

# 嘉实稳健开放式证券投资基金 2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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

送出日期：2017 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 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 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。

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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	51
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	51
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	51

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	51
8.12 投资组合报告附注 .....	51
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>52</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	52
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
基金简称	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 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	3,360,747,642.92 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置，通过基本面分析挖掘行业优势企业，获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率
风险收益特征	中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为单位基金资产净值相对于基金业绩基准的 $\beta$ 值保持在 1.0 左右。

### 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) 65182266	(010) 66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	100005	100818
法定代表人	邓红国	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层
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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-189,355,610.01	3,849,260,636.48	319,344,583.32
本期利润	-482,347,123.96	2,744,180,374.19	824,933,528.57
加权平均基金份额本期利润	-0.1372	0.5212	0.0824
本期加权平均净值利润率	-12.85%	45.37%	10.52%
本期基金份额净值增长率	-11.17%	30.71%	12.34%
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	1,927,711,689.30	2,580,272,282.98	1,530,874,901.31
期末可供分配基金份额利润	0.5736	0.7194	0.1770
期末基金资产净值	3,588,617,603.17	4,352,728,570.95	8,107,262,709.50
期末基金份额净值	1.068	1.214	0.937
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	306.73%	357.87%	250.29%

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	-1.02%	0.56%	0.39%	0.46%	-1.41%	0.10%
过去六个月	-0.28%	0.64%	2.72%	0.47%	-3.00%	0.17%
过去一年	-11.17%	1.24%	-5.86%	0.83%	-5.31%	0.41%
过去三年	30.45%	1.55%	55.78%	1.52%	-25.33%	0.03%
过去五年	49.37%	1.35%	60.08%	1.44%	-10.71%	-0.09%
自基金合同生效起至今	306.73%	1.28%	224.51%	1.70%	82.22%	-0.42%

注：本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 200(大盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

巨潮大盘指数的总市值相对于 A 股市场覆盖率约为 52%，具有良好的市场代表性，用以反映 A 股市场大盘市值股票的运行情况，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

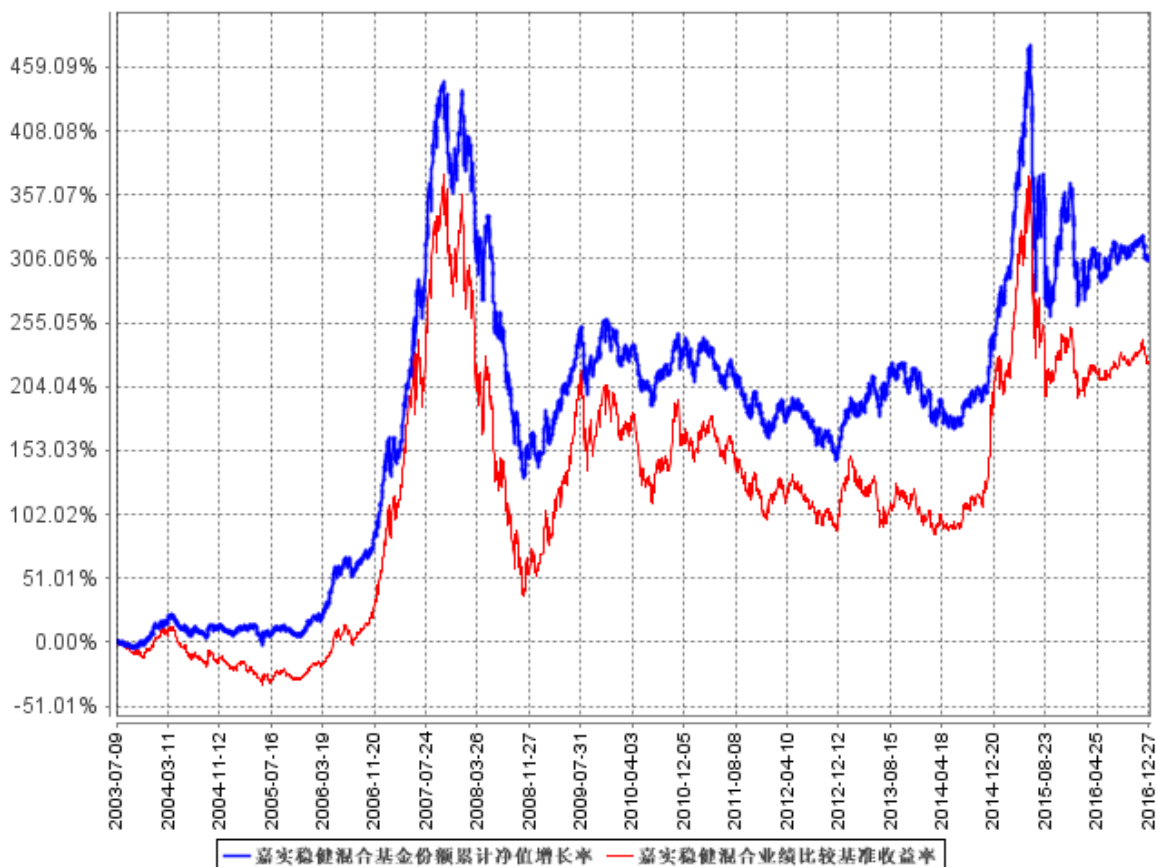
$$\text{Return}(t) = 60\% * (\text{巨潮 200(大盘)指数}(t) / \text{巨潮 200(大盘)指数}(t-1) - 1) + 40\% * (\text{中债总指数}(t) / \text{中债总指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) * \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

