（上接B041版）

(128)中国民族证券有限责任公司

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

(129)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	客服电话	4008209898

(130)长城国瑞证券有限公司

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

(131)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	客服电话	（021）63340678

(132)英大证券有限责任公司

住所	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
注册地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	吴骏	联系人	吴尔晖
电话	0755-83007159	传真	0755-83007034
网址	www.ydsc.com.cn	客服电话	4000-188-688

(133)华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街8号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层、5层		
法定代表人	宋德清	联系人	黄恒
电话	010-58568235	传真	010-58568062
网址	www.hrsec.com.cn	客服电话	（010）58568118

(134)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

(135)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

（二）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

办公地址	国浩律师集团（北京）事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	（010）65890661	传真	（010）65176801
经办律师	黄伟民		

（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	杨绍信	联系人	洪磊
电话	（021）23238888	传真	（021）23238800
经办注册会计师	许康玮、洪磊		

四、基金的名称

本基金的名称：嘉实策略增长混合型证券投资基金

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

通过有效的策略组合，为基金持有人创造较高的中长期资产增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票资产的配置占基金资产的30%-95%，债券资产的配置占基金资产的0-65%，权证的配置占基金资产净值的0-3%，现金或者到期日在一年以内的政府债券大不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1.资产配置

本基金将从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场情况灵活配置大类资产，减小基金系统性风险。资产配置上，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，将优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。

2.股票投资策略

本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法，通过主辅多种策略相互支持来构建投资组合，选股的主策略为积极成长策略，辅之以廉价证券策略和周期反转策略等。

（1）积极成长策略。充分发挥基金管理人在成长型企业上的研究与投资优势，从宏观经济运行和行业景气变化的趋势，以及上市公司治理结构、发展前景等角度进行综合分析，发现具有较高成长性与动态投资价值的股票。我们认为，中国资本市场上存在着大量的成长性企业，主要表现为，大行业里的小巨人、大集团旗下的窗口公司、行业整合中的龙头企业等。选股的基本指标：预期未来三年的主营业务收入复合增长率超过10%；或者，预期未来三年的净利润复合增长率超过10%等。

（2）廉价证券策略。通过深入研究上市公司资产和经营状况，发掘与投资那些由于所持有的土地、品牌、渠道、股权以及技术等具有潜在重估价值的资产，使得实际资产价值远大于现价的股票。

（3）周期反转策略。对周期性行业进行研究，通过分析投资增长、库存变化、产能利用及需求的变化等，寻找已经进入或即将进入景气回升期的周期性行业的企业进行投资，重点关注业绩敏感性较高的企业和行业的龙头企业。

（4）行业配置。本基金管理人的行业研究团队每季度将基于宏观与行业研究给出行业评级，在此基础上，基金经理将结合本基金的契约、投资策略、投资限制等，每个季度向投资决策委员会提交行业资产配置计划，投资决策委员会会通过后，由基金经理据此进行资产配置与组合构建。此后，金融工程小组将监控投资组合的行业配置比例，将大类行业配置比例作为必须跟踪的指标之一，风险控制团队根据行业集中度、行业偏离度等指标，进行风险控制。每季度末，金融工程小组将在定期进行的绩效评估分析中，专门分析大类行业配置的效果，向投资决策委员会提交风险绩效报告，以便总结与进一步改进行业资产配置与风险控制。

3.债券投资策略

本基金可投资的债券品种包括国债、金融债和企业债（包括可转换债）。债券投资采取“自上而下”的策略，通过深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

4.权证投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

（二）投资决策依据和决策程序

1.投资决策依据

（1）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、法规和基金合同的有关规定。

（2）上市公司的基本面。本基金将在对宏观经济和上市公司的基本面进行深入研究的基础上进行投资。

（3）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

（1）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。

（2）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。

（3）自下而上的股票投资选择：在既定的投资目标与原则下，分析师对符合基本选股标准的企业进行实地调研，进行估值研究和投资价值分析，对企业进行投资评级。由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

