

嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2016 年第 1 号)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

重要提示

嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会

2015 年 6 月 25 日

证监许可[2015]1393 号《关于准予嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》注册

募集。本基金基金合同于 2016 年 3 月 30 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 9 月 30 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 9 月 30 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

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。

（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，中共党员。1983年3月至1992年2月任物资部研究室、政策体制法规司

副处长，1992年3月至2003年4月任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，2003年5月至2010年3月任中国银监会银行监管三部副主任、四部主

任，2010年4月至2014年10月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董事、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、副总经理。

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副总经理。

2、基金经理

(1) 现任基金经理

胡永青，硕士研究生。2003年2月至2008年8月就职于天安保险，任固定收益组合经理；2008年8

月至2011年8月就职于信诚基金，任投资经理；2011年8月加入国泰基金管理有限公司，任固定收益

部总监助理，2011年12月5日至2013年10月25日担任国泰双利债券证券投资基金、国泰货币市场证

券投资基金的基金经理，2012年07月31日至2013年10月25日担任国泰信用债券投资基金的基金经

理。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系全回报策略组组长。2014年3月

28日起担任嘉实信用债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益策略定期债券的基金经理。2014年10月

9日起担任嘉实元和直投封闭混合型发起式证券投资基金的基金经理。2015年4月起任嘉实稳固收益

债券型证券投资基金基金经理。2015年12月起任嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金

经理，2016年3月14日至今任嘉实新财富混合基金经理，2016年4月12日至今任嘉实新思路混合基金

经理，2016年4月18日至今任嘉实稳泰债券基金经理，2016年4月29日至今任嘉实稳丰纯债债券基金

经理，2016年5月5日至今任嘉实新起航混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合基金经理，2016年6月

3日至今任嘉实稳盛债券基金经理，2016年3月30日任本基金基金经理。

曲扬女士，经济学硕士，毕业于中央财经大学信息系，具有11年证券从业经验。2004年至2007

年，任中信基金固定收益研究员、交易员；2007年至2010年6月，任中国光大银行债券自营投资业务副

主管；2010年6月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系全回报策略组。2011年11

月 18 日起至 2012 年 11 月 21 日任嘉实稳固收益债券基金经理。2011 年 11 月 18 日至今任嘉实债券基金经理，2012 年 12 月 11 日至今任嘉实纯债债券基金经理，2013 年 5 月 21 日至今任嘉实丰益纯债定期债券基金经理，2014 年 4 月 18 日至今任嘉实稳固收益债券基金经理，2015 年 4 月 18 日至今任嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实中证中期企业债指数（LOF）基金经理，2016 年 3 月 18 日至今任嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券基金经理，2016 年 3 月 30 日至今任嘉实新起航混合、新财富混合基金经理，2016 年 5 月 17 日至今任嘉实稳丰纯债债券基金经理，2016 年 7 月 15 日至今任嘉实稳鑫纯债债券基金经理，2016 年 8 月 26 日至今任嘉实安益混合基金经理，2016 年 9 月 13 日至今任嘉实稳泽纯债债券基金经理，2016 年 4 月 26 日任嘉实新优选混合、嘉实新思路混合、本基金基金经理。

（2）历任基金经理

无。

3、股票投资决策委员会

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：公司副总经理兼股票投资业务

联席 CIO 邵健先生，公司总经理赵学军先生，股票投资业务联席 CIO 兼研究总监陈少平女士，助理

CIO 兼股票投资部总监邵秋涛先生，人工智能投资部负责人张自力先生，资深基金经理邹唯先生、胡涛先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本：32,479,411.7万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分, 总行设在北京。经国务院批准, 中

国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股

份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中

国城乡, 成为国内网点最多、业务辐射范围最广, 服务领域最广, 服务对象最多, 业务功能齐全的大型

国有商业银行之一。在海外, 中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉, 每年位居《财

富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行, 中国农业银

行一贯秉承以客户为中心的经营理念, 坚持审慎稳健经营、可持续发展, 立足县域和城市两大市场,

实施差异化竞争策略, 着力打造“伴你成长”服务品牌, 依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网

络和多元化的金融产品, 致力为广大客户提供优质的金融服务, 与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行, 经验丰富, 服务优质, 业绩突出,

2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内

部控制审计, 并获得无保留意见的SAS70审计报告, 表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服