嘉实稳健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



图：嘉实稳健混合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

(2003年7月9日至2016年12月31日)

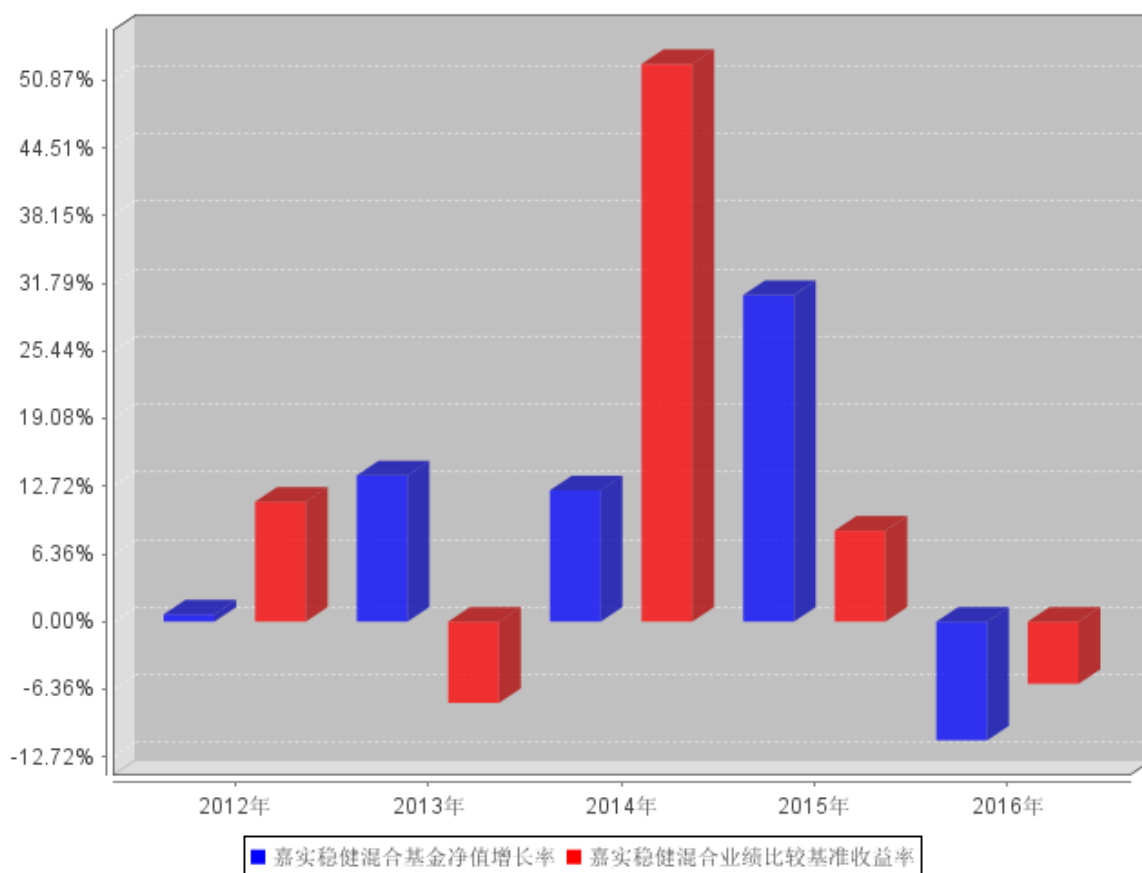
注 1：按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第三部分（四（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券的 10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（5）本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

注 2：2016 年 5 月 12 日，本基金管理人发布《关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告》，郭东谋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

嘉实稳健混合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对比图



### 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	0.1000	15,004,246.96	20,808,864.79	35,813,111.75	
2015	0.0890	31,166,691.29	43,827,150.88	74,993,842.17	
2014	0.0750	33,165,481.24	47,659,981.27	80,825,462.51	
合计	0.2640	79,336,419.49	112,295,996.94	191,632,416.43	

## § 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		
翟琳琳	本基金、嘉实价值优势混合基金经理	2015年2月17日	-	11年	2005年7月加入嘉实基金，先后担任过金属与非金属行业分析师、基金经理助理职务。具有基金从业资格。
张淼	本基金、嘉实先进制造股票基金经理	2015年2月17日	-	11年	曾就职于东方基金管理有限公司研究部。2007年9月加入嘉实基金管理有限公司，先后担任研究员、研究部副总监和基金经理助理职务。硕士研究生，具有基金从业资格。
郭东谋	本基金、嘉实周期优选混合、嘉实元和、嘉实逆向策略股票、嘉实价值增强混合基金经理	2014年11月26日	2016年5月12日	12年	曾任招商证券研究员，2007年9月加入嘉实基金管理有限公司任研究部研究员、基金经理助理，现任主题策略组基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

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。（3）本基金基金经理翟琳琳女士因休产假超过30日，在其休假期间，本基金暂由我公司基金经理焦云女士代为履行基金经理职责。该事项已于2016年5月5日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。（4）本基金基金经理翟琳琳女士已结束休假，自2016年11月23日起恢复履行基金经理职务。该事项已于2016年11月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。（5）本基金基金经理张淼女士因休产假超过30日，在其休假期间，本基金暂由我公司基金经理李帅先生代为履行基金经理职责。该事项已于2017年3月24日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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，每季度和每年度完成公平交易专项稽核。

