

# 嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金更新招募说明书摘

## 要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金根据 2013 年 4 月 18 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金募集的批复》（证监许可【2013】363 号）注册募集。本基金基金合同于 2014 年 12 月 26 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。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本基金合同的当事人，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《证券投资基金法》、《运作办法》、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。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。

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 2016 年 6 月 26 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 3 月 31 日（未经审计）。

一、基金管理人（一）基金管理人基本情况 1、基本信息

名称 嘉实基金管理有限公司

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层  
09-11 单元

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 邓红国

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%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 30%，  
立信投资有限责任公司 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，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、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。

（二）主要人员情况 1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会银行监管三部副主任、四部主任；中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014 年 12 月 2 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，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、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总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自 1996 年加

入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008 年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

陈春艳女士，董事，硕士研究生。曾任中诚信托有限责任公司资金信贷部、信托开发部、信托事务部、信托业务一部、投资管理部信托经理、高级经理。

2010 年 11 月至今任中诚信托有限责任公司股权管理部部门负责人、部门经理。

Jonathan Paul Eilbeck 先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任 Sena Consulting 公司咨询顾问，JP Morgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JP Morgan Chase 固定收益亚太区 CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008 年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

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 2 月至 2000 年 5 月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。

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。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

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。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

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有限公司，历任督察员和公司副总经理。

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。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

## 2、基金经理

### （1）现任基金经理

李欣先生，硕士研究生，5年证券从业经历。曾任普华永道高级精算师、中国国际金融有限公司研究员、海通证券股份有限公司高级分析师。2014年9月加入嘉实基金管理有限公司研究部，任研究员一职。2016年7月23日起担任本基金基金经理。

### （2）历任基金经理

张琦女士，2014年12月26日至2016年7月23日担任本基金基金经理。

## 3、投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼公司首席投资官（股票业务）邵健先生，公司总经理赵学军先生，公司研究总监陈少平女士，资深基金经理邹唯先生、邵秋涛先生、胡涛先生，定量投资部负责人张自力先生。

## 4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人一、基金托管人情况

### (一) 基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2015 年末，本集团资产总额 18.35 万亿元，较上年增长 9.59%；客户贷款和垫款总额 10.49 万亿元，增长 10.67%；客户存款总额 13.67 万亿元，增长 5.96%。净利润 2,289 亿元，增长 0.28%；营业收入 6,052 亿元，增长 6.09%，其中，利息净收入增长 4.65%，手续费及佣金净收入增长 4.62%。平均资产回报率 1.30%，加权平均净资产收益率 17.27%，成本收入比 26.98%，资本充足率 15.39%，主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展，综合性网点数量达 1.45 万个，综合营销团队 2.15 万个，综合柜员占比达到 88%。启动深圳等 8 家分行物理渠道全面转型创新试点，智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显，电子银行和自助渠道账务性交易量占比达 95.58%，较上年提升 7.55 个百分点；同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式，成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量 8,074 万张，消费交易额 2.22 万亿元，多项核心指标继续保持同业领先。金融资产 1,000 万以上的私人银行客户数量增长 23.08%，客户金融资产总量增长 32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销

5,316 亿元，承销额市场领先。资产托管业务规模 7.17 万亿元，增长 67.36%；托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破，继伦敦之后，再获任瑞士、智利人民币清算行资格；上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015 年，本集团先后获得国内外各类荣誉总计 122 项，并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志 2015 年“世界银行品牌 1000 强”中，以一级资本总额位列全球第二；在美国《福布斯》杂志 2015 年度全球企业 2000 强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## （二）主要人员情况

赵观甫，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种

不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2016 年一季度末，中国建设银行已托管 584 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自 2009 年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

三、相关服务机构（一） 基金份额发售机构 1、直销机构：嘉实基金管理有限公司直销中心、上海直销中心、深圳、成都、青岛、杭州、福州、南京、广州分公司和嘉实网上交易。

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址 北京市东城区建国门南大街 7 号万豪中心 D 座 12 层

电话 （010）65215588 传真 （010）65215577

联系人 赵佳

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址 上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元

电话 （021）38789658 传真 （021）68880023

联系人 邵琦

（3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址 成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元

电话 （028）86202100 传真 （028）86202100

联系人 王启明

（4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址 深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层

电话 （0755）25870686 传真 （0755）25870663

联系人 陈寒梦

（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）66777666 传真 （0532）66777676

联系人 胡洪峰

(6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址 杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城 2 幢 1001A 室

电话 (0571) 88061392 传真 (0571) 88021391

联系人 王振

(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 吴志锋

(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 徐莉莉

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址 广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心 50 层 05-06A 单元

