

# 嘉实多利分级债券型证券投资基金

## 更新招募说明书

(2011年第1号)

**基金管理人：嘉实基金管理有限公司**

**基金托管人：招商银行股份有限公司**

### 重要提示

(一) 嘉实多利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),根据2011年2月9日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实多利分级债券型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2011]180号)和2011年2月12日《关于嘉实多利分级债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2011]78号)的核准公开发售。本基金基金合同于2011年3月23日正式生效。自该日起本基金管理人开始管理本基金。本基金类型为契约型开放式,根据本基金的投资目标和投资范围,本基金属于债券型证券投资基金。

(二) 基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三) 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险,本基金的特定风险等。嘉实多利基金份额是本基金组合份额,风险低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于较低风险、较低收益的品种。嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额,通过场内的嘉实多利基金份额按照8:2的基金份额配比分拆而来,依照基金合同的关系约定,具有与嘉实多利基金份额不同的风险收益特征。嘉实多利优先份额风险较低、预期收益较稳定,嘉实多利进取份额风险较高、预期收益相对较高。嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额,可通过基金合同约定的配对转换方式合并为场内的嘉实多利基金份额,或通过基金合同约定的份额折算方式,折算为场内的嘉实多利基金份额,

从而还原为本基金组合的风险收益特征。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

（四）投资有风险，投资者投资本基金时应认真阅读本招募说明书。

（五）基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

（六）本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 9 月 23 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 9 月 30 日（未经审计）。

## 目 录

第一部分	绪言	5
第二部分	释义	6
第三部分	基金管理人	12
第四部分	基金托管人	21
第五部分	相关服务机构	27
第六部分	基金份额分级	44
第七部分	基金的募集	48
第八部分	基金合同的生效	50
第九部分	嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市与交易	50
第十部分	嘉实多利基金份额的场外申购、赎回与转换	52
第十一部分	嘉实多利基金份额的场内申购与赎回	59
第十二部分	场内份额配对转换	64
第十三部分	基金份额的登记、转托管、非交易过户、冻结与解冻	67
第十四部分	基金的投资	69
第十五部分	基金的业绩	79
第十六部分	基金的财产	80
第十七部分	基金资产的估值	81
第十八部分	基金的收益分配	87
第十九部分	基金份额折算	88
第二十部分	嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的终止运作	95
第二十一部分	基金的费用与税收	97
第二十二部分	基金的会计与审计	98
第二十三部分	基金的信息披露	99
第二十四部分	风险揭示	105
第二十五部分	基金合同的变更、终止与基金财产的清算	108
第二十六部分	基金合同的内容摘要	111
第二十七部分	基金托管协议的内容摘要	139

第二十八部分 对基金份额持有人的服务.....	153
<a href="#">第二十九部分 其他应披露事项.....</a>	155
第三十部分 招募说明书存放及查阅方式.....	156
第三十一部分 备查文件 .....	156

## 第一部分 绪言

《嘉实多利分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”或“本招募说明书”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)以及《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

嘉实多利分级债券型证券投资基金(以下简称“基金”或“本基金”)是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

## 第二部分 释义

在本基金合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

词语或简称	含义
1.基金或本基金	指嘉实多利分级债券型证券投资基金
2.基金管理人	指嘉实基金管理有限公司
3.基金托管人	指招商银行股份有限公司
4.基金合同或本基金合同	指《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充
5.托管协议	指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《嘉实多利分级债券型证券投资基金托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充
6.招募说明书	指《嘉实多利分级债券型证券投资基金招募说明书》及其定期的更新
7.基金份额发售公告或发售公告	指《嘉实多利分级债券型证券投资基金份额发售公告》
8.法律法规	指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等
9.《基金法》	指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订
10.《销售办法》	指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
11.《信息披露办法》	指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订
12.《运作办法》	指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的

	修订
13.中国证监会	指中国证券监督管理委员会
14.银行业监督管理机构	指中国人民银行和/或中国银行业监督管理委员会
15.基金合同当事人	指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
16.个人投资者	指年满 18 周岁，合法持有现时有效的中华人民共和国居民身份证、军人证件等有效身份证件的中国公民，以及依据有关法律法规规定或中国证监会批准可投资于证券投资基金的其他自然人
17.机构投资者	指依法可以投资开放式证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法注册登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织
18.合格境外机构投资者	指符合现行有效的相关法律法规规定可以投资于中国境内证券市场的中国境外的机构投资者
19.投资人	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者的合称
20.基金份额持有人	指依基金合同和招募说明书合法取得基金份额的投资人
21.基金销售业务	指基金管理人或代销机构宣传推介基金，发售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、非交易过户、转托管及定期定额投资等业务
22.销售机构	指直销机构和代销机构
23.直销机构	指嘉实基金管理有限公司
24.代销机构	指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议，代为办理基金销售业务的机构
25.基金销售网点	指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点
26.注册登记业务	指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括

	投资人基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
27.注册登记机构	指办理注册登记业务的机构。嘉实基金管理有限公司或接受嘉实基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
28.注册登记系统	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金登记结算系统
29.证券登记结算系统	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统
30.基金账户	指注册登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户
31.交易账户	指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构买卖本基金的基金份额变动及结余情况的账户
32.基金合同生效日	指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期
33.基金合同终止日	指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期
34.基金募集期	指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月
35.存续期	指基金合同生效至终止之间的不定期期限
36.基金份额结构	本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额是基金组合份额，简称“嘉实多利基金份额”，分为场外份额和场内份额。分级份额包括两类，稳健收益类份额（简称“嘉实多利优先份额”）和积极收益类份额（简称“嘉实多利进取份额”）。嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的基金份额配比始终保持8：2的比例不变
37.嘉实多利基金份额或基础份	嘉实多利分级债券型证券投资基金之基础份额



额	
38.嘉实多利优先份额	按照基金合同约定规则所分离的稳健收益类基金份额，是本基金两类分级份额中的一类
39.嘉实多利进取份额	按照基金合同约定规则所分离的积极收益类基金份额，是本基金两类分级份额中的另一类
40.分级份额	嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的合称
41.分拆	指根据基金合同约定，场内的嘉实多利基金份额按照 8：2 的基金份额配比分拆成嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的行为
42.合并	指根据基金合同约定，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额按照 8：2 的基金份额配比合并成嘉实多利基金份额场内份额的行为
43.场内份额配对转换	指根据基金合同约定，场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并
44.约定年收益率	指本基金为每份嘉实多利优先份额设定的每年应获得的收益率，嘉实多利优先份额的约定年收益率为 5%
45.约定收益	指嘉实多利优先份额或嘉实进取份额的份额净值超出 1.0000 元的部分
46.工作日	指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日
47.T 日	指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他业务申请的工作日
48.T+n 日	指自 T 日起第 n 个工作日(不包含 T 日)
49.开放日	指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日
50.交易时间	指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段
51.《业务规则》	指嘉实基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则
52.认购	指在基金募集期内，投资人申请购买基金份额的行为
53.申购	指基金合同生效后，投资人根据基金合同和招募说明书的规

	定申请购买基金份额的行为
54.赎回	指基金合同生效后，基金份额持有人按基金合同规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为
55.上市交易	指基金存续期间投资人通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的行为
56.场外	通过深圳证券交易所外的销售机构办理基金份额认购、嘉实多利基金份额申购和赎回的场所。通过该等场所办理基金份额的认购、嘉实多利基金份额申购和赎回也称为场外认购、场外申购、场外赎回
57.场内	指通过深圳证券交易所交易系统内的会员单位进行基金份额认购、嘉实多利基金份额申购和赎回，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易的深圳证券交易所会员单位和场所
58.基金转换	指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金基金份额的行为
59.转托管	指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作
60.系统内转托管	投资人将其持有的嘉实多利基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（席位）之间进行转托管的行为
61.跨系统转托管	投资人将其持有的嘉实多利基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统间进行转托管的行为
62.定期定额投资计划	指投资人通过有关销售机构提出申请，约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式，由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及基金申购申请的一种投资方式

63.巨额赎回	指本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的 10%
64.元	指人民币元
65.基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约
66.基金资产总值	指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和
67.基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
68.基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程
69.指定媒体	指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、互联网网站及其他媒体
70.不可抗力	指本基金合同当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易、公众通讯设备或互联网络故障。

## 第三部分 基金管理人

### （一）基金管理人概况

#### 1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层
法定代表人	王忠民
总经理	赵学军
成立日期	1999 年 3 月 25 日
注册资本	1.5 亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司 40%，立信投资有限责任公司 30%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%。
存续期间	持续经营
电话	(010) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

#### 2、部门设置情况

公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。

公司目前下设股票投资部、固定收益部、定量投资部、结构产品投资部、机构投资部、研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部、法律部、产品管理部、机构业务团队、渠道发展部、营销策划部、客户服务部、电子商务部、信息技术部、基金运营部、登记结算部、财务部、人力资源部、战略发展部等部门。

股票投资部、固定收益部、定量投资部、结构产品投资部和机构投资部负责根据投资决策委员会制定的原则进行投资。研究部负责行业、上市公司研究和投资策略研究。交易部负责完成基金经理交易指令。风险管理部负责公司投资风险分析与管理、投资流程、绩效考核。监察

稽核部和法律部负责对公司及其员工遵守国家相关法律、法规和公司内部规章制度等情况进行监督和检查。产品管理部负责新产品开发以及相关的市场营销研究、法律环境研究和理财策略研究等。机构业务团队主要负责年金、专户、机构客户及高端个人基金销售的开发与维护。渠道发展部、营销策划部、电子商务部、客户服务部负责市场推广、基金销售、客户服务、销售渠道管理等业务。信息技术部、基金运营部、登记结算部负责公司信息系统的日常运行与维护跟踪研究新技术,进行相应的技术系统规划与开发、基金会计核算、估值、开放式基金注册、登记和清算等业务。财务部负责公司财务管理工作。人力资源部负责公司企业文化建设、文字档案、相关后勤服务、人力资源管理、薪酬制度、人员培训、人事档案等事务等综合事务管理。战略发展部负责公司经营战略规划、新业务发展等。

### 3、管理基金情况

截止 2011 年 9 月 30 日,基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、27 只开放式证券投资基金,具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、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、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数 (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 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII - LOF)、嘉实主题新动力股票、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票、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。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券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。

## (二) 主要人员情况

### 1、董事、监事及高级管理人员

安奎先生,董事长,大学本科,中共党员,曾任吉林农业机械研究所主任;吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理;吉林省证券公司总经理;东北证券有限责任公司监事长;吉林天信投资公司总经理;中诚信托有限责任公司副总经理。2011年8月5日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生,董事、总经理。中共党员,经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公

司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年至今任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996年9月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Mark Cullen 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管，贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人，德意志银行(纽约)全球股票投资部首席运营官、MD。现任德意志资产管理(纽约)全球首席运营官、MD。

Wolfgang Matis 先生，董事，德国籍，法兰克福商学校经济专业(Frankfurt Business School of Economics)。曾任德意志银行全球固定收益负责人、全球市场负责人，董事总经理(MD)。现任德意志资产管理公司(法兰克福)董事会成员、CEO 兼发言人。

汤欣先生，独立董事。法学博士。1998年至2000年任北京大学法学院博士后研究人员、授课教师，1999年至2000年任中国证监会《上市公司收购暂行规定(草案)》起草小组成员，2000年至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学法学院副教授。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业(集

团)股份有限公司董事会秘书,北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

王利刚先生,监事,经济学学士。2001年2月至今,就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部,历任人力资源部副总监、总监。

宋振茹女士,副总经理,中共党员,硕士研究生,经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理公司,历任督察员和公司副总经理。

李道滨先生,副总经理,中共党员,法学博士,经济师。1988年7月至1990年9月任职于厦门华侨博物馆。1993年7月至1998年9月任职于中国厦门国际经济技术合作公司。2000年10月至今任职于嘉实基金管理公司,历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

张峰先生,副总经理,中共党员、硕士。曾就职于国家计委,曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士,副总经理,武汉大学经济学硕士,加拿大大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人;平安证券公司助理总经理,平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任总经理助理,2008年7月起任公司副总经理。

王炜女士,督察长,中共党员,法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

## 2、基金经理

### (1) 现任基金经理

王茜女士,武汉大学工商管理硕士,9年证券从业经历,具有基金从业资格。曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理,2002年7月至2002年8月任职于中信证券股份有限公司固定收益部,2002年9月至2008年11月任职于长盛基金管理有限公司,2003年10月25日至2008年11月7日任长盛中信全债指数增强型债券投资基金基金经理,2005年12月12日至2008年11月7日任长盛货币市场基金基金经理。2008年11月加盟嘉实基金管理有限公司,现任嘉实基金固定收益部副总监。2009年2月13日至今任嘉实多元收益债券基金基金经理。2011年3月23日至今任本基金基金经理。

### (2) 历任基金经理: 本基金无历任基金经理

### 3、投资决策委员会

投资决策委员会的成员包括：公司总经理赵学军先生、副总经理戴京焦女士、总经理助理邵健先生、总经理助理詹凌蔚先生、总经理助理陶荣辉先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

### （三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回、转换和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金份额资产净值和基金份额累计净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

### （四）基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺严格遵守相关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定，建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会有关规定的行为发生。

2、本基金管理人承诺严格遵守《中华人民共和国证券法》、《基金法》及有关法律法规，建立健全的内部控制制度，采取有效措施，防止下列行为发生：

（1）将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

（2）不公平地对待其管理的不同基金财产；

（3）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；



(4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5) 法律法规或中国证监会规定禁止的其他行为。

3、本基金管理人承诺加强人员管理,强化职业操守,督促和约束员工遵守国家有关法律、法规及行业规范,诚实信用、勤勉尽责,不得将基金财产用于以下投资或活动:

(1) 承销证券;

(2) 向他人贷款或者提供担保;

(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 买卖其他基金份额,但是法律法规或中国证监会另有规定的除外;

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(8) 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

#### 4、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定,本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益;

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人谋取利益;

(3) 不违反现行有效的有关法律、法规、规章、基金合同和中国证监会的有关规定,泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息;

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

### (五) 基金管理人内部控制制度

#### 1、内部控制制度概述

为加强内部控制,防范和化解风险,促进公司诚信、合法、有效经营,保障基金份额持有人利益,根据《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》并结合公司具体情况,公司已建立

健全内部控制体系和内部控制制度。

公司内部控制制度由内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等部分组成。公司内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，是各项基本管理制度的纲要和总揽。基本管理制度包括投资管理、信息披露、信息技术管理、公司财务管理、基金会计、人力资源管理、资料档案管理、业绩评估考核、监察稽核、风险控制、紧急应变等制度。部门业务规章是对各部门的主要职责、岗位设置、岗位职责、操作守则等具体说明。

## 2、内部控制的原则

(1) 健全性原则：内部控制包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节；

(2) 有效性原则：通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行；

(3) 独立性原则：公司各机构、部门和岗位在职能上必须保持相对独立；

(4) 相互制约原则：组织结构体现职责明确、相互制约的原则，各部门有明确的授权分工，操作相互独立。

(5) 成本效益原则：运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

## 3、内部控制组织体系

(1) 公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设审计与合规委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 投资决策委员会为公司投资管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、总经理助理组成，负责指导基金资产的运作、确定基本的投资策略和投资组合的原则。

(3) 风险控制委员会为公司风险管理的最高决策机构，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

(4) 督察长积极对公司各项制度、业务的合法合规性及公司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公司内部控制执行情况。

(5) 监察稽核部：公司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 workflows、组

织纪律。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况  
的监察稽核工作。

(6) 业务部门：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。

(7) 岗位员工：公司努力树立内控优先和风险管理理念，培养全体员工的风险防范意识，  
营造一个浓厚的内控文化氛围，保证全体员工及时了解国家法律法规和公司规章制度，使风险  
意识贯穿到公司各个部门、各个岗位和各个环节。员工在其岗位职责范围内承担相应的内控责  
任，并负有对岗位工作中发现的风险隐患或风险问题及时报告、反馈的义务。

#### 4、内部控制措施

公司确立“制度上控制风险、技术上量化风险”，积极吸收或采用先进的风险控制技术和  
手段，进行内部控制和风险管理。

(1) 公司逐步健全法人治理结构，充分发挥独立董事和监事会的监督职能，严禁不正当关  
联交易、利益输送和内部人控制现象的发生，保护投资者利益和公司合法权益。

(2) 公司设置的组织结构，充分体现职责明确、相互制约的原则，各部门均有明确的授权  
分工，操作相互独立。公司逐步建立决策科学、运营规范、管理高效的运行机制，包括民主、  
透明的决策程序和管理议事规则，高效、严谨的业务执行系统，以及健全、有效的内部监督和  
反馈系统。

(3) 公司设立了顺序递进、权责统一、严密有效的内控防线：

①各岗位职责明确，有详细的岗位说明书和业务流程，各岗位人员在上岗前均应知悉并  
以书面方式承诺遵守，在授权范围内承担责任；

②建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，相关部门和岗位之间相互监督制衡；

(4) 公司建立有效的人力资源管理制度，健全激励约束机制，确保公司人员具备与岗位要  
求相适应的职业操守和专业胜任能力。

(5) 公司建立科学严密的风险评估体系，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时  
防范和化解风险。

(6) 授权控制应当贯穿于公司经营活动的始终，授权控制的主要内容包括：

①股东会、董事会、监事会和管理层充分了解和履行各自的职权，建立健全公司授权标  
准和程序，确保授权制度的贯彻执行；

②公司各部门、分公司及员工在规定授权范围内行使相应的职责；

③重大业务授权采取书面形式，授权书应当明确授权内容和时效。

④对已获授权的部门和人员建立有效的评价和反馈机制，对已不适用的授权应及时修改或取消授权。

(7) 建立完善的基金财务核算与基金资产估值系统和资产分离制度，基金资产与公司自有资产、其他委托资产以及不同基金的资产之间实行独立运作，分别核算，及时、准确和完整地反映基金财产的状况。

(8) 建立科学、严格的岗位分离制度，明确划分各岗位职责，投资和交易、交易和清算、基金会计和公司会计等重要岗位不得有人员重叠。投资、研究、交易、IT 等重要业务部门和岗位进行物理隔离。

(9) 建立和维护信息管理系统，严格信息管理，保证客户资料等信息安全、真实和完整。积极维护信息沟通渠道的畅通，建立清晰的报告系统，各级领导、部门及员工均有明确的报告途径。

(10) 建立和完善客户服务标准，加强基金销售管理，规范基金宣传推介，不得有不正当销售行为和不正当竞争行为。

(11) 制订切实有效的应急应变措施，建立危机处理机制和程序，对发生严重影响基金份额持有人利益、可能引起系统性风险、严重影响社会稳定的突发事件，按照预案妥善处理。

(12) 公司建立健全内部监控制度，督察长、监察稽核部对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内部控制制度落实；定期评价内部控制的有效性并适时改进。

①对公司各项制度、业务的合法合规性核查。由监察稽核部设计各部门监察稽核点明细，按照查核项目和查核程序进行部门自查、监察部核查，确保公司各项制度、业务符合有关法律、行政法规、部门规章及行业监管规则。

②对内部风险控制制度的持续监督。由监察稽核部组织相关业务部门、岗位共同识别风险点，界定风险责任人，设计内部风险点自我评估表，对风险点进行评估和分析，并由监察稽核部监督风险控制措施的执行，及时防范和化解风险。

③督察长发现公司存在重大风险或者有违法违规行为，在告知总经理和其他有关高级管理人员的同时，向董事会、中国证监会和公司所在地中国证监会派出机构报告。

##### 5、基金管理人关于内部控制的声明

(1) 本公司承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；

(2) 本公司承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部控制体系和内部控制制度。

## 第四部分 基金托管人

### （一）基金托管人概况

#### 1、基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

成立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：215.77亿元

法定代表人：傅育宁

行长：马蔚华

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### 2、发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2011年6月30日，招商银行总资产2.643万亿元人民币，核心资本充足率7.81%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、运营室、监察稽核室4个职能处室，现有员工52人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管

业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S 托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银系统”、托管业务综合系统和“6 心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只 FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金 T+1 到账、第一只境外银行 QDII 基金、第一只红利 ETF 基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单 TOT 保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可，被境内外权威媒体评为“中国最佳托管专业银行”“中国资产托管市场创新客户满意首选品牌”6S 资产托管综合业务平台荣获“深圳市金融创新奖二等奖第一名”。

经过八年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2010 年，招商银行实现托管利润 8.11 亿元，托管费收入 3.21 亿元，托管资产突破 3200 亿元，托管日均存款突破 300 亿元，托管产品数量、托管资产规模和托管费收入稳居中小托管银行第一，基金托管新增规模居行业首位，内部控制连续四年通过 SAS70 国际认证。

## （二）主要人员情况

傅育宁先生，招商银行董事长和非执行董事，英国布鲁诺尔大学博士学位。1999 年 3 月开始担任本公司董事。2010 年 8 月起任招商局集团有限公司董事长。兼任招商局国际有限公司（香港联合交易所上市公司）主席，利和经销集团有限公司（香港联合交易所上市公司）及信和置业有限公司（香港联合交易所上市公司）独立非执行董事，香港港口发展局董事，香港证券及期货事务监察委员会成员等；中国南山开发（集团）股份有限公司董事长，招商局能源运输股份有限公司（上海证券交易所上市公司）董事长，及中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（深圳证券交易所上市公司）董事长，及新加坡上市公司嘉德置地有限公司独立非执行董事。

马蔚华先生，招商银行执行董事、行长兼首席执行官，1999 年 1 月加入本公司。经济学博士学位，高级经济师。第十一届全国政协委员。1999 年 1 月起任招商银行股份有限公司行长兼首席执行官。分别自 1999 年 9 月、2003 年 9 月、2007 年 11 月及 2008 年 10 月起兼任招银国际金融有限公司董事长、招商信诺人寿保险有限公司董事长及招商基金管理有限公司董事长及永隆银行有限公司董事长，并自 2002 年 7 月起担任招商局集团公司董

