强劲，今年出口数据也非常靓丽。近期PMI显示全球主要经济体处于良性增长态势。中国经济平稳增长、PPI虽然较高，但是CPI水平较低。经济增长动力未来会根本改变、新动能不断积累。流动性方面有所改善，信贷数据有所好转。经济整体的系统性风险不大，远期需要观察PPI压力是否会传导到通胀上，以及全球负利率的退出风险。

市场方面，全球负利率导致全球资产价格上涨和风险偏好提高。从经济动能积蓄、估值与业绩增长匹配度、资金配置流向等角度出发，我们对中国市场的中长期表现持更加积极的态度，未来出现牛市行情的基础正在巩固。在经济保持平稳的情况下，一方面场内资金活跃度增加，海外、机构资金不断入市的趋势将持续，流动性在金融监管平稳推进的情况下不会对市场造成明显扰制；另一方面，目前市场整体、尤其是大市值蓝筹板块的估值水平并不高，市场整体盈利水平的平稳增长将逐步推升指数水平。市场环境、供需以及海外投资者“北上”等因素对市场结构性的影响在2017年已经有很大程度的体现。A股纳入MSCI指数将对资本市场产生深远的影响，真正的价值投资会迎来春天。高估值中小盘成长股整体面临估值调整和分化的较大压力，不宜轻言见底。

从行业配置的角度来看，我们对中国竞争力的制造业和消费升级的消费板块保持着较大的配置比例。此外，我们也看好大金融领域估值重估的机会。首先，大金融领域，尤其是银行受益于中国经济的良好表现，7年GDP保持6.9%的增速超出了市场的预期，市场对于经济的负面预期被化解，因此原本低估的银行股应该有重估的机会。此外，海外资本未来对中国的配置比例从低配到标配，中国的银行股盈利能力高，资产质量提升，低估的银行股也会受到外资的追捧。

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3.1.2“期末可供分配利润”为-57,456,025.23元，以及本基金基金合同(十六(三)基金收益分配原则)的约定，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”)在嘉实优化红利混合型证券投资基金(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

嘉实优化红利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22383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：嘉实优化红利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	171,542,199.53	82,589,523.35
结算备付金		12,529,006.24	1,900,643.64
存出保证金		1,340,256.30	334,210.00
交易性金融资产	7.4.7.2	2,555,933,599.53	329,361,975.13
其中：股票投资		2,555,933,599.53	329,361,975.13
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	-	102,600,000.00
应收证券清算款		42,055,056.74	-
应收利息	7.4.7.5	39,971.95	70,551.07
应收股利		-	-
应收申购款		12,272,635.19	183,540.95
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,795,712,725.48	517,040,444.14
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		67,671.90	2,042,287.86
应付赎回款		16,216,688.17	524,511.89
应付管理人报酬		3,389,551.65	665,801.10
应付托管费		564,925.26	110,966.84
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,492,192.03	1,096,937.23
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	427,518.48	381,794.51
负债合计		23,158,547.49	4,822,299.43
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,836,728,970.67	525,866,865.74
未分配利润	7.4.7.10	935,825,207.32	-13,648,721.03
所有者权益合计		2,772,554,177.99	512,218,144.71
负债和所有者权益总计		2,795,712,725.48	517,040,444.14

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.510元，基金份额总额1,836,728,970.67份。

7.2利润表

会计主体：嘉实优化红利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1月1日至2016年12月31日
一、收入		385,373,312.65	-30,955,729.91
1.利息收入		1,313,292.54	1,757,404.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	823,203.91	1,566,598.16
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		490,088.63	190,806.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		98,222,699.91	2,365,042.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	90,755,617.03	-1,107,404.34
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	7,467,082.88	3,472,446.45
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	283,853,938.21	-35,861,582.24
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	1,983,381.99	783,405.91
减：二、费用		27,546,949.96	19,471,753.41
1. 管理人报酬		14,848,641.97	10,411,491.52
2. 托管费		2,474,773.64	1,735,248.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	9,791,640.34	6,897,074.86
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	431,894.01	427,938.42
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		357,826,362.69	-50,427,483.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		357,826,362.69	-50,427,483.32

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实优化红利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)	525,866,865.74	-13,648,721.03	512,218,144.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	357,826,362.69	357,826,362.69
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)	1,310,862,104.93	591,647,565.66	1,902,509,670.59
其中：1.基金申购款	2,653,142,843.09	1,023,578,720.29	3,676,721,563.38
2.基金赎回款	-1,342,280,738.16	-431,931,154.63	-1,774,211,892.79
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)	1,836,728,970.67	935,825,207.32	2,772,554,177.99

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)	396,593,602.21	50,296,370.50	446,889,972.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-50,427,483.32	-50,427,483.32
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)	129,273,263.53	-13,517,608.21	115,755,655.32
其中：1.基金申购款	774,048,735.61	-16,524,592.66	757,524,142.95
2.基金赎回款	-644,775,472.08	3,006,984.45	-641,768,487.63
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)	525,866,865.74	-13,648,721.03	512,218,144.71

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。该估值技术变更对本基金的基金资产净值以及当期损益无重大影响。

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	14,848,641.97	10,411,491.52
其中：支付销售机构的客户维护费	2,920,165.77	998,280.39

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 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	2,474,773.64	1,735,248.61

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(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		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国银行股份有限公司	171,542,199.53	722,292.57	82,589,523.35	1,507,084.94

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(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
002048	宁波华翔	2017年12月27日	2018年12月28日	非公开发行流通受限	21.25	22.21	682,353.00	14,500,001.25	15,155,060.13	-
603161	科华控股	2017年12月28日	2018年1月5日	未上市	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	网下申购
300664	鹏鹞环保	2017年12月28日	2018年1月5日	未上市	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	网下申购
603080	新疆火炬	2017年12月25日	2018年1月3日	未上市	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	网下申购
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	网下申购
002048	宁波华翔	2017年12月27日	2019年12月30日	非公开发行流通受限	21.25	20.89	682,353.00	14,500,001.25	14,254,354.17	-

注：基金可作为