电话 (020) 87555163 传真 (020) 81552120

联系人 周炜

## 2、代销机构

### 1. 中国银行股份有限公司

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

注册地址 北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人 田国立

电话 (010) 66596688 传真 (010) 66594946

网址 [www.boc.cn](http://www.boc.cn) 客服电话 95566

### 2. 中国建设银行股份有限公司

住所 北京市西城区金融大街 25 号



办公地址 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心

法定代表人 王洪章

网址 [www.ccb.com](http://www.ccb.com) 客服电话 95533

3. 交通银行股份有限公司

办公地址 上海市银城中路188号

注册地址 上海市银城中路188号

法定代表人 牛锡明 联系人 张宏革

电话 021-58781234 传真 021-58408483

网址 [www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com) 客服电话 95559

4. 招商银行股份有限公司

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 李建红 联系人 邓炯鹏

电话 (0755) 83198888 传真 (0755) 83195050

网址 [www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com) 客服电话 95555

5. 中信银行股份有限公司

住所、办公地址 北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人 常振明 联系人 廉赵峰

网址 [bank.ecitic.com](http://bank.ecitic.com) 客服电话 95558

6. 上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址 上海市中山东一路12号

注册地址 上海市中山东一路12号

法定代表人 吉晓辉 联系人 高天、虞谷云

电话 (021) 61618888 传真 (021) 63604199

网址 [www.spdb.com.cn](http://www.spdb.com.cn) 客服电话 95528

7. 平安银行股份有限公司

住所、办公地址 广东省深圳市深南东路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 0755-22166118 传真 0755-82080406

网址 [www.bank.pingan.com](http://www.bank.pingan.com) 客服电话 95511-3 或 95501

8. 北京农村商业银行股份有限公司

办公地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦

注册地址 北京市朝阳区朝阳门北大街 16 号元亨大厦

法定代表人 王金山 联系人 王薇娜

电话 (010) 85605006 传真 (010) 85605345

网址 [www.bjrcb.com](http://www.bjrcb.com) 客服电话 96198

9. 徽商银行股份有限公司

住所、办公地址 安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座

法定代表人 李宏鸣 联系人 叶卓伟

电话 (0551) 62667635 传真 (0551) 62667684

网址 [www.hsbank.com.cn](http://www.hsbank.com.cn) 客服电话 4008896588

10. 江苏银行股份有限公司

住所、办公地址 南京市洪武北路 55 号

法定代表人 夏平 联系人 展海军

电话 (025) 58587018 传真 (025) 58587038

网址 [www.jsbchina.cn](http://www.jsbchina.cn) 客服电话 (025) 96098、4008696098

11. 深圳农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址 广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦

法定代表人 李伟 联系人 王璇

电话 0755-25188269 传真 0755-25188785

网址 [www.4001961200.com](http://www.4001961200.com) 客服电话 961200 (深圳) 4001961200 (全国)

12. 洛阳银行股份有限公司

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 董鹏程

电话 (0379) 65921977 传真 (0379) 65921869

网址 [www.bankofluoyang.com.cn](http://www.bankofluoyang.com.cn) 客服电话 (0379) 96699

13. 乌鲁木齐商业银行股份有限公司

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](http://www.uccb.com.cn) 客服电话 (0991) 96518