事。同时担任中国国际商会副主席、中国企业家协会执行副会长、中国金融学会常务理事、中国红十字会第八届理事会常务理事、深圳市综研软科学发展基金会理事长和北京大学、清华大学等多所高校兼职教授等职。

唐志宏先生，招商银行副行长，吉林大学本科毕业，高级经济师。1995年5月加入本公司，历任沈阳分行副行长，深圳管理部副主任，兰州分行行长，上海分行行长，深圳管理部主任，总行行长助理，2006年4月起担任本公司副行长。同时担任招商信诺人寿保险公司及中国银联股份有限公司董事。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，大学本科，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

胡家伟先生，大学本科学历，现任招商银行资产托管部副总经理。30多年银行业务及管理工作经历，已获得基金从业资格。历任招商银行总行国际业务部副总经理、招商银行蛇口支行副行长、招商银行总行单证中心主任。曾任中国银行湖北省分行国际结算处副科长、副处长、中国银行十堰分行副行长、香港南洋商业银行押汇部高级经理、香港中银集团港澳管理处业务部高级经理等职务。

### （三）基金托管业务经营情况

截至2011年9月30日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商安泰股票型投资基金、招商安泰平衡型证券投资基金和招商安泰债券投资基金），招商现金增值证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰中信标普300指数证券投资基金、中信现金优势货币市场基金、光大保德信货币市场证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票型证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证央企50交易型开放式指数基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴业合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵

活配置混合型基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级基金、诺安保本混合证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券基金、中银上证国有企业 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、**诺安油气能源股票证券投资基金（QDII-LOF）**共 40 只开放式基金及其它托管资产，**托管资产为 4429.49 亿元人民币。**

#### （四）托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

确保托管业务严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，自觉形成守法经营、规范运作的经营思想和经营理念；形成科学合理的决策机制、执行机制和监督机制，防范和化解经营风险，确保托管业务的稳健运行和托管资产的安全完整；建立有利于查错防弊、堵塞漏洞、消除隐患，保证业务稳健运行的风险控制制度，确保托管业务信息真实、准确、完整、及时；确保内控机制、体制的不断改进和各项业务制度、流程的不断完善。

##### 2、内部控制组织结构

招商银行资产托管业务建立三级内控风险防范体系：

一级风险防范是在总行行长层面对风险进行预防和控制。招商银行实行董事会领导下的行长负责制，重大事项的决策经行长办公会讨论决定，行长室下设风险控制委员会、内部控制状况评审委员会、稽核监督管理委员会、信息规划委员会等机构。

二级风险防范是总行资产托管部在业务室、专业岗位设置时，必须遵循内控制衡原则，监督制衡的形式和方式视业务的风险程度决定。

总行资产托管部内设立稽核监察室，负责部门内部风险预防和控制。稽核监察室在总经理室直接领导下，独立于部门内其他业务室和托管分部，对各岗位、各业务室、各分部、各项业务中的风险控制情况实施监督。

三级风险防范是各业务室对自身业务风险进行自我防范和控制。业务室根据法律法规、监管规定、业务规则及本部门具体情况制定工作流程及风险控制措施。

##### 3、内部控制原则



(1) 全面性原则。内部控制应覆盖各项业务过程和操作环节、覆盖所有室和岗位，并由全部人员参与。

(2) 审慎性原则。内部控制的核心是有效防范各种风险，托管组织体系的构成、内部管理制度建立都要以防范风险、审慎经营为出发点，应当体现“内控优先”的要求。

(3) 独立性原则。各室、各岗位职责应当保持相对独立，不同托管资产之间、托管资产和自有资产之间应当分离。内部控制的检查、评价部门应当独立于内部控制的建立和执行部门，稽核监察室应保持高度的独立性和权威性，负责对部门内部控制工作进行评价和检查。

(4) 有效性原则。内部控制应当符合国家法律法规和监管机关的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行内部控制制度不能存在任何例外，部门任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力。

(5) 适时性原则。内部控制应随着托管业务经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律、法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修订和完善。

(6) 防火墙原则。核算、清算、稽核监察等相关部门，应当在制度上和人员上适当分离，办公网和业务网分离，部门业务网和全行业务网分离，以达到风险防范的目的。

#### 4、内部控制措施

(1) 完善的制度建设。招商银行资产托管部制定了《招商银行证券投资基金托管业务管理办法》、《招商银行托管业务内控管理办法》和《招商银行证券投资基金托管业务操作规程》等一系列规章制度，从资产托管业务操作流程、会计核算、岗位管理、档案管理、保密管理和信息管理等各方面，保证资产托管业务科学化、制度化、规范化运作。为保障托管资产安全和托管业务正常运作，切实维护托管业务各当事人的利益，避免托管业务危机事件发生或确保危机事件发生后能够及时、准确、有效地处理，招商银行还制定了《招商银行托管业务危机事件应急处理办法》，并建立了灾难备份中心，各种业务数据能及时在灾难备份中心进行备份，确保灾难发生时，托管业务能迅速恢复和不间断运行。

(2) 经营风险控制。招商银行资产托管部托管项目审批、资金清算与会计核算双人双岗、大额资金专人跟踪、凭证管理、差错处理等一系列完整的操作规程，有效地控制业务运作过程中的风险

(3) 业务信息风险控制。招商银行资产托管部通过数据加密传输、业务信息启动异地自动

备份功能、业务信息磁带备份并由专人签收保存等措施保证业务信息及数据传递的安全性。业务信息不得泄漏，有关人员如需调用，须经总经理室审批，并做好调用登记。

(4) 客户资料风险控制。招商银行资产托管部对业务运作过程中形成的客户资料，视同会计资料保管。客户资料不得泄露，有关人员如需调用，须经总经理室成员审批，并做好调用登记。

(5) 信息技术系统风险控制。招商银行资产托管部对信息技术系统管理实行双人双岗双责、机房空间隔离并设置门禁管理、电脑密码设置及权限管理、业务网和办公网、与全行业务网双分离制度，与外部业务机构实行防火墙保护等，保证信息技术系统的安全。

(6) 人力资源控制。招商银行资产托管部通过建立良好的企业文化和员工培训、激励机制、加强人力资源管理及建立人才梯级队伍及人才储备机制，有效的进行人力资源控制。

#### (五) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、《运作办法》等有关证券法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金管理人参与银行间债券市场、基金管理人选择存款银行、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人对上述事项的监督与核查中发现基金管理人的实际投资运作违反《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议、上述监督内容的约定和其他有关法律法规的规定，应及时以书面形式通知基金管理人进行整改，整改的时限应符合法规允许的投资比例调整期限。基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式向基金托管人发出回函并改正。在规定时间内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人的投资指令违反《基金法》、《运作办法》、基金合同和有关法律法规规定，应当拒绝执行，立即通知基金管理人限期改正，如基金管理人未能在通知期限内纠正的，基金托管人应向中国证监会报告。

基金管理人义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。对基金托管人发出的书面提示，基金管理人应在规定时间内答复并改正，或

就基金托管人的疑义进行解释或举证；对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项，基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

基金托管人发现基金管理人有关重大违规行为，应及时报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。基金管理人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本托管协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经基金托管人提出警告仍不改正的，基金托管人应报告中国证监会。

## 第五部分 相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1. 直销机构

##### （1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65215577
联系人	赵虹		

##### （2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	吴冬梅		

##### （3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段 86 号城市之心 30H		
电话	(028) 86202100	传真	(028) 86202100
联系人	胡清泉		

##### （4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦附楼二楼		
电话	(0755) 25870686	传真	(0755) 25870663
联系人	周炜		

##### （5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路 10 号颐和国际大厦 A 座 3502 室		
电话	(0532) 66777766	传真	(0532) 66777676
联系人	曹涌		

##### （6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 313 室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 87759331
联系人	徐莉莉		

## (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(0591) 88013673	传真	(0591) 88013670
联系人	吴冬梅		

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(025) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	施镜葵		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 2415-2416 室		
电话	(020) 87555163	传真	(020) 81552120
联系人	陈涤		

**2. 代销机构**

## (1) 招商银行

住所、办公地址	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦		
法定代表人	傅育宁	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83198888	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

## (2) 中国银行

注册地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号		
办公地址	北京市西城区复兴门内大街 1 号中国银行总行办公大楼		
法定代表人	肖钢		
电话	(010) 66596688	传真	(010) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

## (3) 中国工商银行

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街 55 号		
法定代表人	姜建清	联系人	刘业伟
电话	95588	传真	(010) 66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

## (4) 中国农业银行

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 69 号		
法定代表人	项俊波	联系人	滕涛
电话	(010) 85108227	传真	(010) 85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

## (5) 交通银行

住所、办公地址	上海市银城中路 188 号		
法定代表人	胡怀邦	联系人	曹榕
电话	(021) 58781234	传真	(021) 58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

## (6) 中国民生银行

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街 2 号		
法定代表人	董文标	联系人	董云巍
电话	(010)58560666	传真	(010) 57092611
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

## (7) 中信银行

住所、办公地址	北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座		
法定代表人	田国立	联系人	丰靖
电话	(010) 65557083	传真	(010) 65550827
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

## (8) 深圳发展银行

住所、办公地址	深圳深南东路 5047 号深圳发展银行大厦		
法定代表人	肖遂宁	联系人	张青
电话	(0755) 82088888	传真	(0755) 82080406
网址	www.sdb.com.cn	客服电话	95501

## (9) 宁波银行

住所	宁波市鄞州区宁南南路 700 号		
办公地址	宁波市鄞州区宁南南路 700 号		
法定代表人	陆华裕	联系人	胡技勋
电话	(0574) 89068340	传真	(0574) 87050024
网址	www.nbcb.com.cn	客服电话	96528, 962528 上海、北京地区

## (10) 中国光大银行

注册地址	北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦		
法定代表人	唐双宁	联系人	朱红
电话	(010) 63636153	传真	010-683636157
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595

## (11) 东莞银行

住所、办公地址	东莞市城区运河东一路 193 号		
法定代表人	廖玉林	联系人	巫渝峰
电话	(0769) 22100193	传真	(0769) 22117730
客服电话	(0769) 96228		
网址	www.dongguanbank.cn		

## (12) 杭州银行

住所、办公地址	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦		
法定代表人	吴太普	联系人	严峻
电话	(0571) 85108309	传真	(0571) 85108309
客服电话	400-888-8508	网址	www.hzbank.com.cn

## (13) 上海农村商业银行

住所	上海市浦东新区浦东大道 981 号		
办公地址	上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层		
法定代表人	胡平西	联系人	吴海平
电话	(021) 38576977	传真	(021) 50105124
客服电话	(021) 962999	网址	www.srcb.com

## (14) 江苏银行

住所、办公地址	南京市洪武北路 55 号		
法定代表人	黄志伟	联系人	田春慧
电话	(025)58587018	传真	(025) 58587038
网址	www.jsbchina.cn	客服电话	(025) 96098、4008696098

## (15) 乌鲁木齐市商业银行

住所	乌鲁木齐市新华北路 8 号		
办公地址	乌鲁木齐市新华北路 8 号商业银行大厦		
法定代表人	农惠臣	联系人	何佳
电话	(0991) 8824667	传真	(0991) 8824667
网址	www.uccb.com.cn	客服电话	(0991) 96518

## (16) 洛阳银行

住所、办公地址	洛阳市洛龙区开元大道 256 号		
法定代表人	王建甫	联系人	胡艳丽
电话	(0379) 65921977	传真	(0379) 65920155
网址	www.bankofluoyang.com.cn	客服电话	(0379) 96699

## (17) 中信证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010) 60833722	传真	(010) 60833739
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

## (18) 国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路 618 号		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼		
法定代表人	万建华	联系人	芮敏祺
电话	(021) 38676666	传真	(021) 38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

**(19) 海通证券股份有限公司**

住所	上海淮海中路 98 号		
办公地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021) 23219000	传真	(021) 23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点 咨询电话

**(20) 申银万国证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市常熟路 171 号		
法定代表人	丁国荣	联系人	李清怡
电话	(021) 54033888	传真	(021) 54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	(021) 962505

**(21) 中国银河证券股份有限公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座		
法定代表人	顾伟国	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	(010) 66568536
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

**(22) 国都证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010) 84183389	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

**(23) 中信建投证券股份有限公司**

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
清算传真	(010) 65183880	业务传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

**(24) 兴业证券股份有限公司**

住所	福州市湖东路 268 号		
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层		
法定代表人	兰荣	联系人	谢高得
电话	(021) 38565785	传真	(021) 38565955
网址	www.xyzq.com.cn	客服电话	4008888123

**(25) 国盛证券有限责任公司**

住所	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦		
办公地址	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼		
法定代表人	曾小普	联系人	徐美云
电话	(0791) 86285337	传真	(0791) 86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

**(26) 东方证券股份有限公司**

住所	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层		
办公地址	上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	吴宇
电话	(021) 63325888	传真	(021) 63326173
网址	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

**(27) 平安证券有限责任公司**

注册地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755) 82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511—8

**(28) 招商证券股份有限公司**

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	(0755) 82943666	传真	(0755) 82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

**(29) 财富证券有限责任公司**

住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731) 84403319	传真	(0731) 84403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731) 84403360

**(30) 东吴证券股份有限公司**



住所、办公地址	苏州工业园区翠园路 181 号		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	(0512)65581136	传真	(0512) 65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	(0512)33396288

**(31) 中信万通证券有限责任公司**

住所	青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层 (1507-1510 室)		
办公地址	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层		
法定代表人	张智河	联系人	吴忠超
电话	(0532) 85022326	传真	(0532) 85022605
网址	www.zxwt.com.cn	客服电话	(0532) 96577

**(32) 山西证券股份有限公司**

住所、办公地址	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	(0351) 8686659	传真	(0351) 8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

**(33) 南京证券有限责任公司**

住所、办公地址	江苏省南京市大钟亭 8 号		
法定代表人	张华东	联系人	李铮
电话	(025) 83367888	传真	(025) 83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

**(34) 民生证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层		
法定代表人	岳献春	联系人	赵明
电话	(010) 85127622	传真	(010) 85127917
网址	www.msza.com	客服电话	400-619-8888

**(35) 渤海证券股份有限公司**

住所	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
办公地址	天津市南开区宾水西道 8 号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022) 28451861	传真	(022) 28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

**(36) 光大证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	徐浩明	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788, 10108998

**(37) 浙商证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼		
法定代表人	吴承根	联系人	许嘉行
电话	(0571) 87901912	传真	(0571) 87901913
网址	www.stocke.com.cn	客服电话	(0571) 967777

**(38) 国信证券股份有限公司**

注册地址	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	齐晓燕
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

**(39) 安信证券股份有限公司**

住所	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558355
网址	www.essence.com.cn	客服电话	4008001001

**(40) 长城证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层		
法定代表人	黄耀华	联系人	李春芳
电话	(0755) 83516089	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755) 33680000

**(41) 东北证券股份有限公司**

住所、办公地址	长春市自由大路 1138 号		
法定代表人	矫正中	联系人	潘锴
电话	(0431) 85096709	传真	(0431) 85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431) 85096733

**(42) 华泰证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦		
法定代表人	吴万善	联系人	孙菁菁
电话	025-83290537	传真	025- 51863323
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

**(43) 广发证券股份有限公司**

住所	广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316 房)		
办公地址	广东省广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼		
法定代表人	林治海	联系人	黄岚
电话	(020) 87555888	传真	(020) 87555305
网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

**(44) 长江证券股份有限公司**

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦		
法定代表人	胡运钊	联系人	李良
电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
客服电话	95579 或 4008-888-999		
网址	www.95579.com		

**(45) 华泰联合证券有限责任公司**

注册地址	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 (01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A		
办公地址	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层		
法定代表人	马昭明	联系人	盛宗凌、庞晓芸
电话	0755-82492000	传真	0755-82492962
网址	www.lhzq.com	客服电话	95513

**(46) 国元证券股份有限公司**

住所、办公地址	安徽省合肥市寿春路 179 号		
法定代表人	凤良志	联系人	陈玲玲
电话	(0551) 2246273	传真	(0551) 2272100
网址	www.gyzq.com.cn		
客服电话	95578		

**(47) 德邦证券有限责任公司**

住所	上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区福山路 500 号“城建国际中心”26 楼		
法定代表人	姚文平	联系人	罗芳
电话	(021) 68761616	传真	(021) 68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

**(48) 湘财证券有限责任公司**

住所地址	湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼		
办公地址	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼		
法定代表人	林俊波	联系人	钟康莺
电话	(021) 68634518	传真	(021) 68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

**(49) 东海证券有限责任公司**

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼		
法定代表人	朱科敏	联系人	李涛
电话	(0519) 88157761	传真	(0519) 88157761
网址	www.longone.com.cn	客服电话	400-888-8588

**(50) 中航证券有限公司**

住所、办公地址	江西省南昌市抚河北路 291 号		
法定代表人	杜航	联系人	戴蕾
电话	(0791) 86768681	传真	(0791) 86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

**(51) 宏源证券股份有限公司**

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街 19 号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010) 88085858	传真	(010) 88085195
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

**(52) 世纪证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳深南大道 7088 号招商银行大厦 40-42 层		
法定代表人	卢长才	联系人	方文
电话	(0755) 83199599	传真	(0755) 83199545
网址	www.csco.com.cn	客服电话	(0755) 83199511

**(53) 西部证券股份有限公司**

住所、办公地址	陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼		
法定代表人	刘建武	联系人	刘莹
电话	(029) 87416787	传真	(029) 87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

**(54) 国联证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省无锡市县前东街 168 号		
法定代表人	雷建辉	联系人	徐欣
电话	(0510) 82831662	传真	(0510) 82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	4008885288

**(55) 金元证券股份有限公司**

住所	海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层		
办公地址	深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层		
法定代表人	陆涛	联系人	马贤清
电话	(0755) 83025022	传真	(0755) 83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

**(56) 中信金通证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层		
法定代表人	刘军	联系人	王焱艺
电话	(0571) 85783750	传真	(0571) 85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571) 96598

**(57) 中银国际证券有限责任公司**

住所	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层		
办公地址	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 40 层		
法定代表人	许刚	联系人	李丹
传真	(021) 50372474	客服电话	4006208888
网址	www.bocichina.com.cn		

**(58) 恒泰证券股份有限公司**

住所、办公地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 111 号		
法定代表人	庞介民	联系人	王旭华
电话	(010) 66297386	传真	(0471) 4961259
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471) 4972343

**(59) 广州证券有限责任公司**

住所、办公地址	广州市先烈中路 69 号东山广场主楼十七楼		
法定代表人	刘东	联系人	林洁茹
电话	(020) 87322668	传真	(020) 87325036
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

**(60) 新时代证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街1号A座8层		
法定代表人	马金声	联系人	孙恺
电话	(010) 83561149	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

**(61) 上海证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	郁忠民	联系人	张瑾
电话	(021) 53519888	传真	(021) 53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518 4008918918

**(62) 中原证券股份有限公司**

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路10号		
法定代表人	石保上	联系人	程月艳 耿铭
电话	(0371) 65585670	传真	(0371) 65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	967218、4008139666

**(63) 华龙证券有限责任公司**

住所、办公地址	甘肃省兰州市静宁路308号		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	(0931) 4890208	传真	(0931) 4890628
客服电话	(0931) 4890208、 (0931) 4890619	网址	www.hlzqgs.com

**(64) 万联证券有限责任公司**

住所、办公地址	广州市中山二路18号电信广场36、37层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	(020) 37865070	传真	(020) 22373718-1013
网址	www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

**(65) 东莞证券有限责任公司**

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
法定代表人	张运勇	联系人	苏卓仁
电话	(0769) 22112062	传真	(0769) 22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769) 961130

**(66) 大同证券经纪有限责任公司**

住所	山西省大同市大北街 13 号		
办公地址	山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351) 4130322	传真	(0351) 4130322
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

**(67) 齐鲁证券有限公司**

住所	山东省济南市市中区经七路 86 号		
办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 68889155	传真	(0531) 68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

**(68) 国金证券股份有限公司**

住所、办公地址	成都市东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	(028) 86690126	传真	(028) 86690126
网址	www.gjzq.com.cn	客服电话	4006600109

**(69) 财通证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江杭州市解放路 111 号金钱大厦		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571) 87925129	传真	(0571) 87828042
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571) 96336、962336 (上海地区)

**(70) 第一创业证券有限责任公司**

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	(0755) 25832852	传真	(0755) 82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

**(71) 中国建银投资证券有限责任公司**

住所办公地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层		
办公地址	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 18 层至 21 层		
法定代表人	杨明辉	联系人	刘毅
电话	(0755) 82023442	传真	(0755) 82026539
网址	www.cjis.cn	客服电话	400-600-8008

**(72) 瑞银证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层		
法定代表人	刘弘	联系人	邱培玲
电话	(010) 58328366	传真	(010) 58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

**(73) 华鑫证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元		
法定代表人	王文学	联系人	杨小江
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
客服电话	(021) 32109999, (029) 68918888		
网址	www.cfsc.com.cn		

**(74) 中山证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	(0755) 82570586	传真	(0755) 82960582
网址	www.zszq.com.cn	客服电话	4001022011

**(75) 天相投资顾问有限公司**

注册地址	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701		
办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层		
法定代表人	林义相	联系人	林爽
电话	(010) 66045608	传真	(010) 66045500
客服电话	(010) 66045678		
天相投顾网址	<a href="http://www.txsec.com">http://www.txsec.com</a>		
天相基金网网址	<a href="http://jijin.txsec.com">http://jijin.txsec.com</a>		

**(76) 中国民族证券有限责任公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层		
法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	(010) 59355941	传真	(010) 66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

**(77) 厦门证券有限公司**

住所、办公地址	厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼		
法定代表人	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	(0592) 5161642	传真	(0592) 5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	(0592) 5163588



**(78) 江海证券有限公司**

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	张宇宏
电话	(0451) 82336863	传真	(0451) 82287211
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