务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设, 品牌

声誉进一步提升, 在2010年首届“‘金牌理财’TOP10颁奖盛典”中成绩突出, 获“最佳托管银行”

奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。2013年至2015年连续获得中国

债券市场“优秀托管机构奖”，2015年被中国银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”

。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2014

年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境

外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户

管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名，其中具有高级职称的专家30余名，服务团队成员专

业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称，精通

国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止到2016年6月30日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共342

只。

三、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2期53层09-11单元

电话（021）38789658 传真（021）68880023

联系人 鲍东华

（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 青岛市市南区山东路6号华润大厦3101室

电话 (0532) 66777997 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) . 中国农业银行股份有限公司

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 蒋超良 联系人 滕涛

电话 (010) 85108227 传真 (010) 85109219

网址 www.abchina.com 客服电话 95599

(2) . 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 客服电话 95566

(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 客服电话 95559

(4) . 中国民生银行股份有限公司

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 洪崎 联系人 王志刚

电话 (010)58560666

网址 www.cmbc.com.cn 客服电话 95568

(5) . 上海农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址 上海市浦东新区银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15-20、22-27 层

法定代表人 侯福宁 联系人 施传荣

电话 021-38523692 传真 021-50105124

网址 www.srcb.com 客服电话 (021)962999

(6) . 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 客服电话 96198

(7) . 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 客服电话 (025) 96098、

4008696098

(8) . 渤海银行股份有限公司

住所、办公地址 天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人 刘宝凤 联系人 王宏

电话 (022)58316666 传真 (022)58316569

网址 www.cbhb.com.cn 客服电话 400-888-8811

(9) . 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 客服电话 (0991)96518

(10). 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 客服电话 95537

(11). 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

客服电话 4006-960296

(12). 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 客服电话 4006129999

(13). 江苏江南农村商业银行股份有限公司

办公地址 常州市和平中路 413 号

注册地址 常州市和平中路 413 号

法定代表人 陆向阳 联系人 包静

电话 13951229068 传真 0519-89995170

网址 www.jnbank.com.cn 客服电话 96005

(14). 包商银行股份有限公司

住所、办公地址 内蒙古包头市钢铁大街 6 号

法定代表人 李镇西 联系人 张晶

电话 (0472)5109729 传真 (0472)5176541

网址 <http://www.bsb.com.cn>

客服电话

0472-96016、

010-96016、

0574-967210、

0755-967210、

028-65558555

(15). 广州农村商业银行股份有限公司

办公地址 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

注册地址 广州市天河区珠江新城华夏路 1 号

法定代表人 王继康 联系人 戴一挥

电话 020-22389188 传真 020-22389031

网址 www.grcbank.com 客服电话 020-9611111

(16). 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

客服电话 0512-96067

(17). 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

(18). 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

客服电话 400-6696178

(19). 贵阳银行股份有限公司

办公地址 贵州省贵阳市中华北路 77 号

注册地址 贵州省贵阳市中华北路 77 号

法定代表人 陈宗权 联系人 黎荣荣

电话 18092299120 传真 0851-86851953

网址 www.gyccb.cn 客服电话 4001196033

(20). 天相投资顾问有限公司

办公地址 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 5 层

注册地址 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人 林义相 联系人 尹伶

电话 010-66045529 传真 010-66045518

网址 <http://www.jjm.com>.

cn 客服电话 010-66045678

(21).和讯信息科技有限公司

办公地址 北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

注册地址 北京市朝阳区大街 22 号泛利大厦 10 层

法定代表人 王莉 联系人 刁甜

传真 021-20835879

网址 [http://fund.licaike.](http://fund.licaike.com/)

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 张裕

电话 021-38509735 传真 021-38509777

网址 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 客服电话 4006-788-887

(24).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.](http://www.fund123.cn/)