14. 哈尔滨银行股份有限公司

住所、办公地址 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

法定代表人 郭志文 联系人 王超

电话 0451-86779007 传真 0451-86779218

网址 [www.hrbb.com.cn](http://www.hrbb.com.cn) 客服电话 95537

15. 东莞农村商业银行股份有限公司

住所 东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦。

办公地址 东莞市东城区鸿福东路 2 号东莞农商银行大厦

法定代表人 何沛良 联系人 谭少筠

电话 0769-22866255 传真 0769-22866282

网址 [www.drcbank.com](http://www.drcbank.com) 客服电话 (0769) 961122

16. 天津银行股份有限公司

住所、办公地址 天津市河西区友谊路 15 号

法定代表人 王金龙 联系人 杨森

电话 (022) 28405330 传真 (022) 28405631

网址 [www.bank-of-tianjin.com](http://www.bank-of-tianjin.com) 客服电话 4006-960296

17. 河北银行股份有限公司

住所、办公地址 石家庄市平安北大街 28 号

法定代表人 乔志强 联系人 王娟

电话 0311-88627587 传真 0311-88627027

网址 [www.hebbank.com](http://www.hebbank.com) 客服电话 4006129999

18. 重庆农村商业银行股份有限公司

办公地址 重庆市江北区洋河东路 10 号

注册地址 重庆市江北区洋河东路 10 号

法定代表人 刘建忠 联系人 范亮

电话 023-67637962 传真 023-67637709

网址 [www.cqrcb.com](http://www.cqrcb.com) 客服电话 966866

19. 苏州银行股份有限公司

办公地址 江苏省苏州市钟园路 728 号

注册地址 江苏省苏州市东吴北路 143 号

法定代表人 王兰凤 联系人 熊志强

电话 0512-69868390 传真 0512-69868370

网址 [www.suzhoubank.com](http://www.suzhoubank.com) 客服电话 0512-96067

20. 福建海峡银行股份有限公司

办公地址 福建省福州市晋安区六一北路 158 号

注册地址 福建省福州市晋安区六一北路 158 号

法定代表人 苏素华 联系人 黄钰雯

电话 0591-83967183 传真 0591-87330926

网址 [www.fjhxbank.com](http://www.fjhxbank.com) 客服电话 4008939999

21. 和讯信息科技有限公司

办公地址 北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

注册地址 北京市朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人 王莉 联系人 刘洋

电话 021-20835785 传真 021-20835879

网址 [licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com) 客服电话 4009200022

22. 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

注册地址 上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

法定代表人 汪静波 联系人 李娟

电话 021-80359115 传真 021-38509777

网址 [www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com) 客服电话 400-821-5399

23. 深圳众禄金融控股股份有限公司

办公地址 深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

注册地址 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行 25 层 IJ 单元

法定代表人 薛峰 联系人 童彩平

电话 0755-33227950 传真 0755-33227951

网址 [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn) 客服电话 4006-788-887

24. 上海天天基金销售有限责任公司

办公地址 上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 10 楼

注册地址 上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人 其实 联系人 潘世友

电话 021-54509998 传真 021-64385308

网址 <http://www.1234567.com.cn/> 客服电话 400-1818-188

25. 上海好买基金销售有限公司

办公地址 上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

注册地址 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人 杨文斌 联系人 张茹

电话 021-20613999 传真 021-68596916

网址 [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com) 客服电话 4007009665

26. 杭州数米基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

注册地址 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

法定代表人 陈柏青 联系人 张裕

电话 021-60897840 传真 0571-26697013

网址 <http://www.fund123.cn/> 客服电话 4000-766-123

27. 上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址 上海市浦东新区浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

注册地址 上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

法定代表人 张跃伟 联系人 单丙焱

电话 021-20691869 传真 021-20691861  
网址 [www.erichfund.com](http://www.erichfund.com) 客服电话 400-089-1289

28. 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址 浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼  
注册地址 浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室  
法定代表人 凌顺平 联系人 林海明  
传真 0571-86800423  
网址 [www.5ifund.com](http://www.5ifund.com) 客服电话 4008-773-772

29. 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址 北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层  
注册地址 北京市顺义区后沙峪镇安富街6号  
法定代表人 闫振杰 联系人 李静如  
电话 010-59601366-7024  
网址 [www.myfund.com](http://www.myfund.com) 客服电话 4008886661

30. 上海利得基金销售有限公司

办公地址 上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼  
注册地址 上海市宝山区蕴川路5475号1033室  
法定代表人 沈继伟 联系人 曹怡晨  
电话 021-50583533 传真 021-50583633  
网址 [a.leadfund.com.cn](http://a.leadfund.com.cn) 客服电话 400-067-6266

31. 嘉实财富管理有限公司

住所、办公地址 上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心2期53层12-15单元  
法定代表人 赵学军 联系人 景琪  
电话 021-38789658 传真 021-68880023  
网址 [www.harvestwm.cn](http://www.harvestwm.cn) 客服电话 400-021-8850

32. 众升财富（北京）基金销售有限公司

办公地址 北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼3201内3201单元

注册地址 北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元  
法定代表人 李招弟 联系人 高晓芳  
电话 010-59393923 传真 010-59393074  
网址 [www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com) 客服电话 400-059-8888

33. 中经北证（北京）资产管理有限公司  
办公地址 北京市西城区北礼士路甲 129 号 3 号楼创新工场一层 109-1  
注册地址 北京市西城区北礼士路甲 129 号  
法定代表人 徐福星 联系人 徐娜  
电话 010-68292940 传真 010-68292941  
网址 [www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com) 客服电话 010-68292745

34. 上海汇付金融服务有限公司  
办公地址 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼  
注册地址 上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼  
法定代表人 冯修敏 联系人 陈云卉  
电话 021-33323998 传真 021-33323837  
网址 暂无 客服电话 400-820-2819

35. 上海中正达广投资管理有限公司  
办公地址 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室  
注册地址 上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室  
法定代表人 黄欣 联系人 戴珉微  
电话 021-33768132 传真 021-33768132\*802  
网址 <http://www.zzwealth.cn> 客服电话 400-6767-523

36. 北京乐融多源投资咨询有限公司  
办公地址 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室  
注册地址 北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603 室  
法定代表人 董浩 联系人 张婷婷  
电话 18510450202 传真 010-56580660  
网址 [www.jimufund.com](http://www.jimufund.com) 客服电话 400-068-1176