**(79) 爱建证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市南京西路 758 号博爱大厦 20-25 楼		
法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888-3121	传真	(021) 62878783
客服电话	(021) 63340678	网址	www.ajzq.com

**(80) 华宝证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层		
法定代表人	陈林	联系人	毛雪梅
电话	(021) 50122222	传真	(021) 50122200
客服电话	4008209898	网址	www.cnhbstock.com

**(81) 方正证券股份有限公司**

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
法定代表人	雷杰	联系人	彭博
电话	(0731) 85832343	传真	(0731) 85832214
客服电话	95571	网址	www.foundersec.com

**(82) 英大证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	赵文安	联系人	王睿
电话	(0755) 83007069	传真	(0755) 83007167
客服电话	4008-698-698	网址	www.ydsc.com.cn

**(83) 西南证券股份有限公司**

住所、办公地址	重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢		
法定代表人	王珠林	联系人	陈诚
电话	(023) 63786464	传真	(023) 63786311
客服电话	4008096096	网址	www.swsc.com.cn

**(84) 日信证券有限责任公司**

住所	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	陈韦杉
电话	(010)88086830-730	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	(010) 88086830		

## (85) 华福证券有限责任公司

住所	福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层		
办公地址	福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	(0591) 87383623	传真	(0591) 87383610
客服电话	(0591) 96326	网址	www.hfzq.com.cn

## (86) 信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
法定代表人	张志刚	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
客服电话	400-800-8899	网址	www.cindasc.com

## (87) 东兴证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层		
法定代表人	徐勇力	联系人	汤漫川
电话	(010) 66555316	传真	(010) 66555246
客服电话	400-8888-993	网址	www.dxzq.net.cn

## (88) 华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 8 号		
办公地址	北京市西城区金融大街 8 号中国华融 A 座 3 层		
法定代表人	丁之锁	联系人	梁宇
电话	(010) 58568007	传真	(010) 58568062
客服电话	(010) 58568118	网址	www.hrsec.com.cn

## (二) 基金注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街 17 号		
法定代表人	金颖	联系人	任瑞新
电话	0755-25938095	传真	0755-25987538

## (三) 律师事务所和经办律师

名称	金杜律师事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环中路 7 号北京财富中心写字楼 A 座 40 层		
负责人	王玲	联系人	彭晋
电话	(010) 5878 5588	传真	(010) 5878 5566
经办律师	彭晋、龚牧龙		

**(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

名称	普华永道中天会计师事务所有限公司		
住所	上海市浦东新区东昌路 568 号		
办公地址	上海卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼		
法定代表人	杨绍信	联系人	陈宇
电话	(021) 23238888	传真	(021) 23238800
经办注册会计师	汪棣、陈宇		

## 第六部分 基金份额分级

### （一）基金份额结构

本基金的基金份额包括基础份额及分级份额。基础份额是基金组合份额，简称“嘉实多利基金份额”，分为场外份额和场内份额。分级份额包括两类，稳健收益类份额（简称“嘉实多利优先份额”）和积极收益类份额（简称“嘉实多利进取份额”）。嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的基金份额配比始终保持 8：2 的比例不变。

### （二）基金运作概要

- 1、本基金通过场外、场内两种方式公开发售嘉实多利基金份额。投资人场外认购所得的份额，将被确认为嘉实多利基金份额。投资人场内认购所得的份额，将按 8：2 的基金份额配比分拆为嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额。基金合同生效后，投资人认购所得的嘉实多利基金份额场内份额的分拆，由基金管理人委托注册登记机构进行，无需基金份额持有人申请。
- 2、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额与嘉实多利基金份额的资产合并投资运作。
- 3、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，对嘉实多利基金份额开放场外申购、赎回及场内申购、赎回，不对嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额单独开放场内申购、赎回。根据基金合同约定，在符合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下，嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额分别在深圳证券交易所上市与交易，交易代码不同。
- 4、基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理嘉实多利基金份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务，即：基金份额持有人，可将其场内申购的嘉实多利基金份额，按 8：2 的基金份额配比，申请分拆为嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额；或基金份额持有人，可将其持有的嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额，按 8：2 的基金份额配比，申请合并为嘉实多利基金份额的场内份额。场外的嘉实多利基金份额不进行份额配对转换。场外的嘉实多利基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内的嘉实多利基金份额配对转换规则进行操作。
- 5、基金合同生效后，本基金将按照基金合同规定，对嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额进行基金份额折算。除分级份额终止运作的份额折算（详见基金合同第二十二章的约定）外，基金份额折算后，本基金的运作方式、及嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额配比不变。

### （三）分级份额的份额净值计算概要

#### 1、嘉实多利基金份额与嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额之间的份额净值关系

本基金 8 份嘉实多利优先份额与 2 份嘉实多利进取份额构成一对份额组合，该份额组合的份额净值之和等于 10 份嘉实多利基金份额的份额净值之和。

#### 2、嘉实多利优先份额的份额净值计算

嘉实多利优先份额的约定收益率为 5%。嘉实多利优先份额的约定收益率除以 365 得到嘉实多利优先份额的约定日简单收益率。嘉实多利优先份额的份额净值，自基金合同生效日起至第 1 个基金份额折算日期间、或自上一个基金份额折算日（到期折算日或到点折算日）后的下一个日历日起至下一个基金份额折算日期间，以 1.0000 元为基准，采用嘉实多利优先份额的约定日简单收益率单利累计计算。

基金管理人不承诺也不保证嘉实多利优先份额的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实多利优先份额的基金份额持有人也可能损失本金。

#### 3、嘉实多利进取份额的份额净值计算

计算出嘉实多利优先份额的份额净值后，根据嘉实多利基金份额与嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额之间的份额净值关系，可以计算出嘉实多利进取份额的份额净值。

4、有关本基金分级份额的份额净值计算，详见基金合同第十八章第（五）条第 2 款的约定。

5、有关本基金基础份额与分级份额份额净值的公告，详见基金合同第二十四章第（六）条的约定。

### （四）基金份额折算概要

除分级份额终止运作的份额折算（详见基金合同第二十二章的约定）外，本基金的基金份额折算分为基金份额到期折算和基金份额到点折算。

#### 1、基金份额的到期折算和到点折算

##### （1）基金份额到期折算

基金合同生效日后第 12 个自然月的对应日（若该对应日不是工作日，则顺延至下一个工作日），是第一个到期折算日。自第一个到期折算日起，每个到期折算日后第 12 个自然月的对应日（若该对应日不是工作日，则顺延至下一个工作日），是后续的到期折算日。以到期折算日为基准日实施的基金份额折算，是基金份额到期折算。到期折算日的具体日期，

详见基金管理人届时发布的公告。

基金份额到期折算的频率为：自基金合同生效后，每满一年，进行一次。

## （2）基金份额到点折算

如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。以到点折算日为基准日实施的基金份额折算，为基金份额到点折算（如果发生极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于或等于 1.0000 元，本基金不实施到点折算）。到点折算日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

基金份额到点折算的频率为不定期。

## 2、到期折算和到点折算方法概要

### （1）基金份额到期折算

1) 如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元，则：

- ① 折算前的嘉实多利基金份额持有人，以每 10 份嘉实多利基金份额，按 8 份嘉实多利优先份额的约定收益及 2 份嘉实多利进取份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算增加；
- ② 折算前的嘉实多利优先份额持有人，以嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额；
- ③ 折算前的嘉实多利进取份额持有人，以嘉实多利进取份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额。

2) 如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，则：

- ① 折算前的嘉实多利基金份额持有人，以每 10 份嘉实多利基金份额，按 8 份嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的分配：折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额净值折算减少、份额数量相应折算增加；

- ② 折算前的嘉实多利优先份额持有人，以嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额；
- ③ 折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额的份额净值、及份额数量不变。

#### (2) 基金份额到点折算

如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日（如果发生极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净大于或等于 1.0000 元，本基金不实施到点折算）。到点折算后：

- ① 折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整；
- ② 折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量折算调整，相应折算增加嘉实多利基金份额；
- ③ 折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整。
- ④ 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的基金份额配比保持 8：2 的比例不变。

### 3、分级份额终止运作后的份额折算

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额将全部折算成场内嘉实多利基金份额。

有关本基金基金份额折算，详见基金合同第二十一章、第二十二章的约定。

## 第七部分 基金的募集

### （一）基金募集的依据

本基金由管理人依照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，并经中国证监会 2011 年 2 月 9 日《关于核准嘉实多利分级债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2011]180 号）核准募集。

### （二）基金运作方式和类型：契约型开放式、债券型证券投资基金。

### （三）基金存续期：不定期

### （四）上市交易所：深圳证券交易所

### （五）基金份额的募集期限、募集方式及场所、募集对象、募集目标

1. 募集期限：自2011年2月24日起至2011年3月17日止

#### 2. 募集方式：

本基金通过场外、场内两种方式公开发售。在基金募集阶段，本基金以同一个基金份额代码在场内和场外募集。

通过场外认购的基金份额登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下；通过场内认购的基金份额登记在证券登记结算系统基金份额持有人证券账户下。

#### 3. 募集场所：

本基金的场外认购通过基金管理人直销机构、代销机构办理基金销售业务的营业场所办理或按基金管理人直销机构、代销机构提供的其他方式办理。

本基金的场内认购通过深圳证券交易所内具有基金代销业务资格的会员单位进行。

#### 4. 募集对象：

符合法律法规规定的个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

#### 5. 募集目标

本基金首次募集规模目标不超过50亿元（不包括募集期利息），其中首次募集场内份额对应的基金规模目标不超过15亿元（不包括募集期利息）。

《基金合同》生效后，基金规模不受上述首次募集规模的限制。



## （六）基金的初始发售面值、认购价格和认购费用

- 1、嘉实多利基金份额的初始面值：人民币 1.00 元
- 2、嘉实多利基金份额的认购价格：人民币 1.00 元
- 3、认购费用

本基金认购费率不超过 5%，按照认购金额递减，即认购金额越大，所适用的认购费率越低。投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

场外认购嘉实多利基金份额，场外认购费率如下：

认购金额（含认购费）	认购费率
M < 100 万元	0.6%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.4%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.2%
M ≥ 500 万元	按笔收取，每笔 1000 元

场内认购嘉实多利基金份额，场内认购费率由销售机构参照场外认购费率执行。

认购费用用于本基金直销和代销时发生的开支，包括市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金财产。

### 4、认购份额的计算

#### （1）场外认购嘉实多利基金份额

场外认购嘉实多利基金份额，采用金额认购方法，计算公式如下：

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 + 认购金额利息) / 嘉实多利基金份额面值

场外认购份额计算结果保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

#### （2）场内认购基金份额的计算

嘉实多利基金份额的场内认购采用份额认购方法，投资人认购基金份额采用全额缴款的认购方式。

净认购金额 = 挂牌价格 × 认购份额

认购费用 = 挂牌价格 × 认购份额 × 认购费率

认购金额 = 净认购金额 + 认购费用

利息折算为嘉实多利基金份额，计算公式如下：

利息折算的嘉实多利基金份额 = 利息 / 挂牌价格

经确认的嘉实多利基金份额和利息折算的嘉实多利基金份额取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

#### （3）多笔认购时，按上述（1）或（2）进行逐笔计算。

### （七）募集资金利息的处理方式

认购款项在募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息以注册登记机构的计算并确认的结果为准。

### （八）基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

## 第八部分 基金合同的生效

### （一）基金合同生效

本基金基金合同自 2011 年 3 月 23 日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

### （二）基金存续期内的基金份额持有人数量和资金数额

本基金合同生效后的存续期内，基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当及时报告中国证监会；基金份额持有人数量连续 20 个工作日达不到 200 人，或连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人应当向中国证监会说明出现上述情况的原因并提出解决方案。

## 第九部分 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市与交易

### （一）上市交易的地点

深圳证券交易所

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市后，登记在中国证券登记结算有限公司深圳分公司场内证券登记结算系统中的嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额可直接在深圳证券交易所上市交易；登记在中国证券登记结算有限公司注册登记（TA）系统中的嘉实多利基金份额通过办理跨系统转托管业务将嘉实多利基金份额转至场内证券登记结算系统并分拆成嘉实多利优

先份额与嘉实多利进取份额后，方可上市交易。

## （二）上市交易的时间：2011年5月6日

## （三）上市交易的规则

1、上市首日，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的开盘参考价为前一交易日嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的份额净值；

2、嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额的首个开盘参考价（即时行情显示的前收盘价）为其前一交易日的嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额的份额净值；

3、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易遵循《深圳证券交易所交易规则》及相关规定。

## （四）上市交易的费用

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易的费用，按照深圳证券交易所上市开放式基金的有关规定办理。

## （五）上市交易的行情揭示

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额在深圳证券交易所挂牌交易，交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同时揭示嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额前一交易日的份额净值。

## （六）上市交易的停复牌、暂停上市、恢复上市

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的停复牌、暂停上市、恢复上市按照深圳证券交易所的相关规定执行。

## （七）终止上市的情形和处理方式

发生下列情况之一时，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额应同时终止上市交易：

- （1）自暂停上市之日起半年内未能消除暂停上市原因的；
- （2）基金合同终止；
- （3）基金份额持有人大会决定终止上市；
- （4）深圳证券交易所认为须终止上市的其他情况。

发生上述终止上市情形时，基金管理人报经中国证监会备案后终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市，并在至少一种指定报刊和网站上刊登终止上市公告。

(八) 相关法律法规、中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的，本基金基金合同相应予以修改。且此项修改无须召开基金份额持有人大会审议决定，基金管理人将在本基金更新的招募说明书中列示修改的内容。

## 第十部分 嘉实多利基金份额的场外申购、赎回与转换

本章内容仅适用于嘉实多利基金份额的场外申购、赎回和转换业务。

### (一) 场外申购、赎回业务办理的场所

场外嘉实多利基金份额的申购与赎回将通过销售机构进行。

### (二) 场外申购、赎回的开放日及时间

#### 1、开放日及开放时间

自 2011 年 5 月 6 日起开始办理嘉实多利基金份额的日常申购和赎回业务。

嘉实多利基金份额的申购、赎回的开放日为证券交易所交易日（基金管理人公告暂停申购或赎回时除外），投资人应当在开放日办理申购和赎回申请。办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。开放日的具体业务办理时间见发售公告。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

### (三) 场外申购、赎回的原则

(1) “未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的嘉实多利基金份额净值为基准进行计算；

(2) “金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

(3) 当日的申购与赎回申请可以在基金管理人规定的时间以内撤销；

(4) 基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

#### **(四) 场外申购、赎回的程序**

##### **1、申购和赎回的申请方式**

投资人必须根据销售机构规定的程序，在开放日的具体业务办理时间内提出申购或赎回的申请。

投资人在提交申购嘉实多利基金份额的申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金, 投资人在提交赎回申请时，必须有足够的嘉实多利基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

##### **2、申购和赎回申请的确认**

注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

基金销售机构受理投资者的申购、赎回申请并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

##### **3、申购和赎回的款项支付**

申购采用全额缴款方式。若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功，若申购不成功或无效，申购款项将退回投资人账户。

投资者T日赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本《基金合同》的有关条款处理。

#### **(五) 场外申购、赎回的限制**

##### **1. 申请申购基金的金额**

投资人通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币5,000元，投资人通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元（已通过本基金代销机构或/及直销中心认购本基金者除外）；追加申购单笔最低限额为人民币1,000元。

投资人将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

投资人可多次申购，对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

## 2. 申请赎回基金的份额

单笔赎回不得少于1,000份（如该帐户在该销售机构托管的基金余额不足1,000份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔份额减少类业务将导致投资人在销售机构托管的基金余额不足1,000份时，基金管理人有权将投资人在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。（份额减少类业务指赎回、转换转出、非交易过户、转托管等业务，具体种类以注册登记机构相关业务规则为准。）

3. 基金管理人可根据市场情况，调整对申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须于调整前最少提前两日在中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

## （六）场外申购费率与赎回费率

### 1、申购费率：

基金合同约定，嘉实多利基金份额的申购费率最高不超过申购金额的5%。

除本募集说明书或基金管理人有关公告另有约定外，嘉实多利基金份额场外申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的场外申购费率越低。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费）	场外申购费率
M<100万元	0.8%
100万元≤M<200万元	0.5%
200万元≤M<500万元	0.3%
M≥500万元	按笔收取，每笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购开放式基金业务，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。但招商银行借记卡、中国建设银行龙卡、中国农业银行金穗卡、中国工商银行借记卡的持卡人申购本基金的申购费率优惠按照相关公告

规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。

基金招募说明书及相关公告规定的相应申购费率低于0.6%时，按实际费率收取申购费。

## 2、赎回费率

基金合同约定，嘉实多利基金份额的赎回费率最高不超过赎回金额的5%。

本基金在投资人赎回嘉实多利基金份额时收取赎回费。嘉实多利基金份额的场外赎回费率按照持有时间递减，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。具体如下：

持有期限	场外赎回费率
H<30 天	0.30%
30 天≤H<730 天	0.05%
H≥730 天	0

嘉实多利基金份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金财产。

3、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、或调低赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施两个工作日前中国证监会指定的媒体上刊登公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## （七）场外申购份额、赎回金额的计算公式

### 1、场外申购份额的计算

嘉实多利基金份额的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{申购当日嘉实多利基金份额净值}$$

场外申购的嘉实多利基金份额有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日嘉实多利基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到小数点后2位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例如，某投资人投资 50,400 元场外申购嘉实多利基金份额，对应场外申购费率为 0.8%，假设申购当日嘉实多利基金份额净值为 1.0800 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,400.00 / (1 + 0.8\%) = 50,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,400.00 - 50,000.00 = 400.00 \text{ 元}$$

申购份数=50,000.00/1.0800=46,296.30 份

即：该投资人可得到 46,296.30 份嘉实多利基金份额。

## 2、场外赎回金额的计算

本基金的净赎回金额为赎回总金额扣减赎回费用。其中，

赎回总金额=赎回份额×赎回当日嘉实多利基金份额净值

赎回费用=赎回总金额×赎回费率

净赎回金额=赎回总金额-赎回费用

场外嘉实多利基金份额的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日嘉实多利基金份额净值为基准计算并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例如：某基金份额持有人赎回其持有的 10,000 份嘉实多利基金份额场外份额，持有时间是 60 天，对应的赎回费率为 0.05%，假设赎回当日嘉实多利基金份额净值是 1.2100 元，则可得到的净赎回金额为：

赎回总金额=10,000×1.2100=12,100 元

赎回费用=12,100×0.05%=6.05 元

净赎回金额=12,100-6.05=12,093.95 元

即：该基金份额持有人可得到的净赎回金额为 12,093.95 元。

3、T 日的嘉实多利基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。嘉实多利基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将嘉实多利基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

## （八）场外申购、赎回的注册登记

投资人场外申购嘉实多利基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日自动为投资人登记权益并办理注册登记手续，投资人自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分嘉实多利基金份额。

投资人场外赎回嘉实多利基金份额成功后，注册登记机构在 T+1 日自动为投资人办理扣除权益的注册登记手续。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资人的合法权益，并最迟于开始实施前 2 日在至少一家指定媒体及基金管理人网站公告。

## （九）拒绝或暂停接受申购申请的情形及处理方式

发生下列情况之一时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购嘉实多利基金份额或嘉



实多利基金份额转入申请：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (4) 基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时；
- (5) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情形；
- (6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述除第(4)小项外的暂停申购情形且基金管理人决定暂停或拒绝申购时，基金管理人应当根据有关规定在指定媒体上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。

#### (十) 暂停赎回或者延缓支付赎回款项的情形及处理方式

发生下列情形之一时，基金管理人可暂停接受投资人的赎回申请或延缓支付赎回款项：

- (1) 因不可抗力导致基金无法正常工作；
- (2) 证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；
- (3) 连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；
- (4) 发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；
- (5) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构或注册登记机构因技术故障或异常情况导致基金销售系统、基金会计系统、注册登记系统或证券结算登记系统无法正常运行；
- (6) 法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形且基金管理人决定暂停基金份额持有人的嘉实多利基金份额赎回申请或者延缓支付赎回款项时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，已接受的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付，并以后续开放日的嘉实多利基金份额净值为依据计算赎回金额。若连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，延期支付最长不得超过 20 个工作日，并在指定媒体上公告。投资人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并予以公告。

## （十一）巨额赎回的情形及处理方式

### 1、巨额赎回的认定

若本基金单个开放日，基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一开放日基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。

### 2、巨额赎回的处理方式

当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

①全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

②部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定单个基金份额持有人当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的嘉实多利基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

③暂停赎回：连续2日以上（含本数）发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受嘉实多利基金份额的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在指定媒体上进行公告。

3、巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并顺延赎回时，基金管理人应在2日内通过指定媒体及基金管理人的公司网站或代销机构的网点刊登公告，并在公开披露日向中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。同时以邮寄、传真或《招募说明书》规定的其他方式通知基金份额持有人，并说明有关处理方法。

## （十二）暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告

1、发生上述暂停申购或赎回情况的，基金管理人当日应立即向中国证监会备案，并在规定期限内指定媒体上刊登暂停公告。

2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在指定媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的嘉实多利基金份额净值。

3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周，暂停结束，嘉实多利基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上刊登嘉实多利基金份额重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的嘉实多利基金份额净值。

4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，基金管理人应每2周至少刊登暂停公告1次；当连续暂停时间超过2个月时，刊登暂停公告的频率由基金管理人视情况调整。暂停结束，嘉实多利基金份额重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前2日在指定媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的嘉实多利基金份额净值。

## （十三）基金的转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金嘉实多利基金份额与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。

## （十四）定期定额投资计划

2011年5月6日起基金管理人开始为投资人办理嘉实多利基金份额的定期定额投资计划，具体规则请参见基金管理人网站发布的相关公告。投资人在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款日、扣款金额，每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

