

## 嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场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：北京银行股份有限公司

### 重要提示

嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金（以下简称本基金）经中国证监会 2013 年 9 月 17 日证监许可 [2013]1196 号文核准募集，本基金基金合同于 2013 年 12 月 11 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。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构。

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 2017 年 12 月 11 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2017 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 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 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

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，代任公司总经理，经济学博士。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2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、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。

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，JPMorgan 固定收益亚太区 CFO、COO，JPMorgan 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。

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。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼 MBA 教育中心主任。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

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

万晓西先生，17年证券从业经历，曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部和资金交易中心，南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理，第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理，民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理，

2013年2月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系短端 alpha 策略组组长，经济学硕士，中国国籍。2013年7月5日至2014年7月16日任嘉实信用债券和增强收益定期开放债券基金经理，

2013年9月4日至2014年9月19日任嘉实丰益策略定期债券基金经理，2013年12月18日至今任嘉实活期宝货币基金经理，

2014年3月17日至今任嘉实活钱包货币基金经理，2014年6月27日至今任嘉实

3个月理财债券基金经理，2015年6月25日至今任嘉实机构快线货币基金经理。2017年3月29日至今

任嘉实现金添利货币基金经理，2017年5月24日至今任嘉实货币、嘉实薪金宝货币基金经理，2017年

6月19日至今任嘉实6个月理财债券基金经理。2013年12月11日至今任本基金基金经理。

李金灿先生，硕士研究生，具有基金从业资格，8年证券从业经历。曾任 FutexTradingLtd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司担任债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。2016年1月28日至今任

嘉实薪金宝货币基金经理，2016年2月5日至今任嘉实快线货币基金经理。2016年7月23日至今任嘉实

理财宝7天债券、嘉实安心货币基金经理。2016年12月27日至今任嘉实增益宝货币基金经理。2017年

5月24日至今任嘉实1个月理财债券基金经理。2017年5月25日至今任嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货

币、嘉实3个月理财债券、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券和嘉实现金添利货币基金经理。

2017年6月29日至今任嘉实6个月理财债券基金经理。2015年6月9日至今任嘉实超短债债券和本基金基金经理。

张文玥女士，硕士研究生，具有基金从业资格，9年证券从业经历。曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014年4月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收

益业务体系短端 alpha 策略组。2014年8月13日至今担任嘉实理财宝7天债券、嘉实1个月理财债券、

嘉实3个月理财债券、嘉实安心货币基金经理，2015年7月14日至今任嘉实快线货币基金经理，

2016年12月22日至今任嘉实现金宝货币基金经理，2017年3月23日至今任嘉实定期宝6个月理财债券

基金经理。2016年1月28日至今任嘉实货币和本基金基金经理。

李瞳先生，硕士研究生，具有基金从业资格，8年证券从业经历。曾任中国建设银行金融市场部、机构业

务部业务经理。2014年12月加入嘉实基金管理有限公司。2015年1月28日至今任嘉实活钱包货币基

金经理，2015年5月14日至今任嘉实理财宝7天债券、嘉实安心货币基金经理，2016年1月28日至今任

嘉实货币、嘉实活期宝货币基金经理。2016年4月21日至今任嘉实快线货币基金经理，2016年12月

22日至今任嘉实现金宝货币基金经理。2017年4月13日至今任嘉实现金添利货币基金经理。2017年

5月24日至今任嘉实超短债债券基金经理。2017年5月25日至今任嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月

理财债券和本基金基金经理。

#### (2) 历任基金经理

本基金无历任基金经理。

#### 3、债券投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，债券投资决策委员会的成员包括：公司固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系资深基金经理王茜女士、万晓西先生、胡永青先生、以及投资经理王怀震先生、嘉实国际CIOThomasKwan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) 基金托管人基本情况