cn/ 客服电话 4000-766-123

(25).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 单丙焯

电话 021-20691869 传真 021-20691861

网址 www.erichfund.com 客服电话 400-089-1289

(26).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 客服电话 4008-773-772

(27). 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 客服电话 4008886661

(28). 嘉实财富管理有限公司

住所 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元

办公地址 上海市浦东新区世纪大道 8 号 B 座 46 楼 06-10 单元、 北京市朝阳区建国

路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人 赵学军 联系人 景琪

电话 021-20289890 传真 021-20280110

网址 www.harvestwm.cn 客服电话 400-021-8850

(29). 北京广源达信投资管理有限公司

办公地址 北京市朝阳区望京东园四区 13 号楼浦项中心 B 座 19 层

注册地址 北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室

法定代表人 齐剑辉 联系人 王英俊

电话 010-57298634 传真 010-82055860

网址 www.niuniufund.com 客服电话 4006236060

(30). 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 客服电话 010-68292745

(31). 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

(32). 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 客服电话 4008219031

(33). 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

(34). 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 客服电话 020-89629066

(35). 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/ 客服电话 010-59336512

(36). 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
注册地址 中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号
法定代表人 杨德红 联系人 芮敏祺
电话 (021)38676666 传真 (021)38670666
网址 www.gtja.com 客服电话 4008888666

(37). 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

电话 (010) 65183880 传真 (010) 65182261

网址 www.csc108.com 客服电话 400-8888-108

(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 周杨

电话 0755-82130833 传真 0755-82133952

网址 www.guosen.com.cn 客服电话 95536

(39). 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

(40). 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

(41) 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 陈共炎 联系人 田薇

电话 (010)66568430 传真 010-66568990

网址 www.chinastock.com.cn

客服电话 400-8888-888

(42) 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

(43) 申万宏源证券有限公司

住所、办公地址 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

注册地址 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人 李梅 联系人 钱达琛

电话 021-33389888 传真 021-33388224

网址 www.swhysc.com 客服电话 021-962505

(44) 中信证券（山东）有限责任公司

住所、办公地址 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼

法定代表人 杨宝林 联系人 吴忠超

电话 (0532) 85022326 传真 (0532) 85022605

网址 www.citicssd.com 客服电话 95548

(45) 中国中投证券有限责任公司

住所 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-21 层

及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元

办公地址 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人 高涛 联系人 刘毅

电话 0755-82023442 传真 0755-82026539

网址 www.china-invs.cn 客服电话 400-600-8008

(46) 长城证券股份有限公司

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 客服电话 4006668888、(0755)

33680000

(47) 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 客服电话 4008888788、

10108998

(48) 申万宏源西部证券有限公司

住所、办公地址 新疆乌鲁木齐市天山区文艺路 233 号宏源大厦 8 楼

注册地址 新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 258 号大成国际大厦 20 楼
2005 室

法定代表人 李季 联系人 唐岚

电话 010-88085258 传真 0991-2301802

网址 www.hysec.com 客服电话 4008-000-562

(49) 中泰证券股份有限公司

住所、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

(50)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 客服电话 4008366366

(51)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 杨泽柱 联系人 李良

电话 (027) 65799999 传真 (027) 85481900

网址 www.95579.com 客服电话 95579 或

4008-888-999

(52)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 高冠江 联系人 唐静

电话 (010) 63081000 传真 (010) 63080978

网址 www.cindasc.com 客服电话 95321

(53)上海证券有限责任公司

住所、办公地址 上海市四川中路213号久事商务大厦7楼

法定代表人 龚德雄 联系人 许曼华

电话 (021) 53686888 传真 (021)

53686100-7008

网址 www.962518.com 客服电话 (021) = 962518、

4008918918

(54)平安证券股份有限公司

住所 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

(55)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 客服电话 400-818-8118

(56) 东海证券股份有限公司

住所、办公地址 江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人 赵俊 联系人 王一彦

电话 (021)20333333 传真 (021)50498825

网址 www.longone.com.cn 客服电话 95531;400-888-8588

(57) 第一创业证券股份有限公司

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

(58) 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 梁承华

电话 (029)87416168 传真 (029)87406710

网址 www.westsecu.com 客服电话 95582

(59) 华龙证券有限责任公司

住所、办公地址 甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心

法定代表人 李晓安 联系人 李昕田

电话 (0931) 4890208 传真 (0931) 4890628

网址 www.hlzqgs.com 客服电话 (0931) 96668、

4006898888

(60) 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 客服电话 (021) 32109999、

(029) 68918888

(61) 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.gjq.com.cn 客服电话 4006600109

(62) 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 北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人寿保险大厦十二层、十五层、十六层、十七层、十八层