# 第十一部分 嘉实多利基金份额的场内申购与赎回

本章内容仅适用于本基金通过深圳证券交易所会员单位办理的场内嘉实多利基金份额的申

购和赎回业务。基金管理人不对嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额单独开放申购、赎回业务。

#### （一）场内申购和赎回的办理场所

投资者办理嘉实多利基金份额场内申购和赎回业务的场所，为具有基金代销业务资格且符合深圳证券交易所风险控制要求的深圳证券交易所会员单位

#### （二）申购与赎回的账户

投资人通过场内申购、赎回应使用中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的人民币普通股账户或证券投资基金账户（账户开立的具体事项参见本基金份额发售公告认购开户相关内容）。

#### （三）场内申购和赎回的开放日及开放时间

自 2011 年 5 月 6 日起开始办理场内嘉实多利基金份额的日常申购和赎回业务。

场内嘉实多利基金份额的申购赎回开放日为深圳证券交易所的工作日。业务办理时间为深圳证券交易所交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。在基金合同约定时间外提交的申请按下一交易日申请处理。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前 2 日在指定媒体上公告。

#### （四）场内申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，申购、赎回价格以申请当日收市后计算的嘉实多利基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请。申购和赎回申报单位以深圳证券交易所的规定为准；

3、当日嘉实多利基金份额的申购与赎回申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并不影响基金份额持有人实质利益的前提下调整上述原则。基金管理人必须在新规则开始实施前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体及基金管理人网站公告并报中国证监会备案。

## （五）场内申购和赎回的程序

### 1、申购和赎回的申请方式

投资人需遵循深圳证券交易所场内申购赎回相关业务规则，在开放日的业务办理时间内提出申购或赎回申请。投资人在申购嘉实多利基金份额时须按业务办理单位规定的方式备足申购资金。基金份额持有人在提交赎回申请时，应确保账户内有足够的嘉实多利基金份额余额，否则赎回申请无效。

### 2、申购和赎回申请的确认

注册登记机构以交易时间结束前收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日（T日），并在T+1日内对该交易的有效性进行确认。通常情况下，T日提交的有效申请，投资人应在T+2日后（包括该日）到场内申购、赎回业务办理单位或以其规定的其他方式查询申购、赎回申请的确认情况。

基金销售机构受理投资者的申购、赎回申请并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到该申请。申购、赎回的确认以注册登记机构或基金管理公司的确认结果为准。

### 3、申购和赎回的款项支付

申购采用全额缴款方式，若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资人账户。

投资人赎回申请成功后，基金管理人将通过基金注册登记机构及其相关基金销售机构在T+7日（包括该日）内将赎回款项划往基金份额持有人账户。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照本《基金合同》的有关条款处理。

## （六）场内申购和赎回的数额限制

1、投资人通过业务办理单位场内申购本基金，单笔最低申购金额为 5,000 元。

2、基金管理人、深圳证券交易所或注册登记机构可根据市场情况，在不违反相关法律法规规定的前提下，调整上述限制。基金管理人必须在调整前 2 日至少在一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

## （七）场内申购和赎回的费用

### 1、申购费率：

基金合同约定，嘉实多利基金份额的申购费率最高不超过申购金额的5%。

嘉实多利基金份额场内申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的场内申购

费率越低。投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

申购金额（含申购费）	场内申购费率
M<100万元	0.8%
100万元≤M<200万元	0.5%
200万元≤M<500万元	0.3%
M≥500万元	按笔收取，每笔1000元

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金财产。

## 2、赎回费率

基金合同约定，嘉实多利基金份额的赎回费率最高不超过赎回金额的5%。

本基金在投资人赎回嘉实多利基金份额时收取赎回费。嘉实多利基金份额的场内赎回费率统一为0.3%。

嘉实多利基金份额的赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金财产。

3、如果投资人过于频繁申购、赎回本基金，可能以各种形式损害基金份额持有人的利益，例如：导致基金的交易费用或变现成本增加，减少长期持有人的回报，或使得基金管理人无法顺利实施投资策略等，则本基金对上述过于频繁交易的申购、赎回可以采取特殊的申购费率、或赎回费率，也可以采取特殊的收费方式。

4、基金管理人可以在法律法规和本基金合同规定范围内调整申购费率、或调低赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施两个工作日前中国证监会指定的媒体上刊登公告。

5、基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资人以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## （八）场内申购份额和赎回金额的计算

### 1、场内申购份额的计算

净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

申购费用 = 申购金额 - 净申购金额

申购份额 = 净申购金额 / 申购当日嘉实多利基金份额净值

场内申购的嘉实多利基金份额有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以

当日嘉实多利基金份额净值为基准计算，申购份额计算结果保留到整数位，整数位后小数部分的份额对应的资金返还至投资人资金账户。

例如，某投资人投资 50,400 元场内申购嘉实多利基金份额，对应场内申购费率为 0.8%，假设申购当日嘉实多利基金份额净值为 1.0800 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{净申购金额} = 50,400.00 / (1 + 0.8\%) = 50,000.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购费用} = 50,400.00 - 50,000.00 = 400.00 \text{ 元}$$

$$\text{申购份数} = 50,000.00 / 1.0800 = 46,296.30 \text{ 份}$$

因场内申购份额保留至整数份，故投资人申购所得份额为 46,296 份，整数位后小数部分的申购份额对应的资金返还给投资人。具体计算公式为：

$$\text{实际净申购金额} = 46,296 \times 1.0800 = 49,999.68 \text{ 元}$$

$$\text{退款金额} = 50,400.00 - 400.00 - 49,999.68 = 0.32 \text{ 元}$$

即：该投资人可得到嘉实多利基金份额的场内份额 46,296 份，退款 0.32 元。

## 2、场内赎回金额的计算

$$\text{赎回总金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日嘉实多利基金份额净值}$$

$$\text{赎回费用} = \text{赎回总金额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{净赎回金额} = \text{赎回总金额} - \text{赎回费用}$$

场内嘉实多利基金份额的赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日嘉实多利基金份额净值为基准计算并扣除相应的费用，赎回金额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

例如：某基金份额持有人赎回其持有的 10,000 份嘉实多利基金份额场内份额，持有时间是 60 天，对应的赎回费率为 0.3%，假设赎回当日嘉实多利基金份额净值是 1.2100 元，则可得到的净赎回金额为：

$$\text{赎回总金额} = 10,000 \times 1.2100 = 12,100 \text{ 元}$$

$$\text{赎回费用} = 12,100 \times 0.3\% = 36.30 \text{ 元}$$

$$\text{净赎回金额} = 12,100 - 36.30 = 12,063.70 \text{ 元}$$

即：该基金份额持有人可得到的净赎回金额为 12,063.70 元。

3、T 日的嘉实多利基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。嘉实多利基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

基金管理人每个开放日对基金资产估值后，将嘉实多利基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

### （九）场内申购与赎回的注册登记

场内嘉实多利基金份额的申购、赎回的注册登记按照注册登记机构的有关规定办理。

（十）办理嘉实多利基金份额场内申购、赎回业务应遵守深圳证券交易所及注册登记机构的有关业务规则。若相关法律法规、中国证监会、深圳证券交易所或注册登记机构对场内申购、赎回业务规则有新的规定，按新规定执行。

（十一）有关拒绝或暂停申购、暂停赎回及处理方式、重新开放申购或赎回的公告、巨额赎回的情形及处理方式、定期定额投资计划等，请参见基金合同中关于“场外申购和赎回”部分的相关规定以及深圳证券交易所的有关规定，并据此执行。

## 第十二部分 场内份额配对转换

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的嘉实多利基金份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务。

### （一）场内份额配对转换

1、场内份额配对转换：指根据基金合同约定，场内的基础份额与分级份额之间进行转换的行为，包括分拆与合并。

2、分拆：指根据基金合同约定，场内的嘉实多利基金份额按照 8：2 的基金份额配比分拆成嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的行为。

3、合并：指根据基金合同约定，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额按照 8：2 的基金份额配比合并成嘉实多利基金份额场内份额的行为。

4、场外的嘉实多利基金份额不进行份额配对转换。在场外嘉实多利基金份额通过跨系统转托管至场内后，可按照场内份额配对转换规则进行操作。

### （二）业务办理机构

基金份额持有人可以通过依据中登有关规定获得业务办理资格的深圳证券交易所会员单位办理份额配对转换业务。在场内份额配对转换业务办理机构的营业场所或按其提供的其他方式，



办理场内份额配对转换。

### （三）业务办理时间

自2011年5月6日起，开通嘉实多利分级债券型证券投资基金的份额配对转换业务。

### （四）场内份额配对转换的原则

- 1、场内份额配对转换以份额申请。
- 2、如果申请场内份额的分拆，嘉实多利基金份额的场内份额数，必须是相关业务公告规定份额的正整数倍。
- 3、如果申请场内份额的合并，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额必须同时配对申请，且嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍、份额数配比为8:2。
- 4、嘉实多利基金份额的场外份额如需申请进行场内份额的分拆，须跨系统转托管为嘉实多利基金份额的场内份额后方可进行。
- 5、场内份额配对转换，应遵循届时相关机构发布的相关业务规则。

基金管理人、注册登记机构或深圳证券交易所可视情况对上述规定作出调整，并在正式实施前在至少一家指定媒体公告。

### （五）业务办理程序

1、投资者以中登深圳分公司A股账户或证券投资基金账户（以下简称“深市证券账户”）申报份额配对转换业务中的“分拆”或“合并”指令，申报前需备足对价，即投资者提出“合并”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的多利优先与多利进取基金份额；投资者提出“分拆”申请时，其所申报的深市证券账户上须有足够的、可交易的嘉实多利分级债券份额。

2、投资者通过业务办理机构提出份额配对转换申请的，统一以嘉实多利分级债券的交易代码“160718”作为申请指令的证券代码，以份额为单位进行“合并”或“分拆”申报。

3、“合并”或“分拆”每笔申请的份额数必须是10份的整数倍，并且，投资者在业务办理机构提交的每笔申请份额不得低于1,000份。

基金管理人可根据市场情况调整“合并”或“分拆”每笔申报的最低份额数量限制，基金管理人必须在调整生效前依照有关规定进行公告。

4、如果申请场内份额的合并，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额必须同时配对申请，且嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额数必须分别为相关业务公告规定份额的正整数倍、份额数配比为8:2。

5、办理份额配对转换业务的深圳证券交易所会员单位应对投资者每笔“分拆”或“合并”申请的可用份额数量进行检查并对相应基金份额进行预冻结。

6、在交易时间内，份额配对转换业务办理机构通过深证通FDEP消息传输系统将份额配对转换申报指令发送给中登的基金业务系统。正常情况下，中登深圳分公司在T日收市后对投资者T日交易时间内提交的份额配对转换业务申请进行有效性确认，并进行份额变更处理，办理转出基金份额的扣除以及转入基金份额的登记。自T+1日起（包括该日）投资者可查询基金份额配对转换的成交情况。

7、投资者T日提出的M份份额“分拆”申请被确认成功后，中登深圳分公司将在投资者所申报的深市证券账户上扣减M份嘉实多利分级债券，同时增加8M/10份多利优先与2M/10份多利进取。正常情况下，自T+1日（含该日）起新增的多利优先与多利进取份额可进行交易。

8、投资者T日提出的N份份额“合并”申请被确认成功后，中登深圳分公司将在投资者所申报的深市证券账户上扣减8N/10份多利优先和2N/10份多利进取，同时增加N份嘉实多利分级债券。正常情况下，自T+1日（含该日）起新增的嘉实多利分级债券份额可进行赎回等交易。

9、嘉实多利分级债券的场外份额如需申请进行“分拆”，须跨系统转托管为嘉实多利分级债券的场内份额后方可进行。

10、投资者提出的份额配对转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后不得撤销。

11、份额配对转换应遵循届时发布的相关业务规则。

#### （六）暂停场内份额配对转换的情形

- 1、深圳证券交易所、注册登记结算机构、业务办理机构因异常情况无法办理该业务的情形。
- 2、基金管理人根据本基金届时投资运作、交易的实际情形可决定是否暂停接受配对转换。
- 3、法律法规、深圳证券交易所规定或经中国证监会认定的其他情形。

发生前述情况之一的，基金管理人应在至少一家指定媒体及基金管理人网站就暂停场内份额配对转换业务予以公告。

当恢复场内份额配对转换业务时，基金管理人也将在至少一家指定媒体及基金管理人网站

予以公告。

### （七）业务办理费用

投资者申请办理份额配对转换业务时，份额配对转换业务办理机构暂不收取业务办理费用。

## 第十三部分 基金份额的登记、转托管、非交易过户、冻结与解冻

### （一）基金份额的登记

1、本基金的份额采用分系统登记的原则。场外认购或申购的嘉实多利基金份额，登记在注册登记系统中持有人的开放式基金账户下；场内认购、申购的嘉实多利基金份额，或上市交易的嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额，登记在证券登记结算系统持有人证券账户下。

2、登记在证券登记结算系统中的嘉实多利基金份额，可以直接申请场内赎回，但不在深圳证券交易所上市交易，登记在证券登记结算系统中的嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额在深圳证券交易所上市交易，不能直接申请场内赎回，但可按8：2的份额数配比申请合并为嘉实多利基金份额的场内份额后，再申请场内赎回。

3、登记在注册登记系统中的嘉实多利基金份额，既可以直接申请场外赎回，也可以在办理跨系统转托管后，转至证券登记结算系统，由基金份额持有人申请，按8：2的份额数配比分拆为嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额，在深圳证券交易所上市。

### （二）基金份额的转托管

基金份额的转托管包括系统内转托管和跨系统转托管。自2011年5月6日起，本基金管理人开通办理本基金嘉实多利分级债券份额（基金代码：160718，场内简称：嘉实多利）的系统内转托管和跨系统转托管业务。

#### 1、系统内转托管

（1）系统内转托管是指，基金份额持有人将持有的嘉实多利基金份额在注册登记系统内不同销售机构（网点）之间或证券登记结算系统内不同会员单位（交易单元）之间进行转登记的行为。

（2）基金份额登记在在注册登记系统的基金份额持有人，在变更办理嘉实多利基金份额赎回业务的销售机构（网点）时，可办理已持有嘉实多利基金份额的系统内转托管。

(3) 基金份额登记在证券登记结算系统的基金份额持有人，在变更办理嘉实多利基金份额场内赎回、或嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额上市交易的会员单位（交易单元）时，可办理已持有基金份额的系统内转托管。

## 2、跨系统转托管

(1) 跨系统转托管是指，基金份额持有人将持有的嘉实多利基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管的行为。

(2) 本基金跨系统转托管的具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司及深圳证券交易所的相关规定办理。

基金销售机构可以按照相关规定，向基金份额持有人收取转托管费。

## （三）基金的非交易过户

注册登记机构及深圳证券交易所可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户业务，并收取一定的手续费用。

## （四）基金的冻结和解冻

基金注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的嘉实多利基金份额的冻结与解冻，以及注册登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。嘉实多利基金份额的冻结手续、冻结方式按照基金注册登记机构的相关规定办理。

注册登记机构及深圳证券交易所可依据其业务规则，受理基金份额的冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（五）如法律法规、注册登记机构或深圳证券交易所的有关规则发生变化，本基金的非交易过户、转托管、冻结与解冻的有关规则将相应调整。

## 第十四部分 基金的投资

### （一）投资目标

本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，力争持续稳定增值。

### （二）投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、政府机构债、地方政府债、政策性金融债、商业银行金融债、非银行金融机构金融债、资产支持证券、央行票据、债券回购、银行存款等固定收益类资产。本基金可以投资所有一级、二级市场股票等权益类资产、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具或金融衍生工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合的资产配置范围为：债券（含可转换债券）等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

### （三）投资理念

本基金利用多元化的低风险赢利模式，在控制基金组合下行波动幅度和保持适当流动性的前提下，追求收益最大化。

### （四）投资策略

为持续稳妥地获得高于存款利率的收益，本基金首先运用“嘉实下行风险波动模型”，控制基金组合的年下行波动风险。在此前提下，本基金综合分析宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等，挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。

## 1、嘉实下行风险波动模型

嘉实下行风险波动模型从组合层面以及个券层面分别度量组合潜在的下行风险，并根据宏观环境以及证券市场表现，设置一定的阈值，将组合的可能亏损控制在低风险偏好投资人可接受的范围内。

在组合层面，本基金将使用下方波动率、CVAR（条件在险价值）等指标，结合情景分析和压力测试的方法，评价组合在未来一段时间发生亏损的可能性，以及可能遭受的亏损金额。

在个券层面，本基金将对股票等权益类资产和债券等固定收益类资产，采用不同的分析方法。对股票等权益类资产，本基金通过不同板块的估值情况以及历史波动率等指标，限制组合在高估值以及历史波动率过高的股票的投资比例。对债券等固定收益类资产，本基金将通过凸度分析法，将债券的凸度与宏观环境相联系，当预期未来进入加息通道、债券市场收益率水平持续上移时，本基金根据期限结构和类属配置目标，通过凸性分析选择波动特性最优的债券，从而降低组合可能面临的下行风险。

## 2、资产配置

本基金根据对宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等方面的动态分析，在限定资产配置范围内，决定债券等固定收益类资产和股票等权益类资产的配置比例、并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期对大类资产配置比例进行调整。

本基金采取“总收益策略”（Total Return Strategy），以信用较好的中短期债券为核心资产配置，运用定性定量模型，动态分析比较本基金投资范围内的各子市场中的风险收益特征，以满足基金组合下行波动风险既定阈值和流动性需求的条件下收益最大化为目标，在各类投资工具中优化选择，配置和调整组合的卫星资产。从而，本基金在谋求持续稳定收益的基础上，顺应证券市场变化，以低风险偏好投资人可接受的安全边际，力争在投资利率或信用工具中，或在少量择机投资股票等权益类资产中，或在各类工具套利投资中，持续获得增强收益。

## 3、债券投资策略

### （1）构建组合

本基金以信用较好的中短期债券为主，构建本基金组合的核心资产配置。

本基金在单个债券选择上，首先，根据个券的剩余期限、久期、信用等级、流动性指标，决定是否将该债券纳入组合的债券备选池；其次，根据个券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）与剩余期限的配比，对照本基金的收益要求决定是否纳入组合；

最后，根据个券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定个券的投资总量。

## （2）嘉实债券组合风险控制措施

在利率风险控制上，本基金主要从组合层面、个券层面、及交易场所选择等方面，防范和控制价格波动风险。在组合层面，本基金根据对市场利率变动趋势的主动预测及模型测试，调整和控制组合久期。在个券层面，本基金通过凸性分析，在债券备选池中选择波动特性较优的单个债券。在交易场所选择上，本基金根据对影响流动性因素的动态分析，适当控制在同一交易场所上市交易、且现券价格波动幅度较大的现券资产的配置比例。此外，在预测利率走势、控制基金资产净值波动幅度、保持组合适当流动性的基础上，本基金优化组合的期限结构，以适当降低机会成本风险和再投资风险。

在信用风险控制上，本基金根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级，依靠嘉实信用分析团队、及嘉实中央研究平台的其他资源，深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况，严格遵守嘉实信用分析流程、执行嘉实信用投资纪律。

在流动性风险控制上，日常运作中，本基金优先由现金和到期的短期债券逆回购提供一级流动性保障；由现券或个股提供二级流动性保障，本基金通过适当配置流动性较好的类属品种、控制个券信用等级、分散化组合投资，保持二级流动性保障。

## （3）优化组合

在嘉实债券组合风险控制措施下，本基金根据对宏观经济趋势、货币及财政政策趋势、债券市场供求关系、信用息差水平等因素的动态分析，还可对部分资产，适当运用久期调整、期限结构调整、互换、息差等积极的主动投资策略，挖掘生息资产的内在价值，优化组合的风险收益和流动性。

### ① 久期调整策略

本基金根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

### ② 期限结构调整策略

本基金通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化，可适当调整长期、中期和短期债券的配置方式，以求适当降低机会成本风险和再投资风险，或从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

### ③ 互换策略

本基金可同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，利用不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面的差别，赚取收益率差。

#### ④ 息差策略

本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。

#### 4、可转债投资策略

本基金将根据可转债的底价溢价率和到期收益率来判断其债性，根据可转债的平价溢价率和 Delta 系数大小来判断其股性强弱。当可转债类属资产的债性较强时，将参照债券类资产的投资策略予以管理，当可转债类属资产的股性较强时，将参照股票类资产的投资策略予以管理。

#### 5、股票投资策略

本基金的股票投资包括新股申购、公开增发等一级市场投资和股票二级市场投资。

##### （1）新股申购、公开增发等一级市场投资

在参与股票一级市场投资的过程中，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用嘉实基金的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。

##### （2）二级市场股票投资

本基金将依据自上而下的动态研究，发挥时机选择能力，通过流动性较高的分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险。

本基金运用嘉实研究平台，配置行业和个股，优化组合。本基金重点关注已经或即将进入成长期但距离成熟期和衰退期较远的行业，辅之以“行业轮换”策略，同时关注嘉实研究平台构建的动态“主题型企业群”，精选流动性高、安全边际高、具有上涨潜力的个股，力求增强组合的当期收益。

##### （3）套利策略

本基金依托嘉实研究平台，采用定性定量方法，分析企业兼并收购中的风险收益，寻找低风险套利机会，择机运用并购套利等策略适当操作，及时跟踪市场反映，更新评估分析，动态调整组合，力争在保持组合较低波动幅度的前提下获得稳定收益。

#### 6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

#### 7、投资决策

##### （1）决策依据



1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。

2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；

3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

#### (2) 决策程序

1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。

3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。

4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。

5) 监察稽核部负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

### (五) 投资限制

#### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止从事的其他行为；

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

(1) 债券（含可转换债券）等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；

(2) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%，除法律法规另有规定外；

(3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；

(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；

(5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；

(6) 现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；

(7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；

(8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金投资的资产支持证券信用级别评级为 BBB 级以上（含 BBB）或相当于 BBB 级，在本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