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，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

#### 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

本报告期内整个市场大幅下跌，一季度市场经历了熔断的惨烈下跌，二季度跌幅有所收窄，三四季度市场小幅回暖；一季度，受益于通胀预期的农业、黄金和食品饮料等板块表现较好；二季度，经济触底，房地产和汽车销售数据靓丽，汽车、家电和建筑板块整体表现较好；三四季度，由于保险等增量资金入市，高 ROE、高分红和低估值的板块表现较好。

回顾本组合的操作，在大类资产配置上，权益比例在年初小幅下降到 65%左右，其余时间基本在 70%窄幅波动；在行业配置上，增加了受益于基建投资和一带一路的建筑和受益于房地产销量超预期的建材、钢铁和家电的配置，保持了受益于通胀的食品饮料、医药行业的核心配置，减持了基本面低于预期且估值较高的传媒和计算机等行业。

##### 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 1.068 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.17%，业绩比较基准收益率为-5.86%。

#### 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 年我们判断国内经济受基建和后房地产投资的支撑依旧保持弱企稳的状态，窄幅波动的概率较大，通胀预计前高后低，因此货币政策中性略偏紧，但是地产新政带来的流动性挤出效应，将会为其他各类资产整体带来机会，从排序上来看，我们认为，2017 年股票优于商品，商品优于债券。

因此展望 2017 年我们认为市场基本维持平稳，更多的收益可能来自于个股的精选，我们看好的方向如下：一是，受益于供给侧改革和环保约束的造纸、水泥行业；二是，受益于输入性通胀的农业和化工及油气产业链；三是，受益于一带一路和基建的建筑行业；四是，估值已经调整到位且景气度仍然向上的新兴行业，如军工、汽车电子等；五是，受益于医药改革且估值合理的医药龙头企业。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 风险管理：重新识别评估主要业务风险，明确风险源头，建立健全风控指标动态监控机制，采用先进的风险管理方法和手段加强监控，在风险可控、可测、可承受前提下开展各项业务。

(2) 重点支持创新业务和新产品拓展：公司继续加大创新力度，在创新产品方面，迅速研发了多个产品，特别是绝对收益、债券方面的创新产品以及子公司专项资产管理计划；在创新业务方面，主要是互联网金融、子公司新业务等。特别安排关键骨干全程参与，在投资品种、业务规则、法律架构等方面法律、合规难点，提供了较好的解决方案。

(3) 法律事务：除了创新业务的法律支持外，还完成了大量的日常法律事务工作，包括合同、代销协议审查（公募、年金、专户、RQFII 以及一般行政管理）。主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患。报告期内未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(4) 合规管理：主要从事事前合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。报告期内公司各项业务审慎开展、运作管理合法合规。

(5) 内部审计：按季度对销售、投资、后台和其它业务开展内审，手机、电话录音、录像、MSN、邮件定期检查，公平交易及反洗钱定期稽核以及重点业务专项稽核，每日差错管理，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。继续开展公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证，全面完成公司及基金的外审等。

此外，我们还积极配合基金部、北京证监局、社保基金理事会的检查、调查、统计工作，按时完成季度、年度监察稽核报告和各项专题报告。

#### 4.7 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验。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。

#### 4.8 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《嘉实稳健开放式证券投资基金 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 0.10 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 -482,347,123.96 以及本基金基金合同（十一（二）收益分配原则）“5、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。

#### 4.9 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”）在嘉实稳健开放式证券投资基金（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

安永华明（2017）审字第 60468756\_A04 号

嘉实稳健开放式证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实稳健开放式证券投资基金财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

#### 一、 基金管理人 对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人嘉实基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

#### 二、 注册会 计师的 责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

#### 三、 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实稳健开放式证券投资基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国 北京

中国注册会计师 汤 骏

中国注册会计师 贺 耀

2017 年 3 月 22 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	180,973,999.75	445,808,939.37
结算备付金		4,658,493.48	3,365,436.38
存出保证金		573,636.12	1,810,488.62
交易性金融资产	7.4.7.2	3,399,332,150.42	3,864,339,001.70
其中：股票投资		2,518,526,050.12	2,893,838,001.70
基金投资		-	-
债券投资		880,806,100.30	970,501,000.00
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		65,631.26	32,956,857.11
应收利息	7.4.7.5	15,477,166.96	20,247,293.94
应收股利		-	-
应收申购款		66,825.71	128,599.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,601,147,903.70	4,368,656,616.80
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		3,467,032.09	-
应付赎回款		1,776,570.66	6,833,756.01
应付管理人报酬		4,629,909.32	5,507,228.07
应付托管费		771,651.55	917,871.33
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,434,627.22	2,216,133.83
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	450,509.69	453,056.61
负债合计		12,530,300.53	15,928,045.85
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,660,905,913.87	1,772,456,287.97

未分配利润	7.4.7.10	1,927,711,689.30	2,580,272,282.98
所有者权益合计		3,588,617,603.17	4,352,728,570.95
负债和所有者权益总计		3,601,147,903.70	4,368,656,616.80