法定代表人 祝献忠 联系人 李慧灵

电话 010-85556100 传真 010-85556088

网址 www.hrsec.com.cn 客服电话 400-898-4999

(63)天风证券股份有限公司

办公地址 湖北省武汉市武昌区中南路 99 号保利广场 A 座 37 楼

注册地址 湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路 2 号高科大厦四楼

法定代表人 余磊 联系人 崔成

电话 027-87610052 传真 027-87618863

网址 www.tfzq.com 客服电话 4008005000

(64)上海万得投资顾问有限公司

办公地址 上海市浦东新区福山路 33 号建工大厦 8 楼

注册地址 中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

法定代表人 王廷富 联系人 姜吉灵

电话 021-68882280 传真 021-68882281

网址 客服电话 400-821-0203

(65)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

办公地址 北京市西城区广安门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层

注册地址 深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

法定代表人 张彦 联系人 文雯

电话 010-83363101 传真 010-83363072

网址 8.jrj.com.cn 客服电话 400-118-1166

(66)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.](http://www.fund123.cn/)

cn/ 客服电话 4000-766-123

（二）登记机构

名称 嘉实基金管理有限公司

住所 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

联系人 彭鑫

电话 （010）65215588

传真 （010）65185678

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称 上海市源泰律师事务所

住所、办公地址 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人 廖海 联系人 范佳斐

电话 (021) 51150298-827 传真 (021) 51150398

经办律师 刘佳、范佳斐

（四）审计基金财产的会计师事务所

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：嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：混合型证券投资基金，契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现

基金资产的长期稳健增值。

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）、可交换公司债

券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、资产支持证券、债券回购、

大额存单、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）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0—95%；在扣除股指期货合约需缴纳

交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券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。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，

合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的

变化适时进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金采取自下而上的个股精选策略，以深入的基本面研究为基础，精选具有一定核心优势的

且成长性良好、价值被低估的上市公司股票。自下而上的投资策略相信，无论经济环境或行业环境如

何变化，总是有一些个股能超越市场表现，获得高于市场平均水平的回报。因而，自下而上的研究方

法，就是非常密切地关注公司的管理、历史、商业模式、成长前景及其他特征。在行业配置方面，本基

金管理人将根据宏观经济形式对行业配置进行动态调整。

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，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、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研

究，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与

收益率的影响，同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个

券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选

择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

7、风险管理策略

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。

8、投资决策依据和决策程序

(1) 投资决策依据

● 法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的有关规定。

● 宏观经济和上市公司的基本面数据。

● 投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内，选择预期

收益大于预期风险的品种进行投资。

(2) 投资决策程序

- 公司研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。
- 投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据本基金投资目标和对市场的判断决定本计划的总体投资策略，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。
- 在既定的投资目标与原则下，根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型，由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。
- 独立的交易执行：本基金管理人通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。
- 动态的组合管理：基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合本基金的现金流量情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态的调整，使之不断得到优化。风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

九、基金的业绩比较基准

沪深 300*50%+中债总指数*50%

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，而

无须召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，

属于较高风险、较高收益的品种。

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 20 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 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 46,798,108.55 6.00

其中：股票 46,798,108.55 6.00

2 基金投资 --

3 固定收益投资 709,598,791.30 90.97

其中：债券 709,598,791.30 90.97

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 15,687,177.69 2.01

8 其他资产 7,924,182.73 1.02

9 合计 780,008,260.27 100.00

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 --

B 采矿业 --

C 制造业 15,859,128.08 2.31

D 电力、热力、燃气及水生产和供

应业 9,714,320.00 1.42

E 建筑业 24,510.48 0.00

F 批发和零售业 5,528,547.63 0.81

G 交通运输、仓储和邮政业 5,667,748.32 0.83

H 住宿和餐饮业 --

I 信息传输、软件和信息技术服

务业 --

J 金融业 10,003,854.04 1.46
 K 房地产业 --
 L 租赁和商务服务业 --
 M 科学研究和技术服务业 --
 N 水利、环境和公共设施管理业 --
 O 居民服务、修理和其他服务业 --
 P 教育 --
 Q 卫生和社会工作 --
 R 文化、体育和娱乐业 --
 S 综合 --
 合计 46,798,108.55 6.82