(9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

(10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；

(11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

#### **（六）业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率 × 90% + 沪深 300 指数收益率 × 10%

上述业绩比较基准能反映本基金的风险收益特征，易于广泛地被投资人理解，因而较为适当。

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### **（七）风险收益特征**

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

嘉实多利基金份额具有本基金组合份额的风险收益特征。嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额，具有与本基金组合份额不同的风险收益特征。嘉实多利优先份额较低风险、预期收益相对稳定；嘉实多利进取份额较高风险、预期收益相对较高。

#### **（八）基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法**

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

#### **（九）基金的融资、融券**

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

## （十）基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2011年9月30日（“报告期末”），本报告所列财务数据未经审计。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	287,846,339.00	14.27
	其中：股票	287,846,339.00	14.27
2	固定收益投资	1,382,707,735.14	68.54
	其中：债券	1,382,707,735.14	68.54
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	293,951,880.92	14.57
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	20,562,517.95	1.02
6	其他资产	32,256,472.37	1.60
7	合计	2,017,324,945.38	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,792,807.10	0.75
B	采掘业	33,977,742.00	2.17
C	制造业	159,250,679.77	10.16
C0	食品、饮料	3,850,000.00	0.25
C1	纺织、服装、皮毛	5,306,400.00	0.34
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	8,595,895.80	0.55
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	26,964,834.20	1.72
C7	机械、设备、仪表	80,800,399.12	5.16
C8	医药、生物制品	33,733,150.65	2.15
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,150,000.00	2.31
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	30,142,777.03	1.92
H	批发和零售贸易	3,704,333.10	0.24
I	金融、保险业	5,520,000.00	0.35
J	房地产业	4,870,000.00	0.31
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	2,438,000.00	0.16
M	综合类	-	-
	合计	287,846,339.00	18.36

### 3. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601668	中国建筑	10,000,000	33,800,000.00	2.16
2	600271	航天信息	602,101	16,262,748.01	1.04
3	601699	潞安环能	500,000	14,595,000.00	0.93
4	000651	格力电器	700,000	13,993,000.00	0.89
5	600406	国电南瑞	396,799	13,880,029.02	0.89
6	601088	中国神华	471,300	11,942,742.00	0.76
7	000998	隆平高科	418,630	11,792,807.10	0.75
8	600267	海正药业	349,350	11,514,576.00	0.73
9	600582	天地科技	599,920	11,182,508.80	0.71
10	002526	山东矿机	472,880	10,970,816.00	0.70

### 4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	182,515,187.50	11.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	435,330,000.00	27.77
	其中：政策性金融债	435,330,000.00	27.77
4	企业债券	564,271,015.20	36.00
5	企业短期融资券	149,312,000.00	9.53
6	中期票据	-	-
7	可转债	51,279,532.44	3.27
8	其他	-	-
9	合计	1,382,707,735.14	88.22

### 5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	122065	11 上港 01	1,450,000	141,230,000.00	9.01
2	110411	11 农发 11	1,300,000	130,650,000.00	8.34
3	110217	11 国开 17	1,300,000	126,672,000.00	8.08
4	110235	11 国开 35	1,000,000	98,640,000.00	6.29
5	110005	11 付息国债 05	1,000,000	98,230,000.00	6.27

#### 6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

#### 7. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

#### 8. 投资组合报告附注

(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。

(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。

#### (3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	9,757,061.77
3	应收股利	-
4	应收利息	22,212,217.81
5	应收申购款	10,019.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	27,172.80
8	其他	-
9	合计	32,256,472.37

#### (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	30,658,352.40	1.96
2	110015	石化转债	5,244,600.00	0.33

#### (5) 报告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。

## 第十五部分 基金的业绩

基金业绩截止日为2011年9月30日。

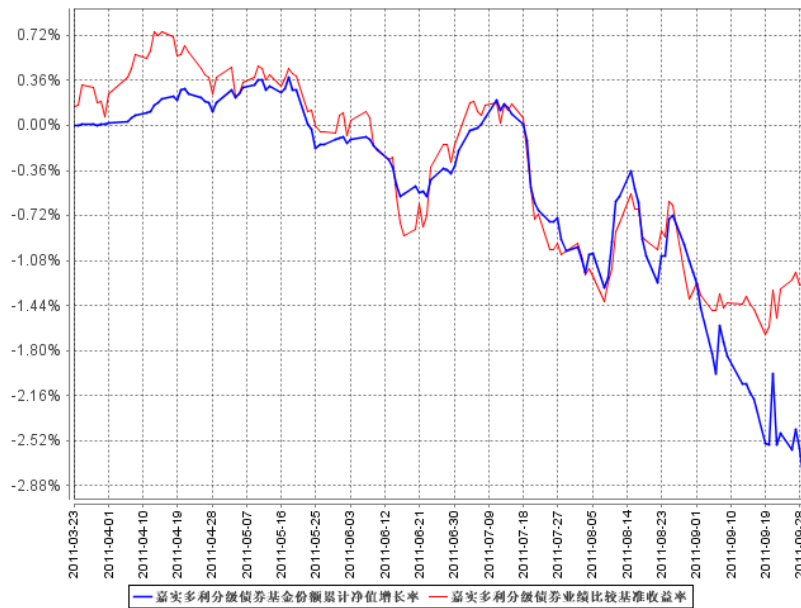
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 1.本报告期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
2011年3月23日 (合同生效日) -2011年6月30日	-0.32%	0.06%	-0.15%	0.13%	-0.17%	-0.07%
2011年3月23日 (合同生效日) -2011年9月30日	-2.76%	0.14%	-1.20%	0.14%	-1.56%	0.00%

### 2.自基金合同生效以来基金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

嘉实多利分级债券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：嘉实多利分级债券累计份额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

(2011年3月23日至2011年9月30日)

注：本基金基金合同生效日 2011 年 3 月 23 日至报告期末未满 1 年。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（十六（二）投资范围和（五）投资限制 2. 基金投资组合限制）的有关约定。

## 第十六部分 基金的财产

### （一）基金资产总值

基金资产总值是指基金拥有的各类有价证券、银行存款本息、基金应收申购款以及其他资产的价值总和。

### （二）基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。

### （三）基金财产的账户

本基金财产以基金名义开立银行存款账户，以基金托管人的名义开立证券交易清算资金的结算备付金账户，以基金托管人和本基金联名的方式开立基金证券账户，以本基金的名义开立银行间债券托管账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和注册登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

### （四）基金财产的处分

基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的固有财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入基金财产。基金管理人、基金托管人可以按基金合同的约定收取管理费、托管费以及其他基金合同约定的费用。基金财产的债权、不得与基金管理人、基金托管人固有财产的债务相抵销，不同基金财产的债权债务，不得相互抵销。基金管理人、基金托管人以其自有资产承担法律责任，其债权人不得对基金财产行使请求冻结、扣押和其他权利。

基金管理人、基金托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，



基金财产不属于其清算财产。

除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定处分外，基金财产不得被处分。非因基金财产本身承担的债务，不得对基金财产强制执行。

## 第十七部分 基金资产的估值

### （一）估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

### （二）估值方法

#### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（3）交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

（4）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的价格估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （三）估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### （四）估值程序

1. 嘉实多利基金份额的份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值及嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额净值与嘉实多利进取份额的份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值结果发送基金托管人，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。

### （五）基金份额净值的计算

#### 1、嘉实多利基金份额的基金份额净值计算

$NAV_t = T$  日闭市后的基金资产净值/ $T$  日基金份额数量。

$NAV_t$ :  $T$  日嘉实多利基金份额的份额净值

$T$  日基金份额数量: 嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额数量之和。

嘉实多利基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

$T$  日的嘉实多利基金份额净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

#### 2、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值计算

(1) 本基金 8 份嘉实多利优先份额与 2 份嘉实多利进取份额构成一对份额组合，该份额组合的份额净值之和等于 10 份嘉实多利基金份额的份额净值之和。

(2) 嘉实多利优先份额的约定收益率为 5%。嘉实多利优先份额的约定收益率除以 365 得到嘉实多利优先份额的约定日简单收益率。嘉实多利优先份额的份额净值，自基金合同生效日起至第 1 个基金份额折算日期间、或自上一个基金份额折算日（到期折算日或到点折算日）后的下一个日历日起至下一个基金份额折算日期间，以 1.0000 元为基准，采用嘉实多利优先份额的约定日简单收益率单利累计计算。

(3) 计算出嘉实多利优先份额的份额净值后，根据嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额和嘉实多利基金份额各自份额净值之间的关系，计算出嘉实多利进取份额的基金份额净值。

(4) 基金份额折算（到期折算或到点折算）后，嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各

自基金份额净值的计算方法保持不变。

(5) 嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自基金份额净值的计算公式

假设：自基金合同生效日起（仅适用于基金合同生效日至第 1 个基金份额折算日）、或上一个基金份额折算日（到期折算日或到点折算日）后的第  $t$  个日历日，嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的基金份额净值分别为  $NAV_t$ 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ ，

因为嘉实多利优先份额的约定收益率为 5%，则第  $t$  个日历日，

$$NAV(A)_t = 1 + 5\% \times \frac{t}{365}$$

$$NAV(B)_t = \frac{NAV_t - 0.8 \times NAV(A)_t}{0.2}$$

嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自基金份额净值的计算结果，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

例如：自上一个基金份额到期折算日后的第 73 个日历日，嘉实多利基金份额净值为 1.0120 元，则

$$\text{嘉实多利优先份额的份额净值} = 1 + 5\% \times \frac{73}{365} = 1.0100 \text{元}$$

$$\text{嘉实多利进取份额的份额净值} = \frac{1.0120 - 0.8 \times 1.0100}{0.2} = 1.0200 \text{元}$$

即自上一个基金份额到期折算日后的第 73 个日历日，嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的份额净值分别为 1.0120 元、1.0100 元、1.0200 元。

## (六) 估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当嘉实多利基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

### 1. 差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、

不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2. 差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2) 差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”)，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金财产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金财产损失时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿；追偿过程中产生的有关费用，应列入基金费用，从基金资产中支付。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、基金合同或其他规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3. 差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册登记机构交易数据的，由基金注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4. 基金份额净值差错处理的原则和方法如下：

- (1) 基金份额净值计算出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。
- (2) 错误偏差达到基金份额净值的 0.25% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5% 时，基金管理人应当公告。
- (3) 因基金份额净值计算错误，给基金或基金份额持有人造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。
- (4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。
- (5) 前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

## （七）暂停估值的情形

1. 基金投资所涉及的证券市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；
2. 因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；
3. 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；
4. 中国证监会和基金合同认定的其它情形。

## （八）基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披

露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

### （九）特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响

。

## 第十八部分 基金的收益分配

### （一）基金收益的构成

- 1.买卖证券差价；
  - 2.基金投资所得红利、股息、债券利息；
  - 3.银行存款利息；
  - 4.已实现的其他合法收入；
  - 5.持有期间产生的公允价值变动（该部分收益不得用于支付基金的利润分配）。
- 因运用基金财产带来的成本或费用的节约应计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按国家有关规定应在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）收益分配原则

本基金（包括嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止嘉实多利优先份额与

嘉实多利进取份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

## 第十九部分 基金份额折算

除分级份额终止运作的份额折算（详见基金合同第二十二章的约定）外，基金份额折算后，本基金的运作方式不变，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额配比不变。

### （一）基金份额折算类别

除分级份额终止运作的份额折算（详见基金合同第二十二章的约定）外，本基金的基金份额折算分为基金份额到期折算和基金份额到点折算。

#### 1、基金份额到期折算

基金合同生效后第 12 个自然月的对应日（若该对应日不是工作日，则顺延至下一个工作日），是第一个到期折算日。自第一个到期折算日起，每个到期折算日后第 12 个自然月的对应日（若该对应日不是工作日，则顺延至下一个工作日），是后续的到期折算日。以到期折算日为基准日实施的基金份额折算，是基金份额到期折算。到期折算日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

基金份额到期折算的频率为：自基金合同生效后，每满一年，进行一次。

#### 2、基金份额到点折算

如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。以到点折算日为基准日实施的基金份额折算，为基金份额到点折算（如果发生极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净大于或等于 1.0000 元，本基金不实施到点折算）。到点折算日的具体日期，详见基金管理人届时发布的公告。

基金份额到点折算的频率为不定期。

### （二）基金份额到期折算和到点折算的折算对象

到期折算日或到点折算日登记在册的本基金所有份额。



### （三）基金份额到期折算方法

1、到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元，则：

- ① 折算前的嘉实多利基金份额持有人，以每 10 份嘉实多利基金份额，按 8 份嘉实多利优先份额的约定收益及 2 份嘉实多利进取份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算增加；
- ② 折算前的嘉实多利优先份额持有人，以嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额；
- ③ 折算前的嘉实多利进取份额持有人，以嘉实多利进取份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额。

按照基金合同第二十一章第（三）条第 1 款第（1）项、第（2）项所述的折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

#### （1）嘉实多利基金份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元，本基金先计算“嘉实多利基金份额的折算比例”，再计算“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数”，将到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

$$\text{嘉实多利基金份额的折算比例} = \frac{\text{到期折算日折算前基金资产净值} / \text{到期折算日基金份额数量}}{1.0000}$$

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数} = \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times \text{嘉实多利基金份额的折算比例}$$

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} = 1.0000 \text{元}$$

到期折算日基金份额数量：是指到期折算日折算前嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额数量之和

“嘉实多利基金份额的折算比例”的计算结果，保留到小数点后 9 位。场外“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数”的计算结果，保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

到期折算日折算前的场外嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场外嘉实多利基金份额的分配。到期折算日折算前的场内嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场内嘉实多利基金份额的分配。

## (2) 嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于 1.0000 元，本基金先计算“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例”，再计算“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”，将到期折算日折算后嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

$$\text{嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例} = \frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额净值}}{1.0000}$$

$$\begin{aligned} &\text{嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数} = \\ &\quad \text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额数} \\ &\quad \times (\text{嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例} - 1) \end{aligned}$$

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额净值} = 1.0000 \text{元}$$

$$\begin{aligned} &\text{到期折算日折算后嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额数} = \\ &\quad \text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的份额数} \end{aligned}$$

“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的折算比例”的计算结果，保留到小数点后 4 位。“嘉实多利优先份额（或嘉实多利进取份额）的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。。

## 2、到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，则：

- ① 折算前的嘉实多利基金份额持有人，以每 10 份嘉实多利基金份额，按 8 份嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的分配：折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额份额净值折算减少、

份额数量相应折算增加；

- ② 折算前的嘉实多利优先份额持有人，以嘉实多利优先份额的约定收益，获得新增嘉实多利基金份额的份额分配：折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量不变，相应折算增加嘉实多利基金份额场内份额；
- ③ 折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额的份额净值、及份额数量不变。

按照基金合同第二十一章第（三）条第 2 款第（1）项、第（2）项所述的折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

#### （1）嘉实多利基金份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，本基金先计算“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”，再计算“嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数”，计算公式如下：

$$\begin{aligned} \text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} &= \frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的资产净值}}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}} - \\ &\frac{\frac{8}{10} \times \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1.0000)}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}} \\ \text{嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数} &= \\ &\frac{\frac{8}{10} \times \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1.0000)}{\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值}} \end{aligned}$$

“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”的计算结果，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。场外“嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数”的计算结果，保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内“嘉实多利基金份额持有人新增的嘉实多利基金份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

到期折算日折算前的场外嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场外嘉实多利基金份额的分配。到期折算日折算前的场内嘉实多利基金份额持有人，将按前述折算方式，获得新增场内嘉实多利基金份额的分配。

#### （2）嘉实多利优先份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，本基金先计算

“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”，再计算“嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”，将到期折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值调整为 1.0000 元、份额数量不变，计算公式如下：

$$\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} = \frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的资产净值}}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}} - \frac{\frac{8}{10} \times \text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1.0000)}{\text{到期折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数}}$$

嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数 =

$$\frac{\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额数} \times (\text{到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值} - 1)}{\text{到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值}}$$

到期折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值 = 1.0000 元

到期折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数 = 到期折算日折算前嘉实多利优先份额的份额数

“到期折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值”的计算结果，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。“嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

### (3) 嘉实多利进取份额的折算方法

如果到期折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 1.0000 元，则到期折算不改变嘉实多利进取份额的份额数量和份额净值。

### 3、到期折算后嘉实多利基金份额的总份额数

到期折算日折算后嘉实多利基金份额的总份额数 =

$$\begin{aligned} & \text{嘉实多利基金份额到期折算后的份额数(含到期折算日折算前份额数及折算后新增份额数)} \\ & + \text{嘉实多利优先份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数} \\ & + \text{嘉实多利进取份额的约定收益折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数(如有)} \end{aligned}$$

## (四) 基金份额到点折算方法

### 1、到点折算

如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日（如果发生极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值大于或等于 1.0000 元，本基金不实施到点折算）。

① 折算不改变嘉实多利基金份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利基金份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整；

② 折算不改变嘉实多利优先份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利优先份额份

额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量折算调整，相应折算增加嘉实多利基金份额；

③ 折算不改变嘉实多利进取份额持有人的资产净值，其持有的嘉实多利进取份额份额净值折算调整为 1.0000 元、份额数量相应折算调整。

④ 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的基金份额配比保持 8：2 的比例不变。

按照基金合同第二十一章第（四）条第 2 款第（1）项、第（2）项、第（3）项所述的折算方法，可能会给基金份额持有人的资产净值造成微小误差，视为未改变基金份额持有人的资产净值。

## 2、到点折算方法

### （1）嘉实多利基金份额的折算方法

本基金先计算“嘉实多利基金份额的折算比例”，再计算“到点折算后嘉实多利基金份额的份额数”，进行嘉实多利基金份额的到点折算，将到点折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

$$\text{嘉实多利基金份额的折算比例} = \frac{\text{到点折算日折算前的基金资产净值} / \text{到点折算日基金份额数量}}{1.0000}$$

$$\text{到点折算后嘉实多利基金份额的份额数} = \text{到点折算日折算前嘉实多利基金份额的份额数} \\ \times \text{嘉实多利基金份额的折算比例}$$

$$\text{到点折算日折算后嘉实多利基金份额的份额净值} = 1.0000 \text{元}$$

到点折算日基金份额数量：是指到点折算日折算前嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额数量之和

“嘉实多利基金份额的折算比例”的计算结果，保留到小数点后 9 位。场外“到点折算后嘉实多利基金份额的份额数”的计算结果，保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。场内“到点折算后嘉实多利基金份额的份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

到点折算日折算前的场外嘉实多利基金份额，将按前述折算方式，折算调整为场外嘉实多利基金份额。到点折算日折算前的场内嘉实多利基金份额，将按前述折算方式，折算调整为场内嘉实多利基金份额。

### （2）嘉实多利进取份额的折算方法

本基金先计算“嘉实多利进取份额到点折算比例”，再计算“到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额数”，将到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额净值调整为 1.0000 元，计

算公式如下：

$$\text{嘉实多利进取份额到点折算比例} = \frac{\text{到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值}}{1.0000}$$

到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额数 = 到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额数

$$\times \text{嘉实多利进取份额到点折算比例}$$

到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额净值 = 1.0000元

“嘉实多利进取份额到点折算比例”的计算结果，保留到小数点后 4 位。“到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

### （3）嘉实多利优先份额的折算方法

本基金依次计算“嘉实多利优先份额到点折算比例”、“到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数”、“嘉实多利优先份额到点折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”，再将到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

$$\text{嘉实多利优先份额到点折算比例} = \text{嘉实多利进取份额到点折算比例} = \frac{\text{到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净值}}{1.0000}$$

到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数 = 到点折算日折算前嘉实多利优先份额的份额数

$$\times \text{嘉实多利优先份额到点折算比例}$$

嘉实多利优先份额到点折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数 =

$$\frac{\text{到点折算日折算前嘉实多利优先份额的份额数} \times \text{到点折算日折算前嘉实多利优先份额的份额净值}}{1.0000}$$

$$- \frac{\text{到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数} \times 1.0000}{1.0000}$$

到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值 = 1.0000元

“嘉实多利优先份额到点折算比例”的计算结果，保留到小数点后 4 位。“到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数”、及“嘉实多利优先份额到点折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

### 3、到点折算后嘉实多利基金份额的总份额数

到点折算日折算后嘉实多利基金份额的总份额数 = 到点折算日折算后嘉实多利基金份额的份额数

$$+ \text{嘉实多利优先份额到点折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数}$$

## （五）基金份额到期折算和到点折算期间的基金业务办理

为保证基金份额到期折算和到点折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、注册登记机构的相关业务规定，暂停嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市交易和嘉实多利基金份额的申购或赎回等业务，具体见届时基金管理人公告。

## （六）基金份额到期折算和到点折算的公告

1、在到期折算日前三十个工作日（基金合同生效后不满三十个工作日的情形除外），遵循深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将就暂停嘉实多利基金份额申购赎回、暂停嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易等相关业务，及基金份额到期折算等有关事项，进行提示性公告。

2、如果嘉实多利进取份额的份额净值在某一开放日高于 0.4500 元，但在下一开放日不高于 0.4500 元的；基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行提示性公告。

3、如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。基金管理人将就实施基金份额到点折算的有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行公告。

4、基金份额到期折算（或到点折算）结束后，或因极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净大于或等于 1.0000 元，本基金未实施到点折算，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

## （七）风险提示

基金管理人承诺也不保证嘉实多利优先份额的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实多利优先份额的基金份额持有人也可能损失本金。

## 第二十部分 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的终止运作

（一）经基金份额持有人大会决议通过，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额可申请终止运作。

该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上（含 2/3）通过方为有效。

## （二）嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后的份额折算

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额将全部折算成场内嘉实多利基金份额。

### 1、份额折算基准日

份额折算基准日为分级份额终止运作日，即嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。

### 2、份额折算方式

分级份额终止运作日，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额按届时各自份额净值与嘉实多利基金份额净值之比折算为嘉实多利基金份额。