名称：北京银行股份有限公司（简称北京银行）

住所：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：闫冰竹

成立时间：1996年1月29日

注册资本：人民币1267222.9737万元

联系电话：010-66223695

传真：010-66226045

联系人：赵妹

北京银行成立于1996年，是一家中外资本融合的新型股份制银行。成立20年来，北京银行依托中国经济腾飞崛起的大好形势，先后实现引资、上市、跨区域、综合化等战略突破。目前，已在北京、天津、上海、西安、深圳、杭州、长沙、南京、济南及南昌等10大中心城市设立300多家分支机构，发起设立北京延庆、浙江文成及吉林农安北银村镇银行，成立香港和荷兰阿姆斯特丹代表处，发起设立国内首家消费金融公司北银消费金融公司，首批试点合资设立中荷人寿保险公司，先后设立中加基金管理公司、北银金融租赁公司，开辟和探索了中小银行创新发展的经典模式。

2016年上半年北京银行实现净利润106.74亿元，同比增长6.08%；资产利润率1.12%；资本利润率17.68%，盈利能力稳步提升。截至2016年6月末，公司资产总额1.97万亿元，较年初增长6.86%；贷款总额8,661亿元，较年初增长11.69%；存款总额1.1万亿元，较年初增长7.64%，规模实现均衡增长。不良贷款率1.13%，远低于行业平均水平，资产质量保持稳定。拨备覆盖率保持279.90%高位，拨贷比3.16%，风险抵御能力进一步增强，经营结构不断优化。在资产负债规模协调发展的基础上，主动调整和优化收益结构及业务结构，中间业务收入对营业收入的拉动作用进一步增强，报告期内实现手续费及佣金净收入60亿元，同比增长50%，在营业收入中占比提升至24%。

20年来，北京银行积极履行社会责任，在医疗、教育、慈善、赈灾等方面向社会捐助超过1亿元，充分彰显了企业社会责任。凭借优异的经营业绩和优质的金融服务，北京银行赢得了社会各界的高度赞誉，先后荣获全国文明单位、亚洲十大最佳上市银行、中国最佳城市商业零售银行、最佳区域性银行、最佳支持中小企业贡献奖、最佳便民服务银行、中国上市公司百强企业、中国社会责任优秀企业、最具持续投资价值上市公司、最受尊敬银行、最值得百姓信赖的银行机构及中国优秀企业公民等称号。在英国《银行家》杂志最新发布的全球千家大银行排名中，北京银行按一级资本排名提升至第77位，在过去十年内跃升了近500位，排名首都金融业第一名，连续三年跻身全球百强银行。在世界实验室发布的品牌价值排名中，北京银行品牌价值超过300亿元，位居中国银行业第7位。

### (二) 资产托管部负责人情况

刘晔女士，北京银行资产托管部总经理，硕士研究生学历。1994年毕业于中国人民大学财政金融系，1997年毕业于中国人民银行总行研究生部，具有十多年银行和证券行业从业经验。曾就职于证券公司从

事债券市场和股票研究工作。在北京银行工作期间，先后从事贷款审查、短期融资券承销、基金销售及资产托管等工作。2008年7月至2012年9月任北京银行资产托管部总经理助理，2012年9月至2014年12月任北京银行资产托管部副总经理，2014年12月起至今任北京银行资产托管部总经理。

北京银行总行资产托管部充分发挥作为新兴托管银行的高起点优势，搭建了由高素质人才组成的专业团队，内设核算估值岗、资金清算岗、投资运作监督岗、系统运行保障岗及风险内控岗，各岗位人员均分别具有相应的会计核算、资产估值、资金清算、投资监督、风险控制等方面的专业知识和丰富的业务经验，70%的员工拥有研究生及以上学历。

### （三）基金托管业务经营情况

北京银行资产托管部秉持严谨、专业、高效的经营理念，严格履行托管人的各项职责，切实维护基金持有人的合法权益，为基金提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，北京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、基金专户理财、证券公司资产管理计划、信托计划、银行理财、保险资金、股权投资基金等产品在内的托管产品体系，北京银行专业高效的托管服务赢得了客户的广泛高度认同。