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.068 元，基金份额总额 3,360,747,642.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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
<b>一、收入</b>		-405,514,925.12	2,884,770,495.13
1. 利息收入		31,140,866.30	53,504,676.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,654,550.42	2,806,778.41
债券利息收入		29,457,913.51	50,454,510.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,402.37	243,387.40
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-143,727,824.29	3,935,887,256.14
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-161,344,525.14	3,881,840,049.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,478,990.00	30,492,515.29
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	20,095,690.85	23,554,691.48
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-292,991,513.95	-1,105,080,262.29
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	63,546.82	458,824.50
<b>减：二、费用</b>		76,832,198.84	140,590,120.94
1. 管理人报酬		56,306,524.16	91,015,242.02
2. 托管费		9,384,420.79	15,169,206.97
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	10,902,189.66	34,138,832.92
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	239,064.23	266,839.03
<b>三、利润总额</b>		-482,347,123.96	2,744,180,374.19
减：所得税费用		-	-

四、净利润		-482,347,123.96	2,744,180,374.19
-------	--	-----------------	------------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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）	1,772,456,287.97	2,580,272,282.98	4,352,728,570.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-482,347,123.96	-482,347,123.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-111,550,374.10	-134,400,357.97	-245,950,732.07
其中：1. 基金申购款	50,610,217.03	57,240,588.57	107,850,805.60
2. 基金赎回款	-162,160,591.13	-191,640,946.54	-353,801,537.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-35,813,111.75	-35,813,111.75
五、期末所有者权益（基金净值）	1,660,905,913.87	1,927,711,689.30	3,588,617,603.17
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）	4,275,294,154.45	3,831,968,555.05	8,107,262,709.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,744,180,374.19	2,744,180,374.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,502,837,866.48	-3,920,882,804.09	-6,423,720,670.57
其中：1. 基金申购款	178,091,558.33	241,436,102.73	419,527,661.06
2. 基金赎回款	-2,680,929,424.81	-4,162,318,906.82	-6,843,248,331.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-74,993,842.17	-74,993,842.17

值变动			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,772,456,287.97	2,580,272,282.98	4,352,728,570.95

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 基金基本情况

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]67 号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，嘉实理财通系列开放式证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）和嘉实债券开放式证券投资基金，基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 1,030,248,511.17 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于 2007 年 5 月 30 日进行了基金份额拆分操作，当日本基金拆分前基金份额净值为人民币 2.024 元，本基金管理人按照 1:2.023867075 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。拆分后，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.023867075 份。本基金于 2007 年 5 月 31 日进行了变更登记。

本基金限于投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场前 50% 的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司股票，投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%，债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会

计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认，即从本基金账户和资产负债表内予以转销；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

##### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的市价作为公允价值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易市价确定公允价值；如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证

具有可靠性的估值技术，确定公允价值。本基金采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### **7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发



行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或再投资方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，未选择分红方式的基金份额持有人的分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 基金收益分配比例按照有关规定执行；

(7) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成；

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### 7.4.6.2 营业税、增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，

自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》的规定，2017 年 7 月 1 日（含）以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	180,973,999.75	445,808,939.37
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	180,973,999.75	445,808,939.37

注：定期存款的存款期限指票面存期。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,562,807,482.97	2,518,526,050.12	-44,281,432.85
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	101,100.30	8,100.30
	银行间市场	870,817,038.90	9,887,961.10
	合计	870,910,038.90	9,896,061.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,433,717,521.87	3,399,332,150.42	-34,385,371.45
项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,652,632,940.30	2,893,838,001.70	241,205,061.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	93,000.00	-
	银行间市场	953,006,918.90	17,401,081.10
	合计	953,099,918.90	17,401,081.10
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,605,732,859.20	3,864,339,001.70	258,606,142.50

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金未持有买入返售金融资产。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金无买断式逆回购交易中

取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	27,624.79	55,384.24
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	2,096.30	1,515.92
应收债券利息	15,447,187.09	20,189,578.01
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.68	1.07
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	258.10	814.70
合计	15,477,166.96	20,247,293.94

#### 7.4.7.6 其他资产

本期末（2016年12月31日）及上年度末（2015年12月31日），本基金无其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,434,407.22	2,215,908.83
银行间市场应付交易费用	220.00	225.00
合计	1,434,627.22	2,216,133.83

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	509.69	3,056.61
预提费用	200,000.00	200,000.00
应付指数使用费	-	-
其他	-	-
合计	450,509.69	453,056.61

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,586,463,128.66	1,772,456,287.97
本期申购	102,410,325.55	50,610,217.03
本期赎回	-328,125,811.29	-162,160,591.13
本期末	3,360,747,642.92	1,660,905,913.87

注：申购含转换入、红利再投份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,915,188,146.89	-334,915,863.91	2,580,272,282.98
本期利润	-189,355,610.01	-292,991,513.95	-482,347,123.96
本期基金份额交易产生的变动数	-170,546,018.66	36,145,660.69	-134,400,357.97
其中：基金申购款	80,209,914.68	-22,969,326.11	57,240,588.57
基金赎回款	-250,755,933.34	59,114,986.80	-191,640,946.54
本期已分配利润	-35,813,111.75	-	-35,813,111.75
本期末	2,519,473,406.47	-591,761,717.17	1,927,711,689.30

## 7.4.7.11 存款利息收入

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
	活期存款利息收入	1,582,363.94
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	60,782.18	126,960.77
其他	11,404.30	56,127.52
合计	1,654,550.42	2,806,778.41

## 7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	4,206,870,179.76	14,896,709,302.53
减：卖出股票成本总额	4,368,214,704.90	11,014,869,253.16
买卖股票差价收入	-161,344,525.14	3,881,840,049.37