### 3、份额折算计算公式：

嘉实多利优先份额折算的嘉实多利基金份额数=（折算前嘉实多利优先份额数 $\times$ NAV<sub>A</sub>） $\div$  NAV<sub>t</sub>

嘉实多利进取份额折算的嘉实多利基金份额数=（折算前嘉实多利进取份额数 $\times$ NAV<sub>B</sub>） $\div$  NAV<sub>t</sub>

折算前嘉实多利优先份额数：指分级份额终止运作日闭市后嘉实多利优先份额数

折算前嘉实多利进取份额数：指分级份额终止运作日闭市后嘉实多利进取份额数

NAV<sub>t</sub>：终止运作日嘉实多利基金份额的份额净值

NAV<sub>A</sub>：终止运作日嘉实多利优先份额的份额净值

NAV<sub>B</sub>：终止运作日嘉实多利进取份额的份额净值

嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额折算成的嘉实多利基金份额数，场内份额数保留至整数位（最小单位为1份），余额计入基金资产。

### 4、份额折算后的基金运作

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额全部折算为场内嘉实多利基金份额后，本基金转型为嘉实多利债券型证券投资基金（LOF），接受场外与场内申购和赎回。

### 5、份额折算的公告

基金管理人应不迟于嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作日前2日，就分级份额终止运作及份额折算事宜，在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额进行份额折算结束后，基金管理人应在2日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。



## 第二十一部分 基金的费用与税收

### （一）基金费用的种类

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金财产拨划支付的银行费用；
- 4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易费用；
- 8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

### （三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

#### 2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

3.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

基金管理费、基金托管费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人和基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

#### （四）不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### （五）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### （六）基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

## 第二十二部分 基金的会计与审计

### （一）基金的会计政策

- 1.基金管理人为本基金的会计责任方；
- 2.本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；
- 3.本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；
- 4.会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5.本基金独立建账、独立核算；
- 6.基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7.基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

## （二）基金的审计

1.基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2.会计师事务所更换经办注册会计师时，应事先征得基金管理人同意。

3.基金管理人(或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人(或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换。就更换会计师事务所，基金管理人应当依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

## 第二十三部分 基金的信息披露

基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊(以下简称“指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站(以下简称“网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

- 1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；
- 2.对证券投资业绩进行预测；
- 3.违规承诺收益或者承担损失；
- 4.诋毁其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；
- 5.登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；
- 6.中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本。如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

### **（一）招募说明书**

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的3日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每6个月结束之日起45日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的15日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每6个月的最后1日。

### **（二）基金合同、托管协议**

基金管理人应在基金份额发售的3日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

### **（三）基金份额发售公告**

基金管理人将按照《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

### **（四）基金合同生效公告**

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

### **（五）嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易公告书**

本基金嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额获准在证券交易所上市交易后，基金管理人将在上市交易日前3个工作日，将嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

### **（六）基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告**

1.本基金的基金合同生效后，在开始办理嘉实多利基金份额申购或者赎回前，基金管理人

将至少每周公告一次基金资产净值和嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额净值、嘉实多利进取份额各自的基金份额净值；

2.在开始办理嘉实多利基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自的基金份额净值和嘉实多利基金份额的基金份额累计净值；

3.基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自的基金份额净值和嘉实多利基金份额的基金份额累计净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自的基金份额净值和嘉实多利基金份额的基金份额累计净值，登载在指定报刊和网站上。

#### **（七）嘉实多利基金份额申购、赎回价格公告**

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明嘉实多利基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

#### **（八）基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告**

1.基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2.基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3.基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4.基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

5.基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

### （九）基金运作相关公告

1、在到期折算日前三十个工作日（基金合同生效后不满三十个工作日的情形除外），遵循深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将就暂停嘉实多利基金份额申购赎回、暂停嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易等相关业务，及基金份额到期折算等有关事项，进行提示性公告。

2、如果嘉实多利进取份额的份额净值在某一开放日高于 0.4500 元，但在下一开放日不高于 0.4500 元的；基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行提示性公告。

3、如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。基金管理人将就实施基金份额到点折算的有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行公告。

4、基金份额到期折算（或到点折算）结束后，或因极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净大于或等于1.0000元，本基金未实施到点折算，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

### （十）临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者嘉实多利基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案：

- 1.基金份额持有人大会的召开及决议；
- 2.终止基金合同；
- 3.转换基金运作方式；
- 4.更换基金管理人、基金托管人；
- 5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；
- 6.基金管理人股东及其出资比例发生变更；
- 7.基金募集期延长；
- 8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；
- 9.基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

- 10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；
- 11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；
- 12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；
- 13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；
- 14.重大关联交易事项；
- 15.基金收益分配事项；
- 16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；
- 17.基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；
- 18.基金改聘会计师事务所；
- 19.基金变更、增加或减少代销机构；
- 20.基金更换注册登记机构；
- 21.本基金开始办理嘉实多利基金份额申购、赎回；
- 22.本基金嘉实多利基金份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；
- 23.本基金发生巨额赎回并延期支付；
- 24.本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；
- 25.本基金暂停接受嘉实多利基金份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；
- 26、本基金接受或暂停接受场内份额配对转换；
- 27、本基金暂停接受场内份额配对转换后恢复办理场内份额配对转换；
- 28、本基金实施基金份额折算；
- 29、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作；
- 30、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的份额折算；
- 31、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额上市交易；
- 32、中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

#### （十一）澄清公告

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对嘉实多利基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对

该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

## （十二）基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。

## （十三）中国证监会规定的其他信息

## （十四）信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、嘉实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额净值、嘉实多利进取份额净值、嘉实多利基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。

基金托管人在基金年度报告、半年度报告等信息披露文件中出具基金托管人报告。托管人报告应说明基金托管人和基金管理人履行基金合同的情况。

基金管理人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊。

基金管理人、基金托管人除依法在指定报刊和网站上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒体披露信息，但是其他公共媒体不得早于指定媒体披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

## （十五）信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和嘉实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额净值与嘉实多利进取份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地，供公众查阅。投资人在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上



公告。

本基金的信息披露将严格按照法律法规和基金合同的规定进行。

## 第二十四部分 风险揭示

投资人投资于本基金，须自行承担投资风险。基金管理人与基金代销机构都不能保证本基金收益或本金安全。

### （一）市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险。随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。基金投资于证券，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险。上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其股票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险。基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6、信用风险。主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

7、再投资风险。债券、票据偿付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

### （二）管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息

的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

### （三）流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括：由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引致的风险。

### （四）特定风险

#### 1、债券投资风险

本基金为债券型基金，主要投资债券类资产，力求稳定收益；择机参与新股申购、投资二级市场权益类资产，权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，以增强收益。因此，本基金可能因投资债券类资产而面临债券市场系统性风险；因参与新股申购而面临新股发行放缓甚至停滞，或者新股申购收益率下降甚至出现亏损所带来的风险；因少量投资可转债或二级市场权益类资产而承担一定程度的市场整体或个别证券价格下跌的风险。

#### 2、基金运作的特有风险

##### （1）嘉实多利优先份额的本金风险

基金管理人承诺也不保证嘉实多利优先份额的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实多利优先份额的基金份额持有人也可能损失本金。

##### （2）嘉实多利进取份额的杠杆性风险

嘉实多利进取份额具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般债券型基金更高的风险特征。

为减小嘉实多利进取份额的份额净值归零风险，本基金设定在嘉实多利进取份额的份额净值不高于0.4000元时触发基金份额到点折算。但极端情况下，嘉实多利进取份额的份额净值仍有归零的风险。

##### （3）场内份额配对转换的风险

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的嘉实多利基金份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务。场内份额配对转换，一方面，可能改变嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，可能出现暂停办理该业务的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

##### （4）流动性风险

在嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易后，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取

份额的规模可能较小或交易量不足，导致投资人不能迅速、低成本地变现或买入的风险。

#### (5) 基金份额折算的风险

由于本基金各级份额的风险收益特征不同，经基金份额到期折算或到点折算后，嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额折算成嘉实多利基金份额的部分；或者当嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额运作终止，嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额折算成嘉实多利基金份额后，基金份额持有人所持有的嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额将面临风险收益特征变化的风险。

(6) 本基金在场内、场外嘉实多利基金份额转托管、场内基金份额配对转换等业务过程中，一些证券公司可能由于其自身原因限制，存在无法进行场内交易的风险。

#### (7) 基金份额的折/溢价交易风险

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折/溢价交易的风险。

受场内份额配对转换业务与本基金开放式机制的影响，八份嘉实多利优先份额与两份嘉实多利进取份额的市价总和将与十份嘉实多利基金份额的净值之和趋同，但是，嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额仍有可能处于折/溢价交易状态。此外，由于场内份额配对转换业务与本基金开放式机制会形成一定的套利机会，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的交易价格可能会相互影响。

### (五) 其他风险

- 1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；
- 2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；
- 3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；
- 4、对主要业务人员如基金经理的依赖而可能产生的风险；
- 5、因业务竞争压力可能产生的风险；
- 6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；
- 7、其他意外导致的风险。

## 第二十五部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1)转换基金运作方式；

(2)变更基金类别；

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

(4)变更基金份额持有人大会程序；

(5)更换基金管理人、基金托管人；

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7)本基金与其他基金的合并；

(8)终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作；

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6)根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定，本基金修改嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市与交易规定；

(7)在不变更本基金合同其他约定的条件下，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以

在报中国证监会备案后变更嘉实多利基金份额的收益分配方式；

(8)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

## （二）本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在6个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.中国证监会规定的其他情况。

如果本基金合同终止，本基金将嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额全部折算为场内嘉实多利基金份额，份额折算基准日为本基金合同终止日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日），份额折算方式和份额折算计算方式，适用本基金第二十二章第（二）条第1款至第3款的约定。

## （三）基金财产的清算

### 1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

### 2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- (3)对基金财产进行清理和确认；
- (4)对基金财产进行估价和变现；
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书；
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会；
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼；
- (9)公布基金财产清算结果；
- (10)对基金剩余财产进行分配。

### 3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4.基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用；
- (2)交纳所欠税款；
- (3)清偿基金债务；
- (4)按基金份额持有人持有的嘉实多利基金份额的份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 第二十六部分 基金合同的内容摘要

### 一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

#### (一) 基金份额持有人的权利与义务

本基金除嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值计算、收益分配、基金份额折算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后的份额折算及本合同对嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的其他特别约定外，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作出现终止，则在终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作后，本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的权利为：

1. 分享基金财产收益；
2. 参与分配清算后的剩余基金财产；
3. 依法转让其持有的嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额，依法申请赎回其持有的嘉实多利基金份额；
4. 按照规定要求召开或自行召集基金份额持有人大会；
5. 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
6. 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
7. 监督基金管理人的投资运作；
8. 对基金管理人、基金托管人、基金份额发售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；
9. 法律法规和基金合同规定的其他权利。

除本合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金份额持有人的义务为：

1. 遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；
2. 交纳基金认购、申购款项及法律法规和基金合同所规定的费用；
3. 在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；
4. 不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

5.执行生效的基金份额持有人大会决议；

6.返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人及基金管理人的代理人、基金托管人、代销机构、其他基金份额持有人处获得的不当得利；

7.法律法规和基金合同规定的其他义务。

## （二） 基金管理人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的权利为：

1.自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用并管理基金财产；

2.依照基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；

3.发售基金份额；

4.依照有关规定行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

5.在符合有关法律法规的前提下，制订和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则，在法律法规和本基金合同规定的范围内决定和调整基金的相关费率结构和收费方式；

6.根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关当事人的利益；

7.在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理嘉实多利基金份额申购和赎回申请；

8.在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资、融券；

9.自行担任或选择、更换注册登记机构，获取基金份额持有人名册，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

10.选择、更换代销机构，并依据基金销售服务代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

11.选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

12.在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

13.依法召集基金份额持有人大会；

14.法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金管理人的义务为：

1.依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、



申购、赎回和登记事宜；

2.办理基金备案手续；

3.自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

4.配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

5.建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

6.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

7.依法接受基金托管人的监督；

8.计算并公告基金资产及嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的份额净值，确定嘉实多利基金份额申购、赎回价格；

9.采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回和注销价格的方法符合基金合同等法律文件的规定；

10.按规定受理嘉实多利基金份额申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

11.进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

12.编制中期和年度基金报告；

13.严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

14.保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

15.按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

16.依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

17.保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

18.以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

19.组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20.因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

21.基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人

追偿；

- 22.按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；
- 23.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- 24.执行生效的基金份额持有人大会决议；
- 25.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；
- 26.依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- 27.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

### （三） 基金托管人的权利与义务

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的权利为：

- 1.依基金合同约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入；
- 2.监督基金管理人对本基金的投资运作；
- 3.自本基金合同生效之日起，依法保管基金资产；
- 4.在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；
- 5.根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金资产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会；

6.依法召集基金份额持有人大会；

7.按规定取得基金份额持有人名册资料；

8.法律法规和基金合同规定的其他权利。

根据《基金法》及其他有关法律法规，基金托管人的义务为：

- 1.安全保管基金财产；
- 2.设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；
- 3.对所托管的不同基金财产分别设置账户，确保基金财产的完整与独立；
- 4.除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；
- 5.保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- 6.按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

7.保守基金商业秘密，除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

8.对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

9.保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

10.按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

11.办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

12.复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的份额净值和嘉实多利基金份额申购、赎回价格；

13.按照规定监督基金管理人的投资运作；

14.按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

15.依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；

16.按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

17.因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

18.基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

19.参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

20.面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；

21.执行生效的基金份额持有人大会决议；

22.不从事任何有损基金及其他基金当事人利益的活动；

23.建立并保存基金份额持有人名册；

24.法律法规、中国证监会和基金合同规定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

### （一） 召开事由

1.当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

(1)终止基金合同；

(2)转换基金运作方式；

(3)变更基金类别;

(4)变更基金投资目标、投资范围或投资策略(法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外);

(5)变更基金份额持有人大会程序;

(6)更换基金管理人、基金托管人;

(7)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准,但法律法规要求提高该等报酬标准的除外;

(8)本基金与其他基金的合并;

(9)终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作;

(10)代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数10%以上(含10%,每一级份额均应占各该级份额总数的10%以上,对每一级份额而言,包括单独或合计持有该级基金份额的10%以上,基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时,应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人)的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)提议时,就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会;

(11)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项;

(12)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2.出现以下情形之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同,不需召开基金份额持有人大会:

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用;

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更收费方式、嘉实多利基金份额的申购费率、调低赎回费率;

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改;

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化;

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响;

(6)根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定,本基金修改嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市与交易规定;

(7)在不变更本基金合同其他约定的条件下,经基金管理人与基金托管人协商,本基金可以在报中国证监会备案后变更嘉实多利基金份额的收益分配方式;

(8)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

## （二） 会议召集人及召集方式

1.除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。

2.基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当自行召集。

3.代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数 10% 以上（含 10%，每一级份额均应占各该级份额总数的 10% 以上，对每一级份额而言，包括单独或合计持有该级基金份额总数的 10% 以上，基金份额持有人提议召开持有人大会、提案、提名基金管理人或基金托管人时，应包括基础份额及两种分级基金份额的持有人。本合同以下相同表述与此具有相同含义）的基金份额持有人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数 10% 以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。

4 代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数 10% 以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数 10% 以上的基金份额持有人有权自行召集基金份额持有人大会，但应当至少提前 30 日向中国证监会备案。

5.基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

## （三） 召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1.基金份额持有人大会的召集人(以下简称“召集人”)负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。召开基金份额持有人大会，召集人必须于会议召开日前 30 日在指定媒体公告。

基金份额持有人大会通知须至少载明以下内容：

- (1)会议召开的时间、地点和出席方式；
- (2)会议拟审议的主要事项；
- (3)会议形式；
- (4)议事程序；
- (5)有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人权益登记日；
- (6)代理投票的授权委托书的内容要求(包括但不限于代理人身份、代理权限和代理有效期限等)、送达时间和地点；
- (7)表决方式；
- (8)会务常设联系人姓名、电话；
- (9)出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- (10)召集人需要通知的其他事项。

2.采用通讯方式开会并进行表决的情况下，由召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3.如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

#### (四) 基金份额持有人出席会议的方式

##### 1.会议方式

(1)基金份额持有人大会的召开方式包括现场开会和通讯方式开会。

(2)现场开会由基金份额持有人本人出席或通过授权委托书委派其代理人出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当出席，如基金管理人或基金托管人拒不派代表出席的，不影响表决效力。

(3)通讯方式开会指按照本基金合同的相关规定以通讯的书面方式进行表决。

(4)会议的召开方式由召集人确定。

##### 2.召开基金份额持有人大会的条件

### (1)现场开会方式

在同时符合以下条件时，现场会议方可举行：

1)对到会者在权益登记日持有基金份额的统计显示，全部有效凭证所代表的基金份额占权益登记日本基金的基金份额总数 50%以上(含 50%)；

2)到会的基金份额持有人身份证明及持有基金份额的凭证、代理人身份证明、委托人持有基金份额的凭证及授权委托代理手续完备，到会者出具的相关文件符合有关法律法规和基金合同及会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的注册登记资料相符。

### (2)通讯开会方式

在同时符合以下条件时，通讯会议方可举行：

1)召集人按本基金合同规定公布会议通知后，在 2 个工作日内连续公布相关提示性公告；

2)召集人按基金合同规定通知基金托管人或/和基金管理人(分别或共同称为“监督人”)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督；

3)召集人在监督人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取和统计基金份额持有人的书面表决意见，如基金管理人或基金托管人经通知拒不到场监督的，不影响表决效力；

4)本人直接出具书面意见和授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额占权益登记日本基金的基金份额总数 50%以上；

5)直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人提交的持有基金份额的凭证、授权委托书等文件符合法律法规、基金合同和会议通知的规定，并与注册登记机构记录相符。

## (五) 议事内容与程序

### 1.议事内容及提案权

(1)议事内容为本基金合同规定的召开基金份额持有人大会事由所涉及的内容。

(2)基金管理人、基金托管人和代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数 10%以上（以权益登记日持有的份额数量为准）的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前就召开事由向大会召集人提交需由基金份额持有人大会审议表决的提案。

(3)对于基金份额持有人提交的提案，大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

关联性。大会召集人对于基金份额持有人提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和基金合同规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述

要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上解释和说明。

程序性。大会召集人可以对基金份额持有人的提案涉及的程序性问题做出决定。如将其提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会主持人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

(4) 代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额总数10%以上（以权益登记日持有的份额数量为准）的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。法律法规另有规定的除外。

(5) 基金份额持有人大会的召集人发出召开会议的通知后，如果需要对原有提案进行修改，应当在基金份额持有人大会召开前 30 日及时公告。否则，会议的召开日期应当顺延并保证至少与公告日期有 30 日的间隔期。

## 2. 议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照规定程序宣布会议议事程序及注意事项，确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，经合法执业的律师见证后形成大会决议。

大会由召集人授权代表主持。基金管理人为召集人的，其授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权代表主持；如果基金管理人和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的代表嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各该级基金份额持有人所持表决权的 50% 以上（含 50%）共同选举产生一名代表作为该次基金份额持有人大会的主持人。

召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名(或单位名称)、身份证号码、持有或代表有表决权的基金份额数量、委托人姓名(或单位名称)等事项。

### (2) 通讯方式开会

在通讯表决开会的方式下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后第 2 个工作日在公证机关及监督人的监督下由召集人统计全部有效表决并形成决议。如监督人经通知但拒绝到场监督，则在公证机关监督下形成的决议有效。



3.基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

#### (六) 表决

1. 嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的基金份额持有人所持每一基金份额在其对应份额级别内享有平等的表决权。

2.基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

##### (1)一般决议

一般决议须经出席会议的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额持有人各自所持表决权的 50%以上（含 50%，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的 50%以上）通过方为有效，除下列(2)所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过；

##### (2)特别决议

特别决议须经出席会议的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额持有人各自所持表决权的三分之二以上(含三分之二，每一级基金份额应独立表决，每一级份额均应占出席持有人大会的各该级份额总数的三分之二以上)通过方为有效；涉及更换基金管理人、更换基金托管人、转换基金运作方式、终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作、终止基金合同必须以特别决议通过方为有效。

3.基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会核准或者备案，并予以公告。

4.采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

5.基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

6.基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

### 三、基金收益分配原则、执行方式

本基金（包括嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额）不进行收益分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准后，如果终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作，本基金将根据基金份额持有人大会决议调整基金的收益分配。具体见基金管理人届时发布的相关公告。

#### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### (一)基金费用的种类

- 1.基金管理人的管理费；
- 2.基金托管人的托管费；
- 3.基金财产拨划支付的银行费用；
- 4.基金合同生效后的基金信息披露费用；
- 5.基金份额持有人大会费用；
- 6.基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 7.基金的证券交易费用；
- 8.依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

##### (三)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1.基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

###### 2.基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

3.除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

基金管理费、基金托管费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人和基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

##### (四)不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与基金托管人因未履行或未完全履行义务导致费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### (五) 基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

#### (六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

### 五、基金财产的投资方向和投资限制

#### (一) 投资目标

本基金在有效控制风险、保持适当流动性的前提下，力争持续稳定增值。

#### (二) 投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、政府机构债、地方政府债、政策性金融债、商业银行金融债、非银行金融机构金融债、资产支持证券、央行票据、债券回购、银行存款等固定收益类资产。本基金可以投资所有一级、二级市场股票等权益类资产、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具或金融衍生工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合的资产配置范围为：债券（含可转换债券）等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

#### (三) 投资理念

本基金利用多元化的低风险赢利模式，在控制基金组合下行波动幅度和保持适当流动性的前提下，追求收益最大化。

#### (四) 投资策略

为持续稳妥地获得高于存款利率的收益，本基金首先运用“嘉实下行风险波动模型”，控制基金组合的年下行波动风险。在此前提下，本基金综合分析宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等，挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会，力求持续取得达到或超过业绩比较基准的收益。