### （四）基金托管人的内部控制制度

#### 1、内部控制目标

作为基金托管人，北京银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和本行有关管理规定，守法经营、规范运作、严格管理，确保基金托管业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时披露，保护基金份额持有人的合法权益。

#### 2、内部控制组织结构

北京银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。资产托管部设有内控监查岗，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作。

#### 3、内部控制制度及措施

北京银行资产托管部具备系统、完善的内部控制制度体系，建立了业务管理制度、内部控制制度、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员均具备从业资格；业务操作严格实行经办、复核、审批制度，授权工作实行集中控制，制约机制严格有效；业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，未经授权不得查看；业务操作区封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人负责，防止泄密；业务实现系统自动化操作，防止人为操作风险的发生；技术系统完整、独立。

### （五）托管人对管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》的相关规定，基金托管人发现基金管理人的投资指令违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反基金合同约定的，应当拒绝执行，立即通知基金管理人，并及时向证券监督管理机构报告。基金托管人如发现基金管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、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，并及时向证券监督管理机构报告。

## 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号北京万豪中心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 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) 84362200 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 137 号信合广场 801A 单元

电话 0591-88013670 电话 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) 88832125 传真 (020) 81552120

联系人 周炜

## 2、代销机构

(1) 中国光大银行股份有限公司

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 010-63639709

网址 [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com) 客服电话 95595

(2)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](http://www.gtja.com) 客服电话 4008888666

(3)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](http://www.csc108.com) 客服电话 400-8888-108

(4)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](http://www.guosen.com.cn) 客服电话 95536

(5)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 孙树明 联系人 黄岚

电话 (020) 87555888 传真 (020) 87555305

网址 [www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn) 客服电话 95575 或致电各地营业网点

(6)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 张佑君 联系人 郑慧

电话 010-60834817

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

(7)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 辛国政

电话 010-83574507 传真 010-83574807

网址 [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn) 客服电话 400-8888-888

(8)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 周杰 联系人 金芸、李笑鸣  
电话 (021)23219000 传真 (021)23219100  
网址 [www.htsec.com](http://www.htsec.com) 客服电话 95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

(9)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](http://www.swhysc.com) 客服电话 021-962505

(10)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](http://www.essence.com.cn) 客服电话 4008001001

(11)华泰证券股份有限公司  
办公地址 江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场  
注册地址 江苏省南京市江东中路 228 号  
法定代表人 周易 联系人 庞晓芸  
电话 0755-82492193 传真 0755-82492962(深圳)  
网址 [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn) 客服电话 95597

(12)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](http://www.citicssd.com) 客服电话 95548

(13)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](http://www.china-invs.cn) 客服电话 4006008008

(14)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 金夏



电话 (021)62821733 传真 (0755)83515567  
网址 [www.cgws.com](http://www.cgws.com) 客服电话 4006666888、(0755)33680000

(15)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

(16)广州证券股份有限公司  
住所、办公地址 广州市天河区珠江新城珠江江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼  
法定代表人 邱三发 联系人 林洁茹  
电话 020-88836999 传真 020-88836654  
网址 [www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn) 客服电话 (020) 961303

(17)东北证券股份有限公司  
办公地址 长春市生态大街 6666 号  
注册地址 长春市生态大街 6666 号  
法定代表人 李福春 联系人 安岩岩  
电话 (0431)85096517 传真 (0431)85096795  
网址 [www.nesc.cn](http://www.nesc.cn) 客服电话 95360

(18)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 蔡一兵 联系人 郭静  
电话 (0731)84403347 传真 (0731)84403439  
网址 [www.cfzq.com](http://www.cfzq.com) 客服电话 95317

(19)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](http://www.hysec.com) 客服电话 4008-000-562

(20)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 许曼华  
电话 021-20315290  
网址 [www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn) 客服电话 95538

(21)第一创业证券股份有限公司  
住所、办公地址 深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼  
法定代表人 刘学民 联系人 毛诗莉

电话 (0755)23838750 传真 (0755)25838701  
网址 [www.firstcapital.com.cn](http://www.firstcapital.com.cn) 客服电话 95358