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 600900 长江电力 730,400 9,714,320.00 1.42
 2 601169 北京银行 670,600 6,102,460.00 0.89
 3 000726 鲁泰A 520,500 5,923,290.00 0.86
 4 601333 广深铁路 1,389,154 5,667,748.32 0.83
 5 000895 双汇发展 233,900 5,517,701.00 0.80
 6 000963 华东医药 80,000 5,496,000.00 0.80
 7 002311 海大集团 249,460 4,133,552.20 0.60
 8 601398 工商银行 710,820 3,148,932.60 0.46
 9 000001 平安银行 73,600 667,552.00 0.10
 10 603986 兆易创新 665 118,350.05 0.02

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 5,319,551.30 0.78
 2 央行票据 --
 3 金融债券 112,729,000.00 16.43
 其中：政策性金融债 112,729,000.00 16.43
 4 企业债券 112,301,240.00 16.37
 5 企业短期融资券 365,801,000.00 53.33
 6 中期票据 113,448,000.00 16.54
 7 可转债(可交换债) --
 8 同业存单 --

9 其他 --

10 合计 709,598,791.30 103.45

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

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 041659015 16 义乌国资

CP002 600,000 60,168,000.00 8.77

2 150213 15 国开 13 500,000 51,640,000.00 7.53

3 041676003 16 杭州城建

CP002 500,000 50,155,000.00 7.31

4 150203 15 国开 03 300,000 30,819,000.00 4.49

5 150417 15 农发 17 300,000 30,270,000.00 4.41

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)

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 73,923.96

2 应收证券清算款 201,734.01

3 应收股利 -

4 应收利息 7,648,415.94

5 应收申购款 108.82

- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 7,924,182.73

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

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 603986 兆易创新 118,350.05 0.02 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

嘉实新常态混合 A

阶段 净值增

长率①

净值增长率

标准差②

业绩比较基

准收益率③

业绩比较基准收

益率标准差④ ①—③ ②—④

自基金合同

生效起至

2016年6月

30日

0.60% 0.20% 0.55% 0.53% 0.05% -0.33%

自基金合同

生效起至

2016年9月

30日

2.60% 0.16% 3.15% 0.47% -0.55% -0.31%

嘉实新常态混合C

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

自基金合同

生效起至

2016年6月

30日

0.40% 0.20% 0.55% 0.53% -0.15% -0.33%

自基金合同

生效起至

2016年9月

30日

2.30% 0.16% 3.15% 0.47% -0.85% -0.31%

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 1：嘉实新常态混合 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2016年3月30日至2016年9月30日）

图 2：嘉实新常态混合 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2016年3月30日至2016年9月30日）

注：本基金基金合同生效日 2016 年 3 月 30 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) 基金的销售服务费；
- 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费、律师费和诉讼或仲裁费；
- 6) 基金份额持有人大会费用；
- 7) 基金的证券、期货交易费用；
- 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 1.0% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人和基金托管人双方核对

后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日

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。

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 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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，经管理人和基金托管人双方核对后，由

基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。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。

3) 基金的销售服务费；

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，销

售服务

费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人和基金托管人双方核对

后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基

金销售机构。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。

（二）与基金销售有关的费用

1、本基金 A 类基金份额前端申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率

越低。投资者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） 申购费率

M < 100 万元 1.5%

100 万元 ≤ M < 200 万元 1.0%

200 万元 ≤ M < 500 万元 0.6%

M ≥ 500 万元 按笔收取，单笔 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。本基金 C 类基金份额申购费率为 0。

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，其中申购费

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：2014年9月2日，本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金

产品的公告》，自2016年5月6日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（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

$0 < t$

$1 \text{ 年} \leq T < 3 \text{ 年}$ 0.10%

$T \geq 3 \text{ 年}$ 0.00%

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。

2、本基金对A、C类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。本基金A类基金份额，对持续持有期少于30日的投

资人，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，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，赎回费总额的50%计入基金财产；

对持续持有期大于等于180天的投资人，将赎回费总额的25%计入基金财产。本基金C类基金份额，对

持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产。

本基金A类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（N） 赎回费率

$N < 7$ 1.5%

$7 \leq N < 30$ 0.75%

$30 \leq N < 180$ 0.5%

$N \geq 180$ 0

本基金C类基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（N） 赎回费率

$N < 30$ 0.5%

$N \geq 30$ 0

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式。

费率

如发生变更，基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上刊登公告。

基金管理人可以在不违反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，定期或不定期地开展基金促销活动。