37. 上海陆金所资产管理有限公司

办公地址 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

注册地址 上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

法定代表人 郭坚 联系人 宁博宇

电话 021-20665952 传真 021-22066653

网址 [www.lufunds.com](http://www.lufunds.com) 客服电话 4008219031

38. 大泰金石投资管理有限公司

办公地址 上海市浦东新区峨山路 505 号东方纯一大厦 15 楼中心

注册地址 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人 袁顾明 联系人 朱海涛

电话 15921264785 传真 021-20324199

网址 <http://www.dtfunds.com> 客服电话 400-928-2266

39. 珠海盈米财富管理有限公司

办公地址 广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

注册地址 广东省珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

法定代表人 肖雯 联系人 黄敏嫦

电话 020-89629019 传真 020-89629011

网址 [www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn) 客服电话 020-89629066

40. 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

办公地址 北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区 A 座 5 层

注册地址 北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

法定代表人 彭运年 联系人 仲甜甜

电话 010-59336492 传真 010-59336510

网址 [www.jnlc.com/](http://www.jnlc.com/) 客服电话 010-59336512

41. 泉州银行股份有限公司

办公地址 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

注册地址 福建省泉州市丰泽区云鹿路 3 号

法定代表人 傅子能 联系人 董培姗、王燕玲



电话 0595-22551071 传真 0595-22578871  
网址 <http://www.qzccb.com> 客服电话 4008896312

42. 锦州银行股份有限公司

办公地址 辽宁省锦州市科技路 68 号  
注册地址 辽宁省锦州市科技路 68 号  
法定代表人 张伟 联系人 张华阳  
电话 0416-3220085 传真 0416-3220017  
网址 [www.jinzhoubank.com](http://www.jinzhoubank.com) 客服电话 400-6696178

43. 浙江乐清农村商业银行股份有限公司

办公地址 浙江省乐清市城南街道伯乐西路 99 号  
注册地址 浙江省乐清市城南街道伯乐西路 99 号  
法定代表人 高剑飞 联系人 金晓娇  
电话 0577-61566028 传真 0577-61566063  
网址 [www.yqbank.com](http://www.yqbank.com) 客服电话 4008896596

44. 天津滨海农村商业银行股份有限公司

办公地址 天津自贸区（空港经济区）西三道 158 号金融中心 1 号楼  
注册地址 天津自贸区（空港经济区）西三道 158 号金融中心 1 号楼  
法定代表人 赵峰 联系人 姬娜  
电话 022-84819689 传真 022-84819692  
网址 [www.tjbhb.com](http://www.tjbhb.com) 客服电话 (022)96156

45. 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 刘阳  
电话 (0755) 83516289 传真 (0755) 83515567  
网址 [www.cgws.com](http://www.cgws.com) 客服电话 4006666888、(0755) 33680000

46. 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 薛峰 联系人 刘晨、李芳芳

电话 (021) 22169999 传真 (021) 22169134  
网址 [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com) 客服电话 4008888788、10108998

47. 国都证券股份有限公司

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](http://www.guodu.com) 客服电话 400-818-8118

48. 中国国际金融有限公司

住所 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
办公地址 北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层  
法定代表人 李剑阁 联系人 廉赵峰  
电话 (010) 65051166 传真 (010) 85679535  
网址 [www.ciccs.com.cn](http://www.ciccs.com.cn) 客服电话 (010) 85679238; (010) 85679169

49. 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 洪家新 联系人 孔泉  
电话 (0755) 82083788 传真 (0755) 82083408  
网址 [www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn) 客服电话 (021) 32109999, (029) 68918888

50. 华宝证券有限责任公司

住所、办公地址 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层  
法定代表人 陈林 联系人 夏元  
电话 (021) 68777222 传真 (021) 68777822  
网址 [www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com) 客服电话 4008209898

51. 宏信证券有限责任公司

办公地址 四川成都市人民南路2段18号川信大厦10楼  
注册地址 四川成都市人民南路2段18号川信大厦11楼  
法定代表人 吴玉明 联系人 刘进海  
电话 028-86199278 传真 028-86199382

网址 [www.hxzq.cn](http://www.hxzq.cn) 客服电话 4008366366

52. 联讯证券股份有限公司

办公地址 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

注册地址 广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人 徐刚 法定代表人 徐刚

电话 0752-2119700 电话 0752-2119700

网址 [www.lxsec.com](http://www.lxsec.com) 网址 [www.lxsec.com](http://www.lxsec.com)

(二) 基金注册登记机构嘉实基金管理有限公司 (同上)