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	776,236,000.00	1,872,158,549.11
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	752,478,990.00	1,799,867,976.40
减：应收利息总额	26,236,000.00	41,798,057.42
买卖债券差价收入	-2,478,990.00	30,492,515.29

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

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），本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	20,095,690.85	23,554,691.48
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	20,095,690.85	23,554,691.48

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-292,991,513.95	-1,105,080,262.29
——股票投资	-285,486,494.25	-1,087,117,395.29



——债券投资	-7,505,019.70	-17,962,867.00
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-292,991,513.95	-1,105,080,262.29

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	55,128.70	390,338.27
基金转出费收入	8,418.12	68,486.23
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
合计	63,546.82	458,824.50

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	10,898,264.66	34,130,282.92
银行间市场交易费用	3,925.00	8,550.00
合计	10,902,189.66	34,138,832.92

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	21,064.23	48,639.03

指数使用费	-	-
上市年费	-	-
红利手续费	-	-
其他	-	200.00
合计	239,064.23	266,839.03

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，除在 7.4.6.2 营业税、增值税中披露的事项外，本基金无其他重大资产负债表日后事项。

## 7.4.9 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
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

## 7.4.10 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。

### 7.4.10.1 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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 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	56,306,524.16	91,015,242.02

其中：支付销售机构的客户维护费	6,156,139.50	10,063,688.20
-----------------	--------------	---------------

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	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	9,384,420.79	15,169,206.97

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		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
中国银行	180,973,999.75	1,582,363.94	445,808,939.37	2,623,690.12

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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.11 利润分配情况**

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		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	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2016年1月18日	-	2016年1月18日	0.1000	15,004,246.96	20,808,864.79	35,813,111.75	2015年年度收益分配于2016年实施
合计	-	-	-	0.1000	15,004,246.96	20,808,864.79	35,813,111.75	

**7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券****7.4.12.1.1 受限证券类别：股票**

金额单位：人民币元

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
601375	中原证券	2016年12月20日	2017年1月3日	未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00	网下申购
603228	景旺电子	2016年12月28日	2017年1月6日	未上市	23.16	23.16	3,491	80,851.56	80,851.56	网下申购
603877	太平鸟	2016年12月29日	2017年1月9日	未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00	网下申购

300583	赛托生物	2016年 12月29 日	2017年 1月6 日	未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78	网下申购
603689	皖天然气	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66	网下申购
603035	常熟汽饰	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04	网下申购
603266	天龙股份	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06	网下申购
300587	天铁股份	2016年 12月28 日	2017年 1月5 日	未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18	网下申购
002840	华统股份	2016年 12月29 日	2017年 1月10 日	未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70	网下申购
002838	道恩股份	2016年 12月28 日	2017年 1月6 日	未上市	15.28	15.28	681	10,405.68	10,405.68	网下申购
603186	华正新材	2016年 12月26 日	2017年 1月3 日	未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38	网下申购
300586	美联新材	2016年 12月26 日	2017年 1月4 日	未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80	网下申购
300591	万里马	2016年 12月30 日	2017年 1月10 日	未上市	3.07	3.07	2,397	7,358.79	7,358.79	网下申购
300588	熙菱信息	2016年 12月27 日	2017年 1月5 日	未上市	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20	网下申购

#### 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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债券。

#### 7.4.12.1.3 受限证券类别：其他

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其他证券。

#### 7.4.12.2 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
000547	航天发展	2016年4月19日	重大事项停牌	15.28	2017年1月3日	16.90	3,699,890	89,727,973.92	56,534,319.20	-
600859	王府井	2016年9月27日	重大事项停牌	16.28	-	-	1,500,000	26,317,790.24	24,420,000.00	-
603986	兆易创新	2016年9月19日	重大事项停牌	177.97	2017年3月13日	195.77	101,653	17,912,636.45	18,091,184.41	-
300065	海兰信	2016年12月8日	重大事项停牌	38.52	-	-	119,900	4,484,826.74	4,618,548.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系,本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任,充分发挥独立董事监督职能,保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险,本基金管理人设立风险控制委员会,由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成,负责全面评估本基金管理人经营管理过

程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### **7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，或可在银行间同业市场交易，因此，除在附注

7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	180,973,999.75	-	-	-	180,973,999.75
结算备付金	4,658,493.48	-	-	-	4,658,493.48
存出保证金	573,636.12	-	-	-	573,636.12
交易性金融资产	419,685,000.00	205,121,100.30	256,000,000.00	2,518,526,050.12	3,399,332,150.42
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	65,631.26	65,631.26
应收利息	-	-	-	15,477,166.96	15,477,166.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	449.86	-	-	66,375.85	66,825.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-