### 1、嘉实下行风险波动模型

嘉实下行风险波动模型从组合层面以及个券层面分别度量组合潜在的下行风险，并根据宏观环境以及证券市场表现，设置一定的阈值，将组合的可能亏损控制在低风险偏好投资人可接受的范围内。

在组合层面，本基金将使用下方波动率、CVAR（条件在险价值）等指标，结合情景分析和压力测试的方法，评价组合在未来一段时间发生亏损的可能性，以及可能遭受的亏损金额。

在个券层面，本基金将对股票等权益类资产和债券等固定收益类资产，采用不同的分析方法。对股票等权益类资产，本基金通过不同板块的估值情况以及历史波动率等指标，限制组合在高估值以及历史波动率过高的股票的投资比例。对债券等固定收益类资产，本基金将通过凸度分析法，将债券的凸度与宏观环境相联系，当预期未来进入加息通道、债券市场收益率水平持续上移时，本基金根据期限结构和类属配置目标，通过凸性分析选择波动特性最优的债券，从而降低组合可能面临的下行风险。

### 2、资产配置

本基金根据对宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等方面的动态分析，在限定资产配置范围内，决定债券等固定收益类资产和股票等权益类资产的配置比例、并跟踪影响资产配置策略的各种因素的变化，定期对大类资产配置比例进行调整。

本基金采取“总收益策略”（Total Return Strategy），以信用较好的中短期债券为核心资产配置，运用定性定量模型，动态分析比较本基金投资范围内的各子市场中的风险收益特征，以满足基金组合下行波动风险既定阈值和流动性需求的条件下收益最大化为目标，在各类投资工具中优化选择，配置和调整组合的卫星资产。从而，本基金在谋求持续稳定收益的基础上，顺应证券市场变化，以低风险偏好投资人可接受的安全边际，力争在投资利率或信用工具中，或在少量择机投资股票等权益类资产中，或在各类工具套利投资中，持续获得增强收益。

### 3、债券投资策略

#### （1）构建组合

本基金以信用较好的中短期债券为主，构建本基金组合的核心资产配置。

本基金在单个债券选择上，首先，根据个券的剩余期限、久期、信用等级、流动性指标，决定是否将该债券纳入组合的债券备选池；其次，根据个券的收益率（到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理）与剩余期限的配比，对照本基金的收益要求决定是否纳入组合；最后，根据个券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定个券的投资总量。

## （2）嘉实债券组合风险控制措施

在利率风险控制上，本基金主要从组合层面、个券层面、及交易场所选择等方面，防范和控制价格波动风险。在组合层面，本基金根据对市场利率变动趋势的主动预测及模型测试，调整和控制组合久期。在个券层面，本基金通过凸性分析，在债券备选池中选择波动特性较优的单个债券。在交易场所选择上，本基金根据对影响流动性因素的动态分析，适当控制在同一交易场所上市交易、且现券价格波动幅度较大的现券资产的配置比例。此外，在预测利率走势、控制基金资产净值波动幅度、保持组合适当流动性的基础上，本基金优化组合的期限结构，以适当降低机会成本风险和再投资风险。

在信用风险控制上，本基金根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级，依靠嘉实信用分析团队、及嘉实中央研究平台的其他资源，深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况，严格遵守嘉实信用分析流程、执行嘉实信用投资纪律。

在流动性风险控制上，日常运作中，本基金优先由现金和到期的短期债券逆回购提供一级流动性保障；由现券或个股提供二级流动性保障，本基金通过适当配置流动性较好的类属品种、控制个券信用等级、分散化组合投资，保持二级流动性保障。

## （3）优化组合

在嘉实债券组合风险控制措施下，本基金根据对宏观经济趋势、货币及财政政策趋势、债券市场供求关系、信用息差水平等因素的动态分析，还可对部分资产，适当运用久期调整、期限结构调整、互换、息差等积极的主动投资策略，挖掘生息资产的内在价值，优化组合的风险收益和流动性。

### ① 久期调整策略

本基金根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

### ② 期限结构调整策略

本基金通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化，可适当调整长期、中期和短期债券的配置方式，以求适当降低机会成本风险和再投资风险，或从长、中、短期债券的相对价格

变化中获利。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

### ③ 互换策略

本基金可同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，利用不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面的差别，赚取收益率差。

### ④ 息差策略

本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。

## 4、可转债投资策略

本基金将根据可转债的底价溢价率和到期收益率来判断其债性，根据可转债的平价溢价率和 Delta 系数大小来判断其股性强弱。当可转债类属资产的债性较强时，将参照债券类资产的投资策略予以管理，当可转债类属资产的股性较强时，将参照股票类资产的投资策略予以管理。

## 5、股票投资策略

本基金的股票投资包括新股申购、公开增发等一级市场投资和股票二级市场投资。

### （1）新股申购、公开增发等一级市场投资

在参与股票一级市场投资的过程中，本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面，运用嘉实基金的研究平台和股票估值体系，深入发掘新股内在价值，结合市场估值水平和股市投资环境，充分考虑中签率、锁定期等因素，有效识别并防范风险，以获取较好收益。

### （2）二级市场股票投资

本基金将依据自上而下的动态研究，发挥时机选择能力，通过流动性较高的分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险。

本基金运用嘉实研究平台，配置行业和个股，优化组合。本基金重点关注已经或即将进入成长期但距离成熟期和衰退期较远的行业，辅之以“行业轮换”策略，同时关注嘉实研究平台构建的动态“主题型企业群”，精选流动性高、安全边际高、具有上涨潜力的个股，力求增强组合的当期收益。

### （3）套利策略

本基金依托嘉实研究平台，采用定性定量方法，分析企业兼并收购中的风险收益，寻找低风险套利机会，择机运用并购套利等策略适当操作，及时跟踪市场反映，更新评估分析，动态调整组合，力争在保持组合较低波动幅度的前提下获得稳定收益。

## 6、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值。本基金权证投资将以

价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，立足于无风险套利，尽力减少组合净值波动率，力求稳健的超额收益。

## 7、投资决策

### (1) 决策依据

- 1) 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定。
- 2) 宏观经济、微观经济运行状况，货币政策和财政政策执行状况，货币市场和证券市场运行状况；
- 3) 分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

### (2) 决策程序

- 1) 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。
- 2) 相关研究部门或岗位对宏观经济主要是利率走势等进行分析，提出分析报告。
- 3) 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考研究部门提出的报告，并依据基金申购和赎回的情况控制投资组合的流动性风险，制定具体资产配置和调整计划，进行投资组合的构建和日常管理。
- 4) 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略并执行交易。
- 5) 监察稽核部负责监控基金的运作管理是否符合法律、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定；风险管理部门运用风险监测模型以及各种风险监控指标，对市场预期风险进行风险测算，对基金组合的风险进行评估，提交风险监控报告；风险控制委员会根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控。

## (五) 投资限制

### 1、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(8) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止从事的其他行为；

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。

## 2、投资组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

- (1) 债券（含可转换债券）等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；
- (2) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%，除法律法规另有规定外；
- (3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；
- (6) 现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- (7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；
- (8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金投资的资产支持证券信用级别评级为 BBB 级以上（含 BBB）或相当于 BBB 级，在本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。



- (9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- (11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的从其规定。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

#### (六) 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：中国债券总指数收益率 × 90% + 沪深 300 指数收益率 × 10%

上述业绩比较基准能反映本基金的风险收益特征，易于广泛地被投资人理解，因而较为适当。

如果相关法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

#### (七) 风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

嘉实多利基金份额具有本基金组合份额的风险收益特征。嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额，具有与本基金组合份额不同的风险收益特征。嘉实多利优先份额较低风险、预期收益相对稳定；嘉实多利进取份额较高风险、预期收益相对较高。

#### (八) 基金管理人代表基金行使股东权利及债权人权利的处理原则及方法

- 1.基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利及债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 2.不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 3.有利于基金财产的安全与增值；

4.不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不正当利益。

#### (九)基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

### 六、基金资产净值的计算方法和公告方式

#### (一)估值日

本基金的估值日为本基金相关的证券交易场所的正常营业日以及国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非营业日。

#### (二)估值方法

##### 1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

##### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的价格估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### (三)估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

### (四)估值程序

1.嘉实多利基金份额的份额净值是按照每个工作日闭市后，基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。

每个工作日计算基金资产净值及嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额净值与嘉实多利进取份额的份额净值，并按规定公告。

2.基金管理人应每个工作日对基金资产估值。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，

将嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值结果发送基金托管人，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。

#### (五)基金份额净值的计算

##### 1、嘉实多利基金份额的基金份额净值计算

$NAV_t = T$  日闭市后的基金资产净值/ $T$  日基金份额数量。

$NAV_t$ :  $T$  日嘉实多利基金份额的份额净值

$T$  日基金份额数量: 嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额数量之和。

嘉实多利基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

$T$  日的嘉实多利基金份额净值在当天收市后计算，并在下一日内公告。遇特殊情况，经中国证监会同意，可以适当延迟计算或公告。

##### 2、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的份额净值计算

(1) 本基金 8 份嘉实多利优先份额与 2 份嘉实多利进取份额构成一对份额组合，该份额组合的份额净值之和等于 10 份嘉实多利基金份额的份额净值之和。

(2) 嘉实多利优先份额的约定收益率为 5%。嘉实多利优先份额的约定收益率除以 365 得到嘉实多利优先份额的约定日简单收益率。嘉实多利优先份额的份额净值，自基金合同生效日起至第 1 个基金份额折算日期间、或自上一个基金份额折算日（到期折算日或到点折算日）后的下一个日历日起至下一个基金份额折算日期间，以 1.0000 元为基准，采用嘉实多利优先份额的约定日简单收益率单利累计计算。

(3) 计算出嘉实多利优先份额的份额净值后，根据嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额和嘉实多利基金份额各自份额净值之间的关系，计算出嘉实多利进取份额的基金份额净值。

(4) 基金份额折算（到期折算或到点折算）后，嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自基金份额净值的计算方法保持不变。

##### (5) 嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自基金份额净值的计算公式

假设：自基金合同生效日起（仅适用于基金合同生效日至第 1 个基金份额折算日）、或上一个基金份额折算日（到期折算日或到点折算日）后的第  $t$  个日历日，嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的基金份额净值分别为  $NAV_t$ 、 $NAV(A)_t$ 、 $NAV(B)_t$ ，

因为嘉实多利优先份额的约定收益率为 5%，则第  $t$  个日历日，

$$NAV(A)_t = 1 + 5\% \times \frac{t}{365}$$

$$NAV(B)_t = \frac{NAV_t - 0.8 \times NAV(A)_t}{0.2}$$

嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自基金份额净值的计算结果，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入。

#### (六)估值错误的处理

基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当嘉实多利基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误。

本基金合同的当事人应按照以下约定处理：

##### 1.差错类型

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册登记机构、或代销机构、或投资人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失当事人(“受损方”)的直接损失按下述“差错处理原则”给予赔偿，承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平不能预见、不能避免、不能克服，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

##### 2.差错处理原则

(1)差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的，由差错责任方对直接损失承担赔偿责任；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。

(2)差错的责任方对有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责。

(3)因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差

错负责。如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失(“受损方”),则差错责任方应赔偿受损方的损失,并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利;如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方,则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。

(4)差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。

(5)差错责任方拒绝进行赔偿时,如果因基金管理人过错造成基金财产损失时,基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿,如果因基金托管人过错造成基金财产损失时,基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。基金管理人和托管人之外的第三方造成基金财产的损失,并拒绝进行赔偿时,由基金管理人负责向差错方追偿;追偿过程中产生的有关费用,应列入基金费用,从基金资产中支付。

(6)如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿,并且依据法律法规、基金合同或其他规定,基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任,则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索,并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的直接损失。

(7)按法律法规规定的其他原则处理差错。

### 3.差错处理程序

差错被发现后,有关的当事人应当及时进行处理,处理的程序如下:

(1)查明差错发生的原因,列明所有的当事人,并根据差错发生的原因确定差错的责任方;

(2)根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估;

(3)根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失;

(4)根据差错处理的方法,需要修改基金注册登记机构交易数据的,由基金注册登记机构进行更正,并就差错的更正向有关当事人进行确认。

### 4.基金份额净值差错处理的原则和方法如下:

(1)基金份额净值计算出现错误时,基金管理人应当立即予以纠正,通报基金托管人,并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

(2)错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告。

(3)因基金份额净值计算错误,给基金或基金份额持有人造成损失的,应由基金管理人先行

赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(4)基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5)前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，从其规定处理。

(七)暂停估值的情形

1.基金投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2.因不可抗力或其它情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；

3.占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，会导致基金管理人不能出售或评估基金资产的；

4.中国证监会和基金合同认定的其它情形。

(八)基金净值的确认

用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日或国家法律法规规定需要对外披露基金净值的非工作日的基金资产净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值予以公布。

(九)特殊情况的处理

1.基金管理人或基金托管人按估值方法的第 5 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。

2.由于不可抗力原因，或由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产清算方式

(一)基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

(1)转换基金运作方式；

(2)变更基金类别；

(3)变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外）；

(4)变更基金份额持有人大会程序；

(5)更换基金管理人、基金托管人；

(6)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据适用的相关规定提高该等报酬标准的除外；

(7)本基金与其他基金的合并；

(8)终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作；

(9)对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

(10)法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

(1)调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

(2)在法律法规和本基金合同规定的范围内变更基金的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；

(3)因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

(4)对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

(5)基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

(6)根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定，本基金修改嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市与交易规定；

(7)在不变更本基金合同其他约定的条件下，经基金管理人与基金托管人协商，本基金可以在报中国证监会备案后变更嘉实多利基金份额的收益分配方式；

(8)按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2.关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起2日内在至少一种指定媒体公告。

(二)本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在6个月



内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.中国证监会规定的其他情况。

如果本基金合同终止，本基金将嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额全部折算为场内嘉实多利基金份额，份额折算基准日为本基金合同终止日（如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日），份额折算方式和份额折算计算方式，适用本基金第二十二章第（二）条第 1 款至第 3 款的约定。

### （三）基金财产的清算

#### 1.基金财产清算组

（1）基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

（2）基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

（3）基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- （1）基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- （2）基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；
- （3）对基金财产进行清理和确认；
- （4）对基金财产进行估价和变现；
- （5）聘请会计师事务所对清算报告进行审计；
- （6）聘请律师事务所出具法律意见书；
- （7）将基金财产清算结果报告中国证监会；
- （8）参加与基金财产有关的民事诉讼；
- （9）公布基金财产清算结果；
- （10）对基金剩余财产进行分配。

### 3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4.基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用；
- (2)交纳所欠税款；
- (3)清偿基金债务；
- (4)按基金份额持有人持有的嘉实多利基金份额的份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

### 5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。

## 八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

## 九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

《基金合同》可印制成册，供投资者在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买《基金合同》复制件或复印件，但内容应以《基金合同》正本为准。

## 第二十七部分 基金托管协议的内容摘要

### 一、基金托管协议当事人

#### (一) 基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室

办公地址：北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

邮政编码：100005

法定代表人：王忠民

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字[1999]5 号文

组织形式：有限责任公司（中外合资）

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整

存续期间：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

#### (二) 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务。外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇票据的承兑和贴现；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其

他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

## 二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

1、本基金将投资于以下金融工具：

本基金主要投资于国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、政府机构债、地方政府债、政策性金融债、商业银行金融债、非银行金融机构金融债、资产支持证券、央行票据、债券回购、银行存款等固定收益类资产。本基金可以投资可以投资所有一级、二级市场股票等权益类资产、权证，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。

2、本基金不得投资于相关法律、法规、部门规章及《基金合同》禁止投资的投资工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融工具或金融衍生工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；如法律法规或中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的，基金管理人在履行适当程序后，可相应调整本基金的投资比例上限规定，不需经基金份额持有人大会审议。

对基金管理人发送的不符合基金合同规定的投资行为，基金托管人可以拒绝执行，并书面通知基金管理人；对于已经执行的投资，基金托管人发现该投资行为不符合基金合同的规定的，基金托管人应书面通知基金管理人进行整改，并将该情况报告中国证监会。

(二) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资、融资比例进行监督。基金合同明确约定基金投资风格或证券选择标准的，基金管理人应事先向基金托管人提供投资品种池，以便基金托管人对基金实际投资是否符合基金合同关于证券选择标准的约定进行监督。

本基金的投融资比例：

本基金投资组合的资产配置范围为：债券（含可转换债券）等固定收益类资产占基金资产的比例不低于 80%，股票等权益类资产占基金资产的比例不超过 20%，持有现金及到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于 5%。

本基金投资组合遵循以下投资限制：

- (1) 债券（含可转换债券）等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%，股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%；
- (2) 持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的 10%，除法律法规另有规定外；
- (3) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；
- (4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%，在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；
- (5) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%，基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%，基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定；
- (6) 现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；
- (7) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%，中国证监会规定的特殊品种除外；
- (8) 本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过该基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；本基金投资的资产支持证券信用级别评级为 BBB 级以上（含 BBB）或相当于 BBB 级，在本基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。
- (9) 本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；
- (10) 本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定；
- (11) 相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致投资组合不符合基金合同的约定的，基金管理人应在 10 个交易日内进行调整。法律、法规另有规定时，从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

如果法律法规及监管政策等对基金合同约定的投资禁止行为和投资组合比例限制进行变更的，本基金可相应调整禁止行为和投资比例限制规定，不需经基金份额持有人大会审议。《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的，履行适当程序后，基金不受上述限制。

（三）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对本托管协议第十五条第九款基金投资禁止行为进行监督。基金托管人通过事后监督方式对基金管理人基金投资禁止行为和关联交易进行监督。根据法律法规有关基金禁止从事关联交易的规定，基金管理人和基金托管人应事先相互提供与本机构有控股关系的股东、与本机构有其他重大利害关系的公司名单及有关关联方发行的证券名单。基金管理人和基金托管人有责任确保各自提供的关联交易名单的真实性、准确性、完整性，并负责及时将更新后的名单发送给对方。

若基金托管人发现基金管理人与关联交易名单中列示的关联方进行法律法规禁止基金从事的关联交易时，如基金托管人提醒基金管理人后仍无法阻止关联交易发生时，基金托管人有权向中国证监会报告。

（四）基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人参与银行间债券市场进行监督。基金管理人应在基金投资运作之前向基金托管人提供符合法律法规及行业标准的、经慎重选择的、本基金适用的银行间债券市场交易对手名单。基金管理人有责任确保及时将更新后的交易对手名单发送给基金托管人，否则由此造成的损失应由基金管理人承担。基金管理人应严格按照交易对手名单的范围在银行间债券市场选择交易对手。基金托管人监督基金管理人是否按事前提供的银行间债券市场交易对手名单进行交易。在基金存续期间基金管理人可以调整交易对手名单，但应将调整结果至少提前一个工作日书面通知基金托管人。新名单确定前已与本次剔除的交易对手所进行但尚未结算的交易，仍应按照协议进行结算。

基金管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同而造成的纠纷及损失。若未履约的交易对手在基金管理人确定的时间内仍未承担违约责任及其他相关法律责任的，基金管理人可以对相应损失先行予以承担，然后再向相关交易对手追偿。基金托管人则根据银行间债券市场成交单对合同履行情况进行监督。如基金托管人事后发现基金管理人没有按照事先约定的交易对手进行交易时，基金托管人应及时提醒基金管理人，基金托管人不承担由此造成的任何损失和责任。

（五）本基金投资流通受限证券，应遵守《关于规范基金投资非公开发行证券行为的紧急通知》、《关于基金投资非公开发行股票等流通受限证券有关问题的通知》等有关法律法规规定。

1. 本协议所称的流通受限证券，包括由《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票、公开发行股票网下配售部分等在发行时明确一定期限锁定期的可交易证券，不包括由于发布重大消息或其他原因而临时停牌的证券、已发行未上市证券、回购交易中的质押券等流通

受限证券。

本基金可以投资经中国证监会批准的非公开发行证券，且限于由中国证券登记结算有限责任公司或中央国债登记结算有限责任公司负责登记和存管的，并可在证券交易所或全国银行间债券市场交易的证券。

基金不得投资未经中国证监会批准的非公开发行证券。

基金参与非公开发行证券的认购，不得预付任何形式的保证金，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

基金不得投资有锁定期但锁定期不明确的证券，且锁定期不得超过本基金的剩余期限。

2. 基金管理人应在基金首次投资流通受限证券前，向基金托管人提供经基金管理人董事会批准的有关基金投资流通受限证券的投资决策流程、风险控制制度。基金投资非公开发行股票，基金管理人还应提供基金管理人董事会批准的流动性风险处置预案。上述资料应包括但不限于基金投资流通受限证券的投资额度和投资比例控制情况。

基金管理人应至少于首次执行投资指令之前两个工作日将上述资料书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。基金托管人应在收到上述资料后两个工作日内，以书面或其他双方认可的方式确认收到上述资料。

基金管理人对本基金投资受限证券的流动性风险负责，确保对相关风险采取积极有效的措施，在合理的时间内有效解决基金运作的流动性问题。如因基金巨额赎回或市场发生剧烈变动等原因而导致基金现金周转困难时，基金管理人应保证提供足额现金确保基金的支付结算，并承担所有损失。对本基金因投资受限证券导致的流动性风险，基金托管人不承担任何责任。

3.基金投资流通受限证券前，基金管理人应向基金托管人提供符合法律法规要求的有关书面信息，包括但不限于拟发行证券主体的中国证监会批准文件、发行证券数量、发行价格、锁定期，基金拟认购的数量、价格、总成本、应划付的认购款、资金划付时间等。基金管理人应保证上述信息的真实、完整，并应至少于拟执行投资指令前两个工作日将上述信息书面发至基金托管人，保证基金托管人有足够的时间进行审核。