(三) 律师事务所和经办律师名称 上海市通力律师事务所

住所、办公地址 上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人 俞卫锋 联系人 黎明

电话 (021) 31358666 传真 (021) 31358600

经办律师 吕红、黎明

(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 (特殊普通合伙)

住所 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址 上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼

法定代表人 李丹 联系人 张勇

电话 (021) 23238888 传真 (021) 23238800

经办注册会计师 许康玮、张勇

四、基金的名称本基金名称：嘉实沪深 300 指数研究增强型证券投资基金

五、基金的类型本基金类型：股票型证券投资基金，契约型开放式

六、基金的投资目标本基金为增强型指数基金，力求对标的指数（沪深 300 指数）进行有效跟踪的基础上，通过精选个股策略增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。本基金力争使日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

七、基金的投资范围

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，债券（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）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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）。

本基金资产配置范围：本基金以标的指数（沪深 300 指数）成份股及备选成份股为主要投资对象。股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于沪深 300 指数成份股及备选成份股的资产不低于基金非现金资产的 80%。在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略本基金以谋求基金资产的长期增值为目标，主要采用指数增强的投资策略，以沪深 300 作为基金投资组合的标的指数，结合深入的基本面研究及指数化管理的基础上优化投资组合，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。

#### 1、大类资产配置

本基金作为增强指数型基金，以跟踪沪深 300 指数为主，将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制基金跟踪误差的前提下，通过对基本面的深入研究谋求基金在偏离风险及超额收益间的最佳配置。

#### 2、股票投资策略

本基金主要采用指数增强投资策略。在复制沪深 300 指数的基础上，利用基金管理人的研究成果，对标的指数适当有效的偏离，通过指数增强力求获取超越业绩比较基准的超额收益。

##### （1）标的指数

本基金标的指数沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，沪深证券交易所授权，可以反映中国 A 股市场的指数。它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票，具备市场覆盖度广、剪表性强、剪动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势。

## （2）增强策略

本基金管理人凭借丰富的指数管理经验以及过硬的指数跟踪技术，在严格控制本基金组合跟踪误差、组合偏离度的基础上，利用嘉实“自下而上”个股精选策略在控制指数跟踪误差的同时增强基金阿尔法收益，力争超越标的指数收益率。

随着中国经济进一步发展，公司治理结构不断完善，中国经济还将不断涌现出可供投资的优质上市公司。基金经理通过设计多层系统的方式实现上市公司信息的收集，以便于寻找到具备基本面健康、核心竞争力强、成长潜力大的投资标的。嘉实通过实地调研并结合案头研究的方式对企业基本面进行深入细致的研究并运用定量和定性的研究方法挖掘具有长期潜在投资价值的企业。具体分为行业分析、商业模式及市场定位、财务分析和合理估值四个层级进行股票筛选：

### 1) 行业分析

包括对宏观经济环境与政策分析、上下游产业链分析、供求分析、产品生命周期分析、竞争格局分析。通过行业分析，发现行业整体投资机会，为分析重点龙头公司和潜在高增长公司的投资价值提供支持。

### 2) 公司商业模式及市场定位研究

我们并不基于表面观察到的增长或价值特征对股票进行提前判断，而是对公司的各个方面进行详细的分析。基金经理对重点公司进行研究分析，具体内容包括：

- ① 目标公司的优势、弱点、机遇和威胁的 SWOT 分析
- ② 该公司已经发生和正在发生的变化
- ③ 公司商业模式和战略分析
- ④ 公司的治理结构分析
- ⑤ 公司制度建设与对外发布信息透明程度

### 3) 财务分析

包括对资产负债表、利润表、现金流量表分析，考察分析公司的财务健康程度，以及由财务报表分析反映出的公司经营业绩、特点。以上财务分析和公司研究均要求分析师进行上市公司的实地调研和考察。

### 4) 合理估值

- ① 2-3 年盈利预测，以及重要资产负债表和现金流项目预测
- ② 主要假设的敏感性分析
- ③ 选定最合理的估值方法：PE, EV/EBITDA, P/B, Price/Sales, DCF 或其他
- ④ 确定合理的估值溢价或折价
- ⑤ 确定公司目标价格

⑥ 通过与其它方法比较来测试该方法的合理性

(3) 组合调整策略

1) 定期调整

本基金将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整，达到有效控制跟踪偏离度和跟踪误差的目的。

2) 不定期调整

① 与标的指数相关的调整

当沪深 300 指数编制规则、成份股及其权重反正变化（包括配送股、新股上市、临时调入或者调出成份股等）原因，本基金将参考标的指数最新权重比例，进行相应调整。

② 应对日常业务的调整

由于本基金申购、赎回、转换等业务需要基金保留一定比例现金并造成基金现金比例变化使得跟踪误差在短期内可能会加大。基金管理人将综合考虑市场趋势、基金持有人盈亏比例、历史现金流表现等因素预判应对申购、赎回、转换等业务所需现金流，从而有效跟踪标的指数。