其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	605,891,579.21	205,121,100.30	256,000,000.00	2,534,135,224.19	3,601,147,903.70
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,467,032.09	3,467,032.09
应付赎回款	-	-	-	1,776,570.66	1,776,570.66
应付管理人报酬	-	-	-	4,629,909.32	4,629,909.32
应付托管费	-	-	-	771,651.55	771,651.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,434,627.22	1,434,627.22
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	450,509.69	450,509.69
负债总计	-	-	-	12,530,300.53	12,530,300.53
利率敏感度缺口	605,891,579.21	205,121,100.30	256,000,000.00	2,521,604,923.66	3,588,617,603.17
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	445,808,939.37	-	-	-	445,808,939.37
结算备付金	3,365,436.38	-	-	-	3,365,436.38
存出保证金	1,810,488.62	-	-	-	1,810,488.62
交易性金融资产	501,053,000.00	103,800,000.00	365,648,000.00	2,893,838,001.70	3,864,339,001.70
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	32,956,857.11	32,956,857.11
应收利息	-	-	-	20,247,293.94	20,247,293.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	14,500.00	-	-	114,099.68	128,599.68
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	952,052,364.37	103,800,000.00	365,648,000.00	2,947,156,252.43	4,368,656,616.80
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,833,756.01	6,833,756.01

应付管理人报酬	-	-	-	5,507,228.07	5,507,228.07
应付托管费	-	-	-	917,871.33	917,871.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,216,133.83	2,216,133.83
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	453,056.61	453,056.61
负债总计	-	-	-	15,928,045.85	15,928,045.85
利率敏感度缺口	952,052,364.37	103,800,000.00	365,648,000.00	2,931,228,206.58	4,352,728,570.95

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016年12月31日）	上年度末（2015年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	4,553,236.13	5,772,419.91
市场利率上升 25 个基点	-4,495,730.00	-5,689,873.11	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合的资产配置范围为：在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,518,526,050.12	70.18	2,893,838,001.70	66.48
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,518,526,050.12	70.18	2,893,838,001.70	66.48

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2016 年 12 月 31 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	249,100,620.60	178,030,356.80
	业绩比较基准下降 5%	-249,100,620.60	-178,030,356.80

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金和存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,414,482,872.98 元，属于第二层次的余额为人民币 984,849,277.44 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次的余额为人民币 2,371,387,792.15 元，第二层次的余额为人民币 1,492,951,209.55 元，无属于第三层次的余额）。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》的规定，自2015年3月31日起，交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）采用中证指数有限公司提供的估值数据进行估值。

本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况（上年度：无）。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	2,518,526,050.12	69.94
	其中：股票	2,518,526,050.12	69.94
2	固定收益投资	880,806,100.30	24.46
	其中：债券	880,806,100.30	24.46
	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	185,632,493.23	5.15
7	其他各项资产	16,183,260.05	0.45
8	合计	3,601,147,903.70	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	30,585,581.76	0.85
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,734,412,437.55	48.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	164,986,425.30	4.60
F	批发和零售业	389,141,874.85	10.84
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	64,580,031.84	1.80
J	金融业	74,780,860.14	2.08
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,991,263.90	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	44,009,657.12	1.23
S	综合	-	-
	合计	2,518,526,050.12	70.18

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	-------	------	---------

					比例 (%)
1	000028	国药一致	2,427,576	162,404,834.40	4.53
2	000963	华东医药	1,772,622	127,752,867.54	3.56
3	600737	中粮屯河	9,697,798	120,834,563.08	3.37
4	600038	中直股份	1,887,871	91,410,713.82	2.55
5	000581	威孚高科	3,722,762	83,538,779.28	2.33
6	000063	中兴通讯	5,125,362	81,749,523.90	2.28
7	000651	格力电器	3,208,600	78,995,732.00	2.20
8	002051	中工国际	3,399,906	77,925,845.52	2.17
9	600759	洲际油气	7,583,400	74,468,988.00	2.08
10	600477	杭萧钢构	7,289,551	73,259,987.55	2.04
11	002049	紫光国芯	2,015,274	66,383,125.56	1.85
12	600703	三安光电	4,870,080	65,210,371.20	1.82
13	002450	康得新	3,368,990	64,381,398.90	1.79
14	600867	通化东宝	2,757,126	60,463,773.18	1.68
15	600436	片仔癀	1,300,384	59,544,583.36	1.66
16	000547	航天发展	3,699,890	56,534,319.20	1.58
17	000401	冀东水泥	4,408,256	52,458,246.40	1.46
18	300056	三维丝	3,045,486	50,707,341.90	1.41
19	600498	烽火通信	1,917,843	48,348,822.03	1.35
20	601992	金隅股份	10,737,118	47,887,546.28	1.33
21	000423	东阿阿胶	884,154	47,629,375.98	1.33
22	600584	长电科技	2,400,931	42,376,432.15	1.18
23	601688	华泰证券	2,199,967	39,291,410.62	1.09
24	002338	奥普光电	798,836	38,663,662.40	1.08
25	600118	中国卫星	1,200,000	37,488,000.00	1.04
26	300033	同花顺	500,000	34,390,000.00	0.96
27	000525	红太阳	1,987,146	34,218,654.12	0.95
28	600104	上汽集团	1,448,100	33,957,945.00	0.95
29	601799	星宇股份	879,952	33,878,152.00	0.94
30	601098	中南传媒	1,999,920	33,318,667.20	0.93
31	002142	宁波银行	2,000,000	33,280,000.00	0.93
32	600019	宝钢股份	5,000,000	31,750,000.00	0.88
33	000778	新兴铸管	6,005,100	31,046,367.00	0.87
34	601058	赛轮金宇	7,584,804	30,870,152.28	0.86
35	000998	隆平高科	1,427,232	30,585,581.76	0.85
36	600804	鹏博士	1,365,600	29,947,608.00	0.83
37	002366	台海核电	497,751	26,689,408.62	0.74
38	600308	华泰股份	4,846,300	26,363,872.00	0.73