（4）独立的交易执行：基金管理人设置独立的中央交易室，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。

（5）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，集合基金申购和赎回导致的现金流量情况，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。

（6）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，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。稽核监察部对基金投资过程进行日常监督。

（7）基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购、赎回和转换导致的现金流量变化情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

（8）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作出调整。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数×75%＋上证国债指数×25%

十、基金的风险收益特征

较高风险，较高收益。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年4月17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2015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	8,813,099,799.80	88.20
	其中：股票	8,813,099,799.80	88.20
2	固定收益投资	321,045,009.50	3.21
	其中：债券	321,045,009.50	3.21
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	708,691,246.39	7.09
7	其他资产	149,039,167.88	1.49
	合计	9,991,875,223.57	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	34,752,707.00	0.36
C	制造业	2,389,920,511.71	24.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	271,304,395.84	2.82
E	建筑业	295,964,659.03	3.08
F	批发和零售业	411,697,428.85	4.28
G	交通运输、仓储和邮政业	21,815,535.00	0.23
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,794,949,933.89	49.83
J	金融业	322,793,645.32	3.35
K	房地产业	269,892,054.16	2.80
L	租赁和商务服务业	6,214.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,715.00	0.00
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	8,813,099,799.80	91.59

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	300253	卫宁软件	4,847,816	790,678,789.60	8.22
2	300104	乐视网	6,458,384	605,279,748.48	6.29
3	300274	阳光电源	17,622,797	570,978,622.80	5.93
4	300226	上海钢联	4,027,716	468,020,599.20	4.86
5	600446	金证股份	3,539,192	431,073,585.60	4.48
6	002657	中科金财	4,995,533	371,168,101.90	3.86
7	002405	四维图新	8,641,252	352,563,081.60	3.66
8	002516	江苏旷达	10,122,406	349,729,127.30	3.63
9	600570	恒生电子	3,133,125	341,134,650.00	3.55
10	002081	金螳螂	8,415,259	295,964,659.03	3.08

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	310,084,000.00	3.22
	其中：政策性金融债	310,084,000.00	3.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	10,961,009.50	0.11
8	其他	-	-
	合计	321,045,009.50	3.34

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	140213	14国开13	1,200,000	120,000,000.00	1.25
2	140357	14进出57	900,000	90,063,000.00	0.94
3	140207	14国开07	500,000	50,015,000.00	0.52
4	140437	14农发37	400,000	40,000,000.00	0.42
5	110023	民生转债	79,850	10,961,009.50	0.11

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	3,894,726.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,166,811.10
5	应收申购款	134,977,630.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	149,039,167.88

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	110023	民生转债	10,961,009.50	0.11

（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	300274	阳光电源	570,978,622.80	5.93	重大事项停牌

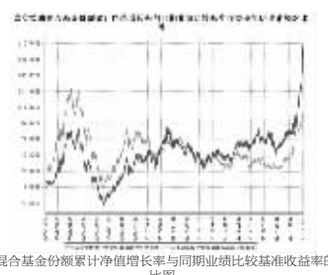
十二、基金的业绩

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. 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2006年12月12日至2006年12月31日	1.10%	0.17%	10.41%	1.00%	-9.31%	-0.83%
2007年度	74.48%	1.66%	108.03%	1.72%	-33.55%	-0.06%
2008年度	-51.32%	2.11%	-53.39%	2.28%	2.07%	-0.17%
2009年度	72.69%	1.73%	68.15%	1.54%	4.54%	0.19%
2010年度	19.91%	1.42%	-8.29%	1.19%	28.20%	0.23%
2011年度	-23.48%	1.13%	-18.30%	0.97%	-5.18%	0.16%
2012年度	10.69%	1.12%	6.88%	0.96%	3.81%	0.16%
2013年度	13.04%	1.15%	-4.73%	1.04%	17.77%	0.11%
2014年度	14.80%	1.24%	38.62%	0.91%	-23.82%	0.33%
2015年1月1日至2015年3月31日	59.44%	2.00%	11.43%	1.37%	48.01%	0.63%