3) 特殊情形下的调整

本基金在某些特殊情形下将选择其他股票或股票组合对标的指数中的成份股加以替换，这些情形包括：

① 法律法规限制

② 个别成份股流动性严重不足使基金无法买入足够的股票数量

③ 相关上市公司停牌导致基金无法及时买入成份股

④ 成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼等使基金资产面临重大风险。

(4) 跟踪误差控制

本基金为增强指数型基金，通过适度的主动投资获取超出投资标的超额收益，同时也承担相应偏离标的指数导致跟踪误差较大的风险。

本基金将密切关注基金的实际跟踪误差，及时调整基金投资组合，在尽可能不影响超额收益“阿尔法”的前提下降低跟踪误差。

3、债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势

以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

#### 4、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

#### 5、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

#### 6、风险管理策略

本基金严格执行投资风险管理，主要通过对股票资产相对于业绩基准的跟踪误差及行业分布的偏离进行严格控制来固化和明晰基金的风格特征。本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如 Barra 多因子模型、风险预算模型等，并结合公司现有的风险管理流程，在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。

具体而言，在大类资产配置策略的风险控制上，由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控；在行业配置策略的风险控制上，风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外，也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上，本基金将严格遵守公司的内部规章制度，控制单一个股投资风险。

#### 7、投资决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的投资决策依据。

#### 8、投资管理体制

投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、

调整决策。

## 9、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

(1) 研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台，整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

(3) 组合构建：根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，基金经理主要以指数增强投资策略构建组合，通过对标的指数适当有效的偏离，力求获取超越业绩比较基准的超额收益。

(4) 交易执行：中央交易部门负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检视和不断改进投资管理方法。

(6) 组合监控与调整：基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数，以实现跟踪误差和跟踪偏离度的有效控制。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金的业绩比较基准  $\text{沪深 300 指数收益率} \times 95\% + \text{银行活期存款利率 (税后)} \times 5\%$

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票，具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实反映本基金的风险收益特征。如果指数编制单位停止计算编制该指数、或今后法律法规发生变化或更改指数名称、或



有更适当的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，经履行适当程序，调整业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征本基金为股票指数增强型基金，本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

十一、基金的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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年4月15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2016年3月31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 293,134,416.84 92.62

其中：股票 293,134,416.84 92.62

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产 --

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

7 银行存款和结算备付金合计 22,420,970.23 7.08

8 其他资产 920,502.06 0.29

合计 316,475,889.13 100.00

#### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资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	--
B 采矿业	7,432,960.47 2.36
C 制造业	66,801,088.62 21.19
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,194,889.00 1.96
E 建筑业	5,014,321.20 1.59
F 批发和零售业	5,292,977.90 1.68
G 交通运输、仓储和邮政业	12,513,407.90 3.97
H 住宿和餐饮业	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	11,346,644.64 3.60
J 金融业	97,975,892.29 31.07
K 房地产业	12,678,207.70 4.02
L 租赁和商务服务业	3,513,239.65 1.11
M 科学研究和技术服务业	--
N 水利、环境和公共设施管理业	3,842,222.65 1.22
O 居民服务、修理和其他服务业	--
P 教育	--
Q 卫生和社会工作	1,483,048.00 0.47
R 文化、体育和娱乐业	3,513,551.40 1.11
S 综合	527,465.41 0.17
合计	238,129,916.83 75.53

(2) 报告期末积极投资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	735,500.00 0.23
B 采掘业	286,440.00 0.09
C 制造业	38,304,398.93 12.15
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,334,275.00 0.42
E 建筑业	2,476.00 0.00
F 批发和零售业	3,101,617.34 0.98
G 交通运输、仓储和邮政业	2,071,780.57 0.66
H 住宿和餐饮业	--
I 信息传输、软件和信息技术服务业	3,318,935.12 1.05
J 金融业	2,277,366.00 0.72

K 房地产业	1,689,219.15	0.54
L 租赁和商务服务业	648,392.90	0.21
M 科学研究和技术服务业	440,781.00	0.14
N 水利、环境和公共设施管理业	--	--
O 居民服务、修理和其他服务业	--	--
P 教育	--	--
Q 卫生和社会工作	32,928.00	0.01
R 文化、体育和娱乐业	760,390.00	0.24
S 综合	--	--
合计	55,004,500.01	17.45