3、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 转换为嘉实新常态混合 A、嘉实新常

态混合 C 时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

净转入金额= $(B \times C) / (1 + F) + M$

转入份额=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 或嘉实机构快线货币 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、嘉实稳祥纯债 债券 C 转换为嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C，采用“赎回费+申购费率”

算法：

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

转入份额=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嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C 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、嘉实沪深 300 指数增强、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、嘉实先进制造股票、嘉实新消费股票、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、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实文体娱乐股票 A、嘉实文体娱乐股票 C 之间互转，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、嘉实机构快线货币 A、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、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券 A、嘉实如意宝定期债券 C、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实稳祥纯债债券 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。

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 联接转入嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C 时，采用“赎回费+固定补差费”算法：

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 ≥ 500 万元时，固定补差费率为零；2) 当转出金

额 < 500 万元，并且转出基金的持有期 ≥ 90 天，则固定补差费率为零；3) 当转出金额小于

500 万元，并且转出基金的持有期 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、嘉实稳祥纯债债券 A 转入嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C 时，采用“赎回费

+固定补差费率”算法：

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

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

转入份额 $=$ 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 ≥ 500 万元时，固定补差费率为零；2) 当转出金额 500 万元，并且转出基金的持有期 ≥ 90 天，则固定补差费率为零；3) 当转出金额小于 500 万元，并且转

出基金的持有期 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

①对于“前端转前端”的模式，采用以下规则：

i 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 转换为嘉实新常态混合 A、嘉实新常

态混合 C 时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

净转入金额 $= (B \times C) / (1 + F) + M$

转入份额 $=$ 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 或嘉实机构快线货币 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。

ii 嘉实信用债券 C、嘉实纯债债券 C、嘉实稳固收益债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C、嘉实如意宝定期债券 C 转换为嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C，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。

iii 嘉实新常态混合 A、嘉实新常态混合 C 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、嘉实沪深 300 指数增强、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、嘉实先进制造股票、嘉实新消费股票、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、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)

A、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实新趋势混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实丰益纯债定期债券、

嘉实如意宝定期债券 A、嘉实对冲套利定期混合、嘉实文体娱乐股票 A、嘉实文体娱乐股票 C、嘉实稳祥纯债债券 A 之间互转，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、嘉实中证中期企业债指数 (LOF) C 时 (嘉实中证中期企业债指数 (LOF) A 与嘉实中证中期企业

债指数（LOF）C之间不能互相转换），仅收取转出基金的赎回费，计算公式如下：

净转入金额=B×C×(1-D)

转入份额=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。

②对于“后端转后端”的模式，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。

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，针对以特定交易方式（如网上交易等）或在特定时间段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，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基

金转换费率。

注：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；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证券投资基金（LOF）单个开放日每个基金账

户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过

2000万元；2016年4月5日起，嘉实信用债券型证券投资基金单个开放日每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；自2016年7月11日起，丰益纯债单个开放日每个基金账户

的累计申购（含转入）金额不得超过500万元；自2016年8月8日起，嘉实新趋势灵活配置混合型证券

投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转换转入）及定期定额投资业务的金额

不得超过

10 万元，嘉实新常态灵活配置混合型证券投资基金单个开放日每个基金账户的累计申购（含转换转

入）及定期定额投资业务的金额不得超过 1 万元；自 2016 年 9 月 30 日起，嘉实增强收益定期债券单个

开放日每个基金账户的累计申购（含转入）金额不得超过 1 万元；2016 年 11 月 9 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 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。

（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》、《公开募集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：增加了本基金合同生效日，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：将本基金基金份额发售公告中“代销机构”以及发售公告披露日

起至 2016 年 9 月 30 日止新增的代销机构，列示在本招募说明书，并更新相关代销机构信

息。

5. 在“六、基金的募集”部分：增加了募集期限。

6. 在“七、基金合同的生效”部分：增加了本基金合同生效日。

7. 在“八、基金份额的申购与赎回”部分：更新了申购赎回的相关内容。 8. 在“九、基金的转换”部分：添加了基金转换的相关内容

9. 在“十、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。

10. 增加“十一、基金的业绩”：基金业绩更新至2016年9月30日。

11. 在“二十三、其他应披露事项”部分：更新了自2016年1月30日首次披露本基金招募说明书至

2016年9月30日的披露事项。

嘉实基金管理有限公司

2016年11月12日