(22)中航证券有限公司

住所、办公地址 南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼  
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](http://www.avicsec.com) 客服电话 400-8866-567

(23)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  
网址 [www.hfzq.com.cn](http://www.hfzq.com.cn) 客服电话 (0591) 96326

(24)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](http://www.95579.com) 客服电话 95579 或 4008-888-999

(25)西南证券股份有限公司

住所、办公地址 重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦  
法定代表人 吴坚 联系人 张煜  
电话 (023)63786141 传真 (023)6378212  
网址 [www.swsc.com.cn](http://www.swsc.com.cn) 客服电话 4008096096

(26)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](http://www.gyzq.com.cn) 客服电话 95578

(27)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 天津市南开区滨水西道 8 号  
法定代表人 王春峰 联系人 蔡霆  
电话 (022)28451991 传真 (022)28451892  
网址 [www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn) 客服电话 4006515988

(28)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](http://www.i618.com.cn) 客服电话 400-666-1618

(29)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

网址 [www.dxzq.net.cn](http://www.dxzq.net.cn) 客服电话 400-8888-993

(30)东吴证券股份有限公司

住所、办公地址 苏州工业园区星阳街 5 号

法定代表人 范力 联系人 方晓丹

电话 (0512)65581136 传真 (0512)65588021

网址 [www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn) 客服电话 95330

(31)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 尹旭航

电话 (010)63081493 传真 (010)63081344

网址 [www.cindasc.com](http://www.cindasc.com) 客服电话 95321

(32)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 李俊杰 联系人 邵珍珍

电话 (021)53686888 传真 (021)53686100-7008

网址 [www.962518.com](http://www.962518.com) 客服电话 (021)962518、4008918918

(33)新时代证券有限责任公司

住所、办公地址 北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人 叶顺德 联系人 田芳芳

电话 (010)83561146

网址 [www.xsdzq.cn](http://www.xsdzq.cn) 客服电话 95399

(34)大同证券有限责任公司

住所 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

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](http://www.dtsbc.com.cn) 客服电话 4007121212

(35)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 菅明军 联系人 程月艳、李盼盼

电话 0371--69099882 传真 0371--65585899

网址 [www.ccnew.com](http://www.ccnew.com) 客服电话 95377

(36)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 王少华 联系人 黄静

电话 (010)84183389 传真 (010)84183311

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

(37)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](http://www.longone.com.cn) 客服电话 95531;400-888-8588

(38)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 王作义 联系人 马贤清

电话 (0755)83025022 传真 (0755)83025625

网址 [www.jyzq.cn](http://www.jyzq.cn) 客服电话 400-8888-228

(39)西部证券股份有限公司

住所、办公地址 陕西省西安市东新街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](http://www.westsecu.com) 客服电话 95582

(40)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](http://www.hlzqgs.com) 客服电话 (0931) 96668、4006898888

(41)上海华信证券有限责任公司

注册地址 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼

法定代表人 罗浩 联系人 倪丹

电话 021-38784818 传真 021-68775878

网址 [www.shhxzq.com](http://www.shhxzq.com) 客服电话 68777877

(42)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 俞洋 联系人 杨莉娟

电话 021-54967552 传真 021-54967032

网址 [www.cfsc.com.cn](http://www.cfsc.com.cn) 客服电话 021-32109999;029-68918888;4001099918