### 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

#### (1) 报告期末指数投资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	000001	平安银行	1,070,254	11,387,502.56	3.61
2	601318	中国平安	353,434	11,242,735.54	3.57
3	601169	北京银行	1,014,020	10,221,321.60	3.24
4	601166	兴业银行	636,766	9,888,975.98	3.14
5	600036	招商银行	574,319	9,240,792.71	2.93
6	601398	工商银行	1,924,172	8,254,697.88	2.62
7	601006	大秦铁路	952,785	6,545,632.95	2.08
8	600340	华夏幸福	242,780	5,894,698.40	1.87
9	601688	华泰证券	334,200	5,718,162.00	1.81
10	600705	中航资本	452,741	5,632,098.04	1.79

#### (2) 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000488	晨鸣纸业	517,600	4,384,072.00	1.39
2	000028	国药一致	38,900	2,481,042.00	0.79

3 600816 安信信托 135,800 2,277,366.00 0.72

4 002439 启明星辰 77,766 1,839,943.56 0.58

5 000418 小天鹅A 57,500 1,457,625.00 0.46

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

6. 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序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(1) 2015年8月25日，华泰证券发布《关于收到中国证监会调查通知书的公告》，证监会决定对公司立案调查；2015年9月11日发布《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，公司如果放弃陈述、申辩和听证的权利，证监会将按照行政处罚事先告知书所述事实、理由和依据作出正式的行政处罚决定。

本基金投资于“华泰证券(601688)”的决策程序说明：基于对华泰证券基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“华泰证券”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无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中，其他九名证券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 30,157.61

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 4,984.66

5 应收申购款 885,359.79

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

合计 920,502.06

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金指数投资前十名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

流通受限情况说明

1 002439 启明星辰 1,839,943.56 0.58 重大事项停牌

十二、基金的业绩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. 本基金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 ③ ④

2014年12月26日（基金合同生效日）至2014年12月31日 0.19% 0.10% 5.64%

1.48% -5.45% -1.38%

2015 年 13.23% 2.32% 5.70% 2.36% 7.53% -0.04%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 3 月 31 日 -12.50% 2.40% -13.03% 2.31% 0.53%

0.09%

## 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

图：嘉实沪深 300 指数研究增强型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

（2014 年 12 月 26 日至 2016 年 3 月 31 日）

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

## 十三、基金的费用与税收（一）与基金运作有关的费用

### 1、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）《基金合同》生效后与基金相关的标的指数使用费；
- （4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- （5）《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所费、律师费和诉讼费；
- （6）基金份额持有人大会费用；
- （7）基金的证券交易费用；
- （8）基金的银行汇划费用；
- （9）按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

### 2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

## (2) 基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.18% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

## (3) 基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。在通常情况下，指数使用许可费按前一日基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日计提的指数使用许可费

E 为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付。根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，标的指数许可使用费的收取下限为每季（自然季度）人民币 50,000 元，计费区间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令，经基金托管人复核后于每年 1 月，4 月，7 月，10 月首日起 10 个工作日内将上季度标的指数许可使用费从基金财产中一次性支付给标的指数许可方。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发

生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

上述“1、基金费用的种类”中第（4）—（9）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、申购费

本基金的申购费用最高不超过申购金额的 5%。

申购费率按申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低，具体如下：

申购金额（含申购费） 申购费率

M<100 万元 1.00%

100 万元≤M<200 万元 0.6%

200 万元≤M<500 万元 0.2%

M≥500 万元 单笔 1000 元

投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。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，不列入基金资产。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购本基金业务实行申购费率优惠，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%，但中国银行长城借记卡、招商银行借记卡、中国农业银行借记卡持卡人，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。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

注：2013 年 4 月 9 日，本公司发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》，自 2013 年 4 月 12 日起，在本公司基金网上直销系统开通旗下 31 只基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠。本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。现根据业务发展，自 2015 年 2 月 26 日起，增加开通本基金的后端收费模式。投资者选择后端收费模式的基金，



其申购、赎回、转换等费率及费率优惠和业务规则，执行 2013 年 4 月 9 日本公司发布的《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》。

本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T） 基金网上直销

后端申购优惠费率

0 年 0.20%

1 年 $\leq$ T 0.10%

T $\geq$ 3 年 0.00%

## 2、赎回费

本基金对基金份额收取赎回费，在投资者赎回基金份额时收取。基金份额的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。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担。对持续持有期少于 7 日的投资人收取 1.5% 的赎回费，对持续持有期大于等于 7 天少于 30 日的投资人收取 0.75% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于 30 天少于 90 天的投资人收取 0.5% 的赎回费，并将赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 90 天少于 180 天的投资人收取 0.5% 的赎回费，并将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 180 天少于 365 天的投资人收取 0.5% 的赎回费，将赎回费总额的 25% 计入基金财产；对持续持有期大于等于 365 天少于 730 天的投资人收取 0.25% 的赎回费，将赎回费总额的 25% 计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（T） 赎回费率