由于基金管理人未及时提供有关证券的具体的必要的信息，致使托管人无法审核认购指令而影响认购款项划拨的，基金托管人免于承担责任。

4.基金托管人依照法律法规，《基金合同》，《托管协议》审核基金管理人投资流通受限证券的行为。如发现基金管理人违反了《基金合同》、《托管协议》以及其他相关法律法规的有关规定，应及时通知基金管理人，并呈报中国证监会，同时采取合理措施保护基金投资人的利益。基金托管人有权对基金管理人的违法、违规以及违反《基金合同》、《托管协议》投资指令不予执行，并立即通知基金管理人纠正，基金管理人不予纠正或已代表基金签署合同不得不执行时，基金托管人应向中国证监会报告。

(六) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金资产净值计算、嘉

实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额净值与嘉实多利进取份额净值的计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。

(七) 基金托管人发现基金管理人的上述事项及投资指令或实际投资运作违反法律法规、基金合同和本托管协议的规定,应及时以电话提醒或书面提示等方式通知基金管理人限期纠正。基金管理人应积极配合和协助基金托管人的监督和核查。基金管理人收到通知后应及时核对并回复基金托管人,对于收到的书面通知基金管理人应以书面形式给基金托管人发出回函,就基金托管人的疑义进行解释或举证,说明违规原因及纠正期限。在上述规定期限内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人应报告中国证监会。

(八) 基金管理人负有义务配合和协助基金托管人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查。包括但不限于:对基金托管人发出的提示,基金管理人应在规定时间内答复并改正,或就基金托管人的疑义进行解释或举证;对基金托管人按照法律法规、基金合同和本托管协议的要求需向中国证监会报送基金监督报告的事项,基金管理人应积极配合提供相关数据资料和制度等。

(九) 若基金托管人发现基金管理人依据交易程序已经生效的指令违反法律、行政法规和其他有关规定,或者违反基金合同约定的,应当立即通知基金管理人及时纠正,由此造成的损失由基金管理人承担。

(十) 基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为,应及时报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正。

### 三、基金管理人对于基金托管人的业务核查

(一) 基金管理人对于基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户和证券账户、复核基金管理人计算的基金资产净值、嘉实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额净值与嘉实多利进取份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。

(二) 基金管理人发现基金托管人擅自挪用基金财产、未对基金财产实行分账管理、未执行或无故延迟执行基金管理人资金划拨指令、泄露基金投资信息等违反《基金法》、基金合同、本协议及其他有关规定时,应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正。基金托管人收到书面通知后应及时核对并以书面形式给基金管理人发出回函,说明违规原因及纠正期限,并保证在规定期限内及时改正。在上述规定期限内,基金管理人有权随时对通知事项进行复查,督促基金托管人改正。



(三) 基金托管人有义务配合和协助基金管理人依照法律法规、基金合同和本托管协议对基金业务执行核查, 包括但不限于: 对基金管理人发出的书面提示, 基金托管人应在规定时间内答复并改正, 或就基金管理人的疑义进行解释或举证; 基金托管人应积极配合提供相关资料以供基金管理人核查托管财产的完整性和真实性。

(四) 基金管理人发现基金托管人有重大违规行为, 应及时报告中国证监会, 同时通知基金托管人限期纠正, 并将纠正结果报告中国证监会。

#### 四、基金财产的保管

##### (一) 基金财产保管的原则

1. 基金财产应独立于基金管理人、基金托管人的固有财产。
2. 基金托管人应安全保管基金财产。
3. 基金托管人按照规定开设基金财产的资金账户和证券账户。
4. 基金托管人对所托管的不同基金财产分别设置账户, 确保基金财产的完整与独立。
5. 基金托管人根据基金管理人的指令, 按照基金合同和本协议的约定保管基金财产。未经基金管理人的正当指令, 不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失, 由此产生的责任应由基金托管人承担。
6. 对于因为基金投资产生的应收资产, 应由基金管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知基金托管人, 到账日基金财产没有到达基金账户的, 基金托管人应及时通知基金管理人采取措施进行催收。基金管理人未及时催收给基金财产造成损失的, 基金管理人应负责向有关当事人追偿基金财产的损失。
7. 基金托管人应安全、完整地保管基金资产; 未经基金管理人的正当指令, 不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。不属于基金托管人实际有效控制下的实物证券的损坏、灭失, 基金托管人不承担责任。

8. 除依据法律法规和基金合同的规定外, 基金托管人不得委托第三人托管基金财产。

##### (二) 基金募集期间及募集资金的验资

1. 基金募集期间募集的资金应开立“基金募集专户”。该账户由基金管理人开立并管理。
2. 基金募集期满或基金停止募集时, 募集的基金份额总额、基金募集金额、基金份额持有人人数符合《基金法》、《运作办法》等有关规定后, 基金管理人应将属于基金财产的全部资金划入基金托管人开立的基金银行账户, 同时在规定时间内, 基金管理人应聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所进行验资, 出具验资报告。出具的验资报告由参加验资的 2 名或 2 名以上中国注册会计师签字方为有效。
3. 若基金募集期限届满, 未能达到基金合同生效的条件, 由基金管理人按规定办理退款等

事宜。

### （三）基金银行账户的开立和管理

1.基金托管人以基金的名义在其营业机构开立基金的银行账户，保管基金的银行存款，并根据基金管理人的指令办理资金收付。本基金的银行预留印鉴由基金托管人刻制、保管和使用。

2.基金银行账户的开立和使用，限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得假借本基金的名义开立任何其他银行账户；亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金银行账户的开立和管理应符合法律法规及银行业监督管理机构的有关规定。

### （四）基金证券账户和结算备付金账户的开立和管理

1.基金托管人在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司、深圳分公司为基金开立基金托管人与基金联名的证券账户。

2.基金证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本基金业务的需要。基金托管人和基金管理人不得出借或未经对方同意擅自转让基金的任何证券账户，亦不得使用基金的任何账户进行本基金业务以外的活动。

3.基金证券账户的开立和证券账户卡的保管由基金托管人负责，账户资产的管理和运用由基金管理人负责。

4.基金托管人以基金托管人的名义在中国证券登记结算有限责任公司开立结算备付金账户，并代表所托管的基金完成与中国证券登记结算有限责任公司的一级法人清算工作，基金管理人应予以积极协助。结算备付金、结算互保基金、交收价差资金等的收取按照中国证券登记结算有限责任公司的规定执行。

5.若中国证监会或其他监管机构在本托管协议订立日之后允许基金从事其他投资品种的投资业务，涉及相关账户的开立、使用的，若无相关规定，则基金托管人比照上述关于账户开立、使用的规定执行。

### （五）债券托管专户的开设和管理

基金合同生效后，基金托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司的有关规定，在中央国债登记结算有限责任公司开立债券托管账户，并代表基金进行银行间市场债券的结算。基金管理人和基金托管人共同代表基金签订全国银行间债券市场债券回购主协议。

### （六）其他账户的开立和管理

1.因业务发展需要而开立的其他账户，可以根据法律法规和基金合同的规定，由基金管理人协助基金托管人按照有关法律法规和基金合同的约定开立。新账户按有关规定使用并管理。

2.法律法规等有关规定对相关账户的开立和管理另有规定的，从其规定办理。

### （七）基金财产投资的有关有价凭证等的保管

基金财产投资的有关实物证券等有价凭证按约定由基金托管人存放于基金托管人的保管

库，或存入中央国债登记结算有限责任公司、中国证券登记结算有限责任公司上海分公司/深圳分公司或票据营业中心的代保管库，实物保管凭证由基金托管人持有。实物证券等有价凭证的购买和转让，由基金托管人根据基金管理人的指令办理。基金托管人对由上述存放机构及基金托管人以外机构实际有效控制的有价凭证不承担保管责任。

#### （八）与基金财产有关的重大合同的保管

由基金管理人代表基金签署的、与基金财产有关的重大合同的原件分别由基金管理人、基金托管人保管。除本协议另有规定外，基金管理人代表基金签署的与基金财产有关的重大合同应保证基金管理人和基金托管人至少各持有一份正本的原件。基金管理人应在重大合同签署后及时将重大合同传真给基金托管人，并在三十个工作日内将正本送达基金托管人处。重大合同的保管期限为基金合同终止后 15 年。

## 五、基金资产净值计算和会计核算

### （一）基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序

#### 1.基金资产净值

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。

嘉实多利基金份额的份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数，基金份额净值的计算，精确到 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入，国家另有规定的，从其规定。

基金管理人每个工作日计算基金资产净值及嘉实多利基金份额的份额净值、嘉实多利优先份额的份额净值与嘉实多利进取份额的份额净值，经基金托管人复核，按规定公告。

嘉实多利优先份额的份额净值与嘉实多利进取份额的份额净值应按照基金合同的规定进行计算并公告。

#### 2.复核程序

基金管理人每工作日对基金资产进行估值后，将嘉实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额的份额净值与嘉实多利进取份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

3.根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致意见的，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### （二）基金资产估值方法和特殊情形的处理

#### 1.估值对象

基金所拥有的股票、权证、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产。

#### 2.估值方法

a、证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息（自债券计息起始日或上一起息日至估值当日的利息）得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；

(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

b、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

c、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。

d、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。

e、如有确凿证据表明按上述方法进行估值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，按最能反映公允价值的价格估值。

f、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律

法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

### 3.特殊情形的处理

基金管理人、基金托管人按估值方法的第 e 项进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理。

#### (三) 估值错误的处理方式

(1) 当嘉实多利基金份额净值小数点后 4 位以内(含第 4 位)发生差错时，视为基金份额净值错误；基金份额净值出现错误时，基金管理人应当立即予以纠正，通报基金托管人，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告；当发生净值计算错误时，由基金管理人负责处理，由此给基金份额持有人和基金造成损失的，应由基金管理人先行赔付，基金管理人按差错情形，有权向其他当事人追偿。

(2) 当基金份额净值计算差错给基金和基金份额持有人造成损失需要进行赔偿时，基金管理人和基金托管人应根据实际情况界定双方承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿：

①本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，与本基金有关的会计问题，如经双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按基金管理人的建议执行，由此给基金份额持有人和基金财产造成的损失，由基金管理人负责赔付。

②若基金管理人计算的基金份额净值已由基金托管人复核确认后公告，由此给基金份额持有人造成损失的，应根据法律法规的规定对投资者或基金支付赔偿金，就实际向投资者或基金支付的赔偿金额，基金管理人与基金托管人按照过错程度各自承担相应的责任。

③如基金管理人和基金托管人对基金份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对或对基金管理人采用的估值方法，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布基金份额净值的情形，以基金管理人的计算结果对外公布，由此给基金份额持有人和基金造成的损失，由基金管理人负责赔付。

④由于基金管理人提供的信息错误（包括但不限于基金申购或赎回金额等），进而导致基金份额净值计算错误而引起的基金份额持有人和基金财产的损失，由基金管理人负责赔付。

(3) 由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金份额净值计算错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基

金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(4) 基金管理人和基金托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差，以基金管理人计算结果为准。

(5) 前述内容如法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业另有通行做法，双方当事人应本着平等和保护基金份额持有人利益的原则进行协商。

#### (四) 暂停估值与公告基金份额净值的情形

(1) 基金投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；  
(2) 因不可抗力或其他情形致使基金管理人、基金托管人无法准确评估基金资产价值时；  
(3) 占基金相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而基金管理人为保障投资人的利益，已决定延迟估值；如果出现基金管理人认为属于紧急事故的任何情况，导致基金管理人不能出售或评估基金资产时；

(4) 中国证监会和基金合同认定的其他情形。

#### (五) 基金会计制度

按国家有关部门规定的会计制度执行。

#### (六) 基金账册的建立

基金管理人和基金托管人在基金合同生效后，应按照双方约定的同一记账方法和会计处理原则，分别独立地设置、登录和保管本基金的全套账册，对相关各方各自的账册定期进行核对，互相监督，以保证基金资产的安全。若基金管理人和基金托管人对会计处理方法存在分歧，应以基金管理人的处理方法为准。若当日核对不符，暂时无法查找到错账的原因而影响到基金资产净值的计算和公告的，以基金管理人的账册为准。

#### (七) 基金财务报表与报告的编制和复核

##### 1. 财务报表的编制

基金财务报表由基金管理人编制，基金托管人复核。

##### 2. 报表复核

基金托管人在收到基金管理人编制的基金财务报表后，进行独立的复核。核对不符时，应及时通知基金管理人共同查出原因，进行调整，直至双方数据完全一致。

##### 3. 财务报表的编制与复核时间安排

基金管理人、基金托管人应当在每月结束后 5 个工作日内完成月度报表的编制及复核；在每个季度结束之日起 15 个工作日内完成基金季度报告的编制；在上半年结束之日起 60 日内完成基金半年度报告的编制及复核；在每年结束之日起 90 日内完成基金年度报告的编制及复核。基金托管人在复核过程中，发现双方的报表存在不符时，基金管理人和基金托管人应共同查明原因，进行调整，调整以国家有关规定为准。基金年度报告的财务会计报告应当经过审计。基金合同生效不足两个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或者年度报告。

## 六、基金份额持有人名册的登记与保管

基金份额持有人名册至少应包括基金份额持有人的名称、证件号码和持有的基金份额。基金份额持有人名册由基金注册登记机构根据基金管理人的指令编制和保管，基金管理人和基金托管人应分别保管基金份额持有人名册，保存期不少于 15 年。如不能妥善保管，则按相关法规承担责任。

在基金托管人要求或编制半年报和年报前，基金管理人应将有关资料送交基金托管人，不得无故拒绝或延误提供，并保证其真实性、准确性和完整性。基金管理人和托管人不得将所保管的基金份额持有人名册用于基金托管业务以外的其他用途，并应遵守保密义务。

## 七、托管协议的变更、终止与基金财产的清算

### （一）托管协议的变更程序

本协议双方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与基金合同的规定有任何冲突。基金托管协议的变更报中国证监会核准或备案后生效。

### （二）基金托管协议终止出现的情形

- 1.基金合同终止；
- 2.基金托管人解散、依法被撤销、破产或由其他基金托管人接管基金资产；
- 3.基金管理人解散、依法被撤销、破产或由其他基金管理人接管基金管理权；
- 4.发生法律法规或基金合同规定的终止事项。

### （三）基金财产的清算

#### 1.基金财产清算组

(1)基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

(2)基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

(3)在基金财产清算过程中，基金管理人和基金托管人应各自履行职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(4)基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

#### 2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

- (1)基金合同终止后，发布基金财产清算公告；
- (2)基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

- (3)对基金财产进行清理和确认;
- (4)对基金财产进行估价和变现;
- (5)聘请会计师事务所对清算报告进行审计;
- (6)聘请律师事务所出具法律意见书;
- (7)将基金财产清算结果报告中国证监会;
- (8)参加与基金财产有关的民事诉讼;
- (9)公布基金财产清算结果;
- (10)对基金剩余财产进行分配。

### 3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组优先从基金财产中支付。

### 4.基金财产按下列顺序清偿：

- (1)支付清算费用;
- (2)交纳所欠税款;
- (3)清偿基金债务;
- (4)按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

基金财产未按前款(1)－(3)项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，分别计算嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各自的应计分配比例，并据此由嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各自的基金份额持有人根据其持有的基金份额比例进行分配。

经基金份额持有人大会决议通过，并经中国证监会核准，在本基金的嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后，如果本基金进行基金财产清算，则依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

### 5.基金财产清算的公告

基金财产清算公告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

### 6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 15 年以上。



## 八、争议解决方式

因本协议产生或与之相关的争议，双方当事人应通过协商、调解解决，协商、调解不能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，双方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，各自继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同和本托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

## 第二十八部分 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务，并将根据基金份额持有人的需要和市场的变化，增加或变更服务项目。主要服务内容如下：

### （一）资料寄送

#### 1、开户确认书和交易对帐单

首次基金交易（除基金开户外其他交易类型）后15个工作日内向基金份额持有人寄送开户确认书和交易对帐单。

#### 2、基金份额持有人对账单

基金管理人在每个季度结束后的15个工作日内向定制纸质对帐单的基金份额持有人寄送季度对账单；每月向定制电子对帐单服务的份额持有人发送电子对帐单。

### （二）定期定额投资计划

基金管理人从2004年8月27日开始正式推出“开放式基金定期定额投资计划”。投资者可通过中国银行、中国农业银行、交通银行等代销机构办理基金定期定额投资业务。

### （三）手机短信服务

基金管理人向定制净值短信的基金份额持有人提供基金净值短信服务。基金份额持有人可通过拨打客户服务电话400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，也可通过基金管理人网站定制短信服务。

### （四）在线服务

通过本基金管理人网站www.jsfund.cn，基金份额持有人还可获得如下服务：

### 1、查询服务

基金份额持有人均可通过基金管理人网站实现基金交易查询、账户信息查询和基金信息查询。

### 2、信息资讯服务

投资者可以利用基金管理人网站获取基金和基金管理人的各类信息，包括基金的法律文件、业绩报告及基金管理人最新动态等资料。

### 3、网上交易

投资者可持中国银行长城借记卡、工商银行借记卡、建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、交通银行太平洋借记卡、招商银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、中国民生银行借记卡、广发理财通卡、北京银行卡、兴业银行卡、浦发银行东方卡或活期一本通账户、中信银行借记卡、光大银行借记卡、富滇商业银行借记卡、长沙银行借记卡、金华借记卡、杭州银行借记卡、顺德农商银行借记卡、上海农商行借记卡、南京银行借记卡、温州银行借记卡、齐鲁银行借记卡、宁波银行借记卡、深圳发展银行借记卡、江苏银行借记卡，东莞银行借记卡登录本基金管理人网站办理相应网上交易和电话交易业务；持建行龙卡储蓄卡、工商银行借记卡、广发银行理财通卡、农行金穗卡、招商银行借记卡、浦发银行东方卡、中国民生银行借记卡、兴业银行银行卡的投资者还可登录本基金管理人网站办理相应基金网上交易定期定额申购业务，具体参见相应的基金公告。

网上交易投资者开通电话交易后可以通过电话交易赎回、转换所持基金份额，持建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、广发银行理财通卡、招行借记卡、中国民生银行借记卡、浦发银行东方卡可以通过电话交易系统购买基金。

### （五）咨询服务

1、投资者或基金份额持有人如果了解申购与赎回的交易情况、基金账户余额、基金产品与服务等信息，可拨打基金管理人全国统一客服电话：400-600-8800（免长途话费）、（010）85712266，或传真：（010）65182266。

### 2、网站和电子信箱

公司网址：<http://www.jsfund.cn>

电子信箱：[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)

## 第二十九部分 其他应披露事项

### 一、基金管理人发布的本基金的临时报告

自 2011 年 2 月 19 日首次披露本基金招募说明书至 2011 年 9 月 23 日，本基金的临时报告刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》。

序号	临时报告名称	披露日期	备注
1	关于增加交通银行为嘉实多利分级债券基金代销机构的公告	2011 年 2 月 22 日	
2	嘉实多利分级债券型证券投资基金上网发售提示性公告	2011 年 2 月 24 日	
3	关于增加中国工商银行和洛阳银行为嘉实多利分级债券基金代销机构的公告	2011 年 2 月 24 日	
4	关于嘉实多利分级债券基金份额发售公告的更正公告	2011 年 2 月 24 日	
5	关于增加中国民生银行为嘉实多利分级债券等三只基金代销机构的公告	2011 年 3 月 3 日	
6	关于增加中信银行为嘉实多利分级债券基金代销机构的公告	2011 年 3 月 4 日	
7	关于增加中国光大银行为嘉实多利分级债券基金代销机构的公告	2011 年 3 月 14 日	
8	嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同生效公告	2011 年 3 月 24 日	
9	嘉实多利分级债券型证券投资基金场内认购份额分拆公告	2011 年 4 月 1 日	
10	嘉实多利分级债券型证券投资基金之多利优先与多利进取基金份额上市交易公告书	2011 年 5 月 3 日	
11	嘉实多利分级债券型证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	2011 年 5 月 3 日	
12	关于开通嘉实多利分级债券型证券投资基金份额配对转换业务的公告	2011 年 5 月 3 日	
13	关于开通嘉实多利分级债券型证券投资基金系统内转托管和跨系统转托管业务的公告	2011 年 5 月 3 日	
14	关于通过代销机构网上申购嘉实多利分级债券基金费率优惠的公告	2011 年 5 月 5 日	
15	关于嘉实多利分级债券开办定投业务及其费率优惠的公告	2011 年 5 月 5 日	
16	嘉实多利分级债券型证券投资基金 (LOF) 之嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易提示性公告	2011 年 5 月 6 日	
17	嘉实基金管理有限公司董事长变更公告	2011 年 5 月 11 日	
18	关于对中国工商银行借记卡持卡人通过嘉实直	2011 年 6 月 9 日	含本基金

	销网上交易的在线支付方式申购费率优惠促销的公告	日	
19	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务增加建行收款账户的公告	2011年8月1日	含本基金
20	嘉实基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	2011年8月5日	
21	关于旗下开放式基金通过国都证券和民生证券开办定投业务的公告	2011年8月19日	含本基金
22	关于对中国农业银行借记卡持卡人开展嘉实基金网上直销交易费率优惠的公告	2011年9月1日	含本基金

## 二、基金托管人发布的临时报告

招商银行股份有限公司于2011年7月29日在《证券时报》上发布《关于招商银行股份有限公司总行资产托管部夏博辉同志通知离任公告》

## 第三十部分 招募说明书存放及查阅方式

本《招募说明书》存放在基金管理人、基金托管人及基金代销机构住所，投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。基金管理人和基金托管人保证其所提供的文本的内容与所公告的内容完全一致。

## 第三十一部分 备查文件

1. 中国证监会核准嘉实多利分级债券型证券投资基金募集的文件；
2. 《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》；
3. 《嘉实多利分级债券型证券投资基金托管协议》；
4. 法律意见书；
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照；
6. 基金托管人业务资格批件和营业执照；
7. 中国证监会要求的其他文件。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

**嘉实基金管理有限公司**

**2011年11月26日**