39	603328	依顿电子	823,197	26,325,840.06	0.73
40	600859	王府井	1,500,000	24,420,000.00	0.68
41	000858	五粮液	700,000	24,136,000.00	0.67
42	300458	全志科技	226,414	20,701,032.02	0.58
43	600518	康美药业	1,117,900	19,954,515.00	0.56
44	002053	云南能投	999,954	19,189,117.26	0.53
45	300362	天翔环境	980,100	18,798,318.00	0.52
46	002572	索菲亚	336,255	18,211,570.80	0.51
47	603986	兆易创新	101,653	18,091,184.41	0.50
48	002180	艾派克	624,855	17,570,922.60	0.49
49	601908	京运通	2,345,300	16,698,536.00	0.47
50	600178	东安动力	1,503,800	16,601,952.00	0.46
51	603588	高能环境	510,903	15,991,263.90	0.45
52	300408	三环集团	992,100	15,754,548.00	0.44
53	600068	葛洲坝	1,500,000	13,785,000.00	0.38
54	600219	南山铝业	3,725,500	11,511,795.00	0.32
55	300364	中文在线	270,521	10,690,989.92	0.30
56	000786	北新建材	780,473	8,031,067.17	0.22
57	000422	湖北宜化	1,000,000	7,950,000.00	0.22
58	600217	中再资环	808,196	6,821,174.24	0.19
59	000830	鲁西化工	1,000,000	5,590,000.00	0.16
60	600582	天地科技	1,000,000	4,970,000.00	0.14
61	300065	海兰信	119,900	4,618,548.00	0.13
62	600872	中炬高新	309,500	4,357,760.00	0.12
63	601997	贵阳银行	133,200	2,101,896.00	0.06
64	600426	华鲁恒升	149,950	1,986,837.50	0.06
65	000059	华锦股份	159,400	1,896,860.00	0.05
66	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
67	603816	顾家家居	2,643	125,119.62	0.00
68	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
69	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
70	603708	家家悦	2,937	92,897.31	0.00
71	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
72	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
73	002831	裕同科技	1,109	76,742.80	0.00
74	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
75	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
76	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
77	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00

78	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
79	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
80	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
81	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00
82	603878	武进不锈	1,000	40,000.00	0.00
83	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
84	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
85	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
86	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.00
87	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
88	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
89	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
90	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
91	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
92	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
93	002838	道恩股份	681	10,405.68	0.00
94	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
95	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
96	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
97	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00
98	600511	国药股份	76	2,287.60	0.00
99	000712	锦龙股份	33	773.52	0.00
100	002544	杰赛科技	26	731.64	0.00
101	000952	广济药业	6	118.20	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002385	大北农	151,129,127.95	3.47
2	600737	中粮屯河	111,192,154.41	2.55
3	600570	恒生电子	109,404,375.46	2.51
4	000401	冀东水泥	108,772,276.36	2.50
5	300033	同花顺	92,344,128.05	2.12
6	000333	美的集团	92,020,377.73	2.11
7	000581	威孚高科	85,364,305.39	1.96



8	600038	中直股份	84,368,599.75	1.94
9	600115	东方航空	83,882,282.03	1.93
10	000786	北新建材	83,139,251.12	1.91
11	002299	圣农发展	76,806,063.85	1.76
12	000651	格力电器	73,211,440.00	1.68
13	300203	聚光科技	68,753,481.47	1.58
14	600759	洲际油气	66,532,532.46	1.53
15	002049	紫光国芯	65,289,095.94	1.50
16	000969	安泰科技	64,439,304.26	1.48
17	002450	康得新	62,111,024.34	1.43
18	002142	宁波银行	60,461,472.57	1.39
19	002439	启明星辰	55,780,430.92	1.28
20	300458	全志科技	52,548,730.49	1.21

#### 8.4.2 累计卖出金额前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002385	大北农	136,361,102.63	3.13
2	600570	恒生电子	119,218,617.25	2.74
3	600477	杭萧钢构	114,978,227.40	2.64
4	002400	省广股份	111,383,906.98	2.56
5	000786	北新建材	109,010,813.05	2.50
6	000333	美的集团	99,971,519.77	2.30
7	000826	启迪桑德	98,261,308.14	2.26
8	000028	国药一致	93,008,591.44	2.14
9	002020	京新药业	90,794,398.10	2.09
10	002456	欧菲光	84,542,176.70	1.94
11	000876	新希望	80,461,518.71	1.85
12	000401	冀东水泥	77,115,806.02	1.77
13	600115	东方航空	73,331,894.30	1.68
14	600036	招商银行	71,443,558.43	1.64
15	002299	圣农发展	69,889,901.82	1.61
16	000969	安泰科技	67,683,083.52	1.55
17	600835	上海机电	67,678,519.56	1.55
18	300203	聚光科技	63,834,411.23	1.47

19	002007	华兰生物	61,828,973.70	1.42
20	600340	华夏幸福	57,804,463.35	1.33

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,278,389,247.57
卖出股票收入（成交）总额	4,206,870,179.76

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	256,000,000.00	7.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	624,705,000.00	17.41
	其中：政策性金融债	624,705,000.00	17.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	101,100.30	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	880,806,100.30	24.54