(43)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 程宜荪 联系人 牟冲

电话 (010) 58328112 传真 (010)58328748

网址 [www.ubssecurities.com](http://www.ubssecurities.com) 客服电话 400-887-8827

(44)中山证券有限责任公司

办公地址 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层

注册地址 深圳市南山区科技中一路西华强高新大厦7层、8层

法定代表人 黄扬录 联系人 罗艺琳

电话 0755-82570586 传真 0755-82960582

网址 [www.zszq.com](http://www.zszq.com) 客服电话 95329

(45)江海证券有限公司

办公地址 黑龙江省哈尔滨市松北区创新三路833号

注册地址 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 周俊

电话 0451-85863726 传真 0451-82337279

网址 [www.jhzq.com.cn](http://www.jhzq.com.cn) 客服电话 400-666-2288

(46)国金证券股份有限公司

办公地址 四川省成都市东城根上街95号

法定代表人 冉云 联系人 刘婧漪、贾鹏

电话 028-86690057、028-86690058 传真 028-86690126

网址 [www.gjq.com.cn](http://www.gjq.com.cn) 客服电话 95310

(47)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

(48)爱建证券有限责任公司

住所、办公地址 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼

法定代表人 宫龙云 联系人 陈敏

电话 (021) 32229888 传真 021-68728782

网址 [www.ajzq.com](http://www.ajzq.com) 客服电话 (021) 63340678

(49)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

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

#### （二）登记结算机构

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 陈文祥

电话 400-805-8058、021-68419095

传真 021-68870311

#### （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 张兰

电话 (021) 51150298-855 传真 (021) 51150398

经办律师 刘佳、张兰

#### （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 薛竞、张勇

#### 四、基金的名称

本基金名称：嘉实保证金理财场内实时申赎货币市场基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金在有效控制风险和保持较高流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。

#### 七、基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许基金投资的金融工具，包括：现金；期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他货币市场工具的，在不改变基金投资目标、基金风险收益特征的前提下，本基金可参与投资，不需要召开基金份额持有人大会，具体投资比例限制按照届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。

#### 八、基金的投资策略

##### 1、整体资产配置策略

根据宏观经济指标（主要包括：市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP 增长率、货币供

应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率等），决定组合的平均剩余期限（长/中/短）和比例分布。根据各类资产的流动性特征（主要包括：平均日交易量、交易场所、机构投资者持有情况、回购抵押数量等），决定组合中各类资产的投资比例。

根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别。

## 2、类别资产配置策略

根据整体策略要求，决定组合中类别资产的配置内容和各类别投资的比例。

根据不同类别资产的流动性指标（二级市场存量、二级市场流量、分类资产日均成交量、近期成交量、近期变动量、交易场所等），决定类别资产的当期配置比率。

根据不同类别资产的收益率水平（持有期收益率、到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理、附加选择权价值、类别资产收益差异等）、市场偏好、法律法规对基金投资的规定、基金合同、基金收益目标、业绩比较基准等决定不同类别资产的目标配置比率。

## 3、明细资产配置策略

第一步筛选，根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标（流通总量、日均交易量），决定是否纳入组合。

第二步筛选，根据个别债券的收益率（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，对照基金的收益要求决定是否纳入组合。

第三步筛选，根据个别债券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定投资总量。

## 4、投资程序

### （1）决策依据

1) 国家有关法律、法规和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。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款税后利率

活期存款是具备最高流动性的存款，本基金期望通过科学严谨的管理，使本基金达到类似活期存款的流动性以及更高的收益。对于交易所投资者而言，赎回本基金后可立即进行交易所投资，卖出交易所股票或其它投资品后可立即享受本基金投资收益。本基金对于投资者而言，可以部分达到活期存款的作用，因此选择活期存款利率作为业绩比较基准。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

## 十一、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。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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 2017 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 固定收益投资 29,676,873.90 14.25