T 1.5%

7 天 $\leq$ T 0.75%

30 天 $\leq$ T 0.5%

365 天 $\leq$ T 0.25%

T $\geq$ 730 天 0

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和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应按照《信息披露办法》的相关规定在调整实施前在指定媒介上公告。

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，针对特定交易方式（如网上交易等）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，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率。

#### 5、转换费

（1）通过代销机构办理基金转换业务（仅限“前端转前端”的模式）

1) 嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转换为嘉实沪深 300 指数研究增强时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F 为转入基金适用的申购费率；

M 为嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实安心货币 A 嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 全部转出时账户当前累计未付收益。

2) 嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C 转换为嘉实沪深 300 指数研究增强时，采用“赎回费+申购费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + F)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

F 为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

3) 嘉实沪深 300 指数研究增强与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实优化红

利混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实低价策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票互转时，以及转入嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实债券、嘉实多元债券 A、嘉实稳固收益债券、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实信用债券 A、嘉实信用债券 C、嘉实中创 400 联接、嘉实纯债债券 A、嘉实纯债债券 C、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实机构快线货币 A 时，仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

4) 嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实中创 400 联接、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证金融地产 ETF 联接转入嘉实沪深 300 指数研究增强时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的固定补差费率：1) 当转出金额  $\geq$  500 万元时，固定补差费率为零；

2) 当转出金额

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

5) 嘉实债券、嘉实多元债券 A、嘉实信用债券 A、嘉实纯债债券 A、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实丰益信用定期债券 A 转入嘉实沪深 300 指数研究增强时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的固定补差费率：1) 当转出金额  $\geq 500$  万元时，固定补差费率为零；

2) 当转出金额

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(2) 通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

1) 嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 转换为嘉实沪深 300 指数研究增强时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = (B \times C) / (1 + F) + M$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F 为转入基金适用的申购费率；

M 为嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实安心货币 A 嘉实安心货币 B、嘉实机构快线货币 A、嘉实机构快线货币 B、嘉实机构快线货币 C 全部转出时账户当前累计未付收益。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

2) 嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 转换为嘉实沪深 300 指数研究增强时, 采用“赎回费+申购费率”算法:

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + F)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

F 为转入基金适用的申购费率;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

3) 嘉实沪深 300 指数研究增强与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实多元债券 A、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实信用债券 A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中创 400 联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券 A、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实增强收益定期债券 A、嘉实低价策略股票、嘉实丰益信用定期债券 A、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票互转, 以及转入嘉实货币 A、嘉实货币 B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券 B、嘉实安心货币 A、嘉实安心货币 B、嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实机构快线货币 A、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 时, 仅收取转出基金的赎回费, 计算公式如下:

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D)$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

(3) 通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式），采用以下规则：

1) 若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

2) 若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

转出基金时，如涉及的转出基金有赎回费用，收取该基金的赎回费用。收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

注 1：2014 年 5 月 23 日起，嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过 500 万元；2014 年 11 月 13 日起，嘉实纯债债券单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过 100 万元；2015 年 7 月 9 日起，嘉实货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过 500 万元；自 2015 年 7 月 22 日起，嘉实安心货币单日单个基金账户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过 200 万元；自 2015 年 11 月 16 日起，嘉实中证中期企业债指数（LOF）单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过 2000 万元；2016 年 4 月 5 日起，嘉实信用债券单日单个基金账户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过 500 万元；2016 年 7 月 11 日起，嘉实丰益纯债单日单个基金账户的累计申购（含转入）金额不得超过 500 万元；2016 年 8 月 8 日起，嘉实新趋势单日单个基金账户的累计申购（含转入、定投）金额不得超过 10 万元，嘉实新常态单日单个基金账户的累计申购（含转入、定投）金额不得超过 1 万元。

嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实对冲套利定期混合、嘉实丰益信用定期债券、嘉实增强收益定期债券为定期开放，在封闭期内无法转换。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

注 2：2013 年 4 月 9 日，本基金管理人发布了《关于网上直销开通基金后端收费模式并实施费率优惠的公告》，自 2013 年 4 月 12 日起，在本公司基金网上直销系统开通旗下部分基金产品的后端收费模式（包括申购、定期定额投资、基金转换等业务）、并对通过本公司基金网上直销系统交易的后端收费进行费率优惠。

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （四）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前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

### （五）税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明本招募说明书依据《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1. 在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。
2. 在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。
3. 在“四、基金托管人”部分：更新了基金托管人的相关信息。
4. 在“五、相关服务机构”部分：更新了相关代销机构信息。
5. 在“九、基金转换”部分：更新了基金转换的相关信息。
6. 在“十一、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。
7. 在“十二、基金的业绩”部分：基金业绩更新至2016年3月31日。
8. 在“二十四、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2015年12月26日至

2016年6月26日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2016年8月8日