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	120009	12 付息国债 09	2,500,000	256,000,000.00	7.13
2	160401	16 农发 01	2,100,000	210,000,000.00	5.85
3	160209	16 国开 09	1,800,000	179,820,000.00	5.01
4	110208	11 国开 08	1,000,000	103,710,000.00	2.89
5	110235	11 国开 35	500,000	50,710,000.00	1.41

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

报告期末，本基金未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

**8.12 投资组合报告附注****8.12.1**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**8.12.2**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	573,636.12
2	应收证券清算款	65,631.26
3	应收股利	-
4	应收利息	15,477,166.96
5	应收申购款	66,825.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,183,260.05

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	123001	蓝标转债	101,100.30	0.00

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
216,788	15,502.46	9,587,279.24	0.29%	3,351,160,363.68	99.71%

**9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	410.69	0.00%

**9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2003年7月9日）基金份额总额	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	3,586,463,128.66
本报告期基金总申购份额	102,410,325.55
减:本报告期基金总赎回份额	328,125,811.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,360,747,642.92

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2016年5月12日本基金管理人发布《关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告》，郭东谋先生不再担任本基金基金经理，本基金由张淼女士及翟琳琳女士共同管理。

2016年1月20日本基金管理人发布公告，戴京焦女士因工作变动不再担任公司副总经理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2016年12月，郭德秋先生担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 80,000.00 元，该审计机构已连续 14 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券股份有限公司	3	1,838,700,557.84	21.67%	1,287,093.44	21.67%	-
广发证券股份有限公司	5	1,587,893,379.34	18.72%	1,111,541.65	18.72%	-
中泰证券股份有限公司	4	924,459,526.90	10.90%	647,127.09	10.90%	新增 3 个
中国国际金融股份有限公司	2	647,206,216.81	7.63%	453,049.45	7.63%	-
兴业证券股份有限公司	3	634,254,329.80	7.48%	443,979.63	7.48%	-
中信建投证券股份有限公司	2	420,235,529.38	4.95%	294,168.00	4.95%	-
长江证券股份有限公司	1	371,239,107.07	4.38%	259,870.42	4.38%	-
中国银河证券股份有限公司	2	349,346,955.66	4.12%	244,545.61	4.12%	-
东兴证券股份有限公司	1	322,303,010.76	3.80%	225,612.12	3.80%	-
安信证券股份有限公司	3	316,072,501.89	3.73%	221,250.77	3.73%	-
华创证券有限责任公司	2	305,659,485.37	3.60%	213,964.63	3.60%	-
海通证券股份有限公司	2	301,410,592.28	3.55%	210,989.05	3.55%	-
宏信证券有限责任公司	2	198,907,876.20	2.34%	139,236.22	2.34%	-
中信证券股份有限公司	4	102,592,008.17	1.21%	71,815.18	1.21%	-
国信证券股份有限公司	1	94,969,946.31	1.12%	66,478.96	1.12%	-
华泰证券股份有限公司	4	35,692,057.04	0.42%	24,984.79	0.42%	-

有限公司						
东吴证券股份 有限公司	1	32,875,511.52	0.39%	23,012.86	0.39%	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源集团 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
浙商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

新时代证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

(1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

(2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

(4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：宏源证券股份有限公司更名为申万宏源西部证券有限公司。

注 4：齐鲁证券有限公司更名为中泰证券股份有限公司。

注 5：新时代证券有限责任公司更名为新时代证券股份有限公司。

注 6：长城证券有限责任公司更名为长城证券股份有限公司。

注 7：中国国际金融有限公司更名为中国国际金融股份有限公司。

注 8：中信证券（浙江）有限责任公司更名为中信证券股份有限公司。

注 9：东吴证券有限责任公司更名为东吴证券股份有限公司。

注 10：浙商证券有限责任公司更名为浙商证券股份有限公司。



注 11：报告期内，本基金退租以下交易单元：华融证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券回购交易	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中泰证券股份有限公司	136,000,000.00	100.00%

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实稳健开放式证券投资基金 2015 年年度收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 1 月 15 日
2	关于增加福建海峡银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 2 月 24 日
3	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 3 月 18 日
4	关于增加大泰金石为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 6 日
5	关于增加北京葱次方嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 7 日
6	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金参与中国银河证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 4 月 8 日
7	嘉实基金管理有限公司 关于代为履行基金经理职责情况的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管	2016 年 5 月 5 日

		理人网站	
8	关于增加联讯证券为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年5月6日
9	关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年5月12日
10	关于增加利得基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年5月30日
11	关于增加中正达广为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年6月8日
12	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与大同证券定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年6月14日
13	嘉实基金管理有限公司关于在京东店铺开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年6月30日
14	嘉实基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过陆金所资管开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年7月1日
15	关于增加广源达信为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年7月13日
16	关于增加深圳新兰德为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016年7月27日
17	关于增加“万得投顾”为嘉实旗	中国证券报、上海证	2016年8月5日

	下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	券报、证券时报、管理人网站	
18	嘉实基金管理有限公司关于对中国银行借记卡持卡人调整基金直销交易优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 1 日
19	关于增加昆山农商银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 14 日
20	关于增加“凤凰金信”为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 9 月 19 日
21	嘉实基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 11 月 24 日
22	关于增加桂林银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 11 月 25 日
23	关于增加北京汇成基金销售有限公司为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 11 月 29 日
24	关于增加东海期货为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 28 日
25	关于增加基煜基金为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2016 年 12 月 30 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实理财通系列开放式证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司  
2017 年 3 月 29 日