其中：债券 29,676,873.90 14.25

资产支持证券 -

-

2 买入返售金融资产 59,984,134.98

28.80

其中：买断式回购的买入返售金融资产 --

3 银行存款和结算备付金合计 107,148,735.84 51.44

4 其他资产 11,470,081.42 5.51

5 合计 208,279,826.14 100.00

#### 2.报告期债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

#### 3.基金投资组合平均剩余期限

##### (1)投资组合平均剩余期限基本情况

项目 天数

报告期末投资组合平均剩余期限 40

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 51

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 6

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 120 天。

##### (2)报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号 平均剩余期限 各期限资产占基金资产净值的比例（%） 各期限负债占基金资产净值的比例（%）

1 30 天以内 66.37 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

2 30 天(含)-60 天 19.20 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

3 60 天(含)-90 天 --

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

4 90 天(含)-120 天 9.62 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

5 120 天(含)-397 天（含） 4.70 -

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 --

合计 99.89 -



#### 4.报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

#### 5.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 --

2 央行票据 --

3 金融债券 --

其中：政策性金融债 --

4 企业债券 --

5 企业短期融资券 --

6 中期票据 --

7 同业存单 29,676,873.90 14.28

8 其他 --

9 合计 29,676,873.90 14.28

10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 --

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

#### 6.报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本(元) 占基金资产净值比例(%)

1 111718299 17 华夏银行 CD299 200,000 19,910,124.08 9.58

2 111710367 17 兴业银行 CD367 100,000 9,766,749.82 4.70

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

#### 7.影子定价与摊余成本法确定的基金资产净值的偏离

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 0

报告期内偏离度的最高值 0.0526%

报告期内偏离度的最低值 -0.0172%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0259%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

#### 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。

#### 9.投资组合报告附注

(1)基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 0.01 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

(2)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

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。

(3)其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	800,833.60
2	应收证券清算款	9,999,298.43
3	应收利息	669,949.39
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	11,470,081.42

## 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。

### 10.本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 嘉实宝 A

阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2013 年 12 月 11 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日	0.2930%	0.0034%	0.0201%	0.0000%	0.2729%	0.0034%
2014 年度	4.4403%	0.0162%	0.3500%	0.0000%	4.0903%	0.0162%
2015 年	3.2675%	0.0065%	0.3500%	0.0000%	2.9175%	0.0065%
2016 年	2.0652%	0.0029%	0.3510%	0.0000%	1.7142%	0.0029%
2017 年上半年	1.3694%	0.0018%	0.1734%	0.0000%	1.1960%	0.0018%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日	2.2220%	0.0033%	0.2617%	1.9603%	0.0033%	

#### 嘉实宝 B

阶段	净值收益率	净值收益率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2013 年 12 月 11 日（基金合同生效日）至 2013 年 12 月 31 日	0.3255%	0.0037%	0.0201%	0.0000%	0.3054%	0.0037%
2014 年度	5.0694%	0.0163%	0.3500%	0.0000%	4.7194%	0.0163%
2015 年	3.8869%	0.0066%	0.3500%	0.0000%	3.5369%	0.0066%
2016 年	2.6711%	0.0029%	0.3510%	0.0000%	2.3201%	0.0029%
2017 年上半年	1.6670%	0.0019%	0.1734%	0.0000%	1.4936%	0.0019%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 9 月 30 日	2.6748%	0.0033%	0.2617%	2.4131%	0.0033%	

## 2.自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

图 1：嘉实宝 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013 年 12 月 11 日至 2017 年 9 月 30 日)

图 2：嘉实宝 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2013 年 12 月 11 日至 2017 年 9 月 30 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）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、仲裁费和诉讼费。
- 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、基金的开户费用。
- 10、基金的登记结算费用。
- 11、基金授信的费用（如有）。
- 12、基金上市初费及年费（如有）。
- 13、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。

#### （二）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 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \times \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休日等，支付日期顺延。

##### 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 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \times \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 3、基金销售服务费

基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售、服务等各项费用。在通常情况下，本基金 A 类基金份额

的销售服务费年费率为 0.25%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%。计算方法如下：

$H=ER$  当年天数

H 为各类别基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为各类别基金份额前一日基金资产净值

R 为各类别基金份额适用的基金销售服务费率基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 10 个工作日内从基金财产中一次性支付，由基金管理人代收，基金管理人收到后支付给基金销售机构，专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述（一）基金费用的种类中第 4—12 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或摊入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（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：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：更新了相关直销、代销机构信息。
- 5.在九、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。
- 6.在十、基金的业绩：基金业绩更新至 2017 年三季度末。
- 7.在二十四、其他应披露事项部分：列示了本基金自 2017 年 6 月 11 日至 2017 年 12 月 11 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2018 年 1 月 23 日