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：嘉实策略混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006年12月12日至2015年3月31日）

注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十一部分（二、投资范围和六、（二）投资组合限制）的有关约定。

十三、费用概览

（一）基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

（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1.5%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×1.5%÷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。

（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2.5‰的年费率计提。计算方法如下：

H＝E×2.5%÷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。

（3）与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用及与基金相关的会计师费和律师费、基金份额持有人大会费用。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金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。

申购金额（含申购费）	申购费率
M＜100万元	1.5%
100万元≤M＜500万元	1.0%
500万元≤M＜1000万元	0.3%
M≥1000万元	单笔1000元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购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（不含电话交易）通过汇款方式申购本基金的，前端申购费率优惠为0。

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

（2）赎回费

本基金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。

持有期限	赎回费率
＜365天	0.50%
365天≤M＜730天	0.25%
≥730天	0

赎回费用由基金份额持有人承担，其中25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

（3）转换费

基金转换费由投资者承担，用于支付有关手续费和注册登记费。转换费率按照如下方式收取：

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）

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转换为嘉实策略混合时，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×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或嘉实安心货币B全部转出时账户当前累计未付收益。

ii 嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券C转换为嘉实策略混合时，采用“赎回费+申购费率”算法：

净转入金额＝ B×C×(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。

iii 嘉实策略混合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、嘉实优质企业股票、嘉实主题新动力股票、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选、嘉实中创400联接、嘉实优化红利、嘉实纯债债券A、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实泰和混合、嘉实新兴产业股票、嘉实医疗保健股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票互转，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时，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。

iv 嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接转入嘉实策略混合时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

净转入金额＝ B×C×(1－D)/（1+G）

转换补差费用＝ [B×C×(1－D)/（1+G）]×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 ＜ 90天，则固定补差费率为0.2%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

v 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转入嘉实策略混合时，采用“赎回费+固定补差费率”算法：

净转入金额＝ B×C×(1－D)/（1+G）

转换补差费用＝ [B×C×(1－D)/（1+G）]×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 ＜ 90天，则固定补差费率为0.5%。

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

i 对于“前端转前端”的模式，采用以下规则：

a）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、嘉实机构快钱货币A、嘉实机构快钱货币B、嘉实机构快钱货币C转换为嘉实策略混合时，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×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或嘉实安心货币B全部转出时账户当前累计未付收益。

b）嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券C转换为嘉实策略混合时，采用“赎回费+申购费率”算法：

净转入金额＝ B×C×(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。

c）嘉实策略混合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、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实多元债券A、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选、嘉实中创400联接、嘉实优化红利、嘉实纯债债券A、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实泰和混合、嘉实新兴产业股票、嘉实医疗保健股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票互转、嘉实转入嘉实货币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时，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。

ii 对于“后端转后端”的模式，采用以下规则：

a）若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

b）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转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。

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：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；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；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。

（4）销售服务费

基金管理人可以选取适当的时机（但应于中国证监会发布有关收取开放式证券投资基金销售费用的规定后）开始计提销售服务费，但至少应提前2个工作日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用，根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

（二）不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

（三）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协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率等至本基金合同第十四部分第二款规定的费率水平以上时，须召开基金份额持有人大会审议；在第二款规定的费率水平以内，调整基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

（四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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：更新了托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分：新增了江南农商行、天风证券、众禄基金3家代销机构，并更新了相关代销机构信息。

5.在“八、基金份额的申购与赎回”部分：根据相关公告降低了投资者通过本公司电话交易办理首次投资金额、追加投资金额的单笔最低要求。

6.在“九、基金转换”部分：更新了基金转换的相关内容。

7.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。

8.在“十二、基金的业绩”部分：基金业绩更新至2015年一季度末。

9.在“二十六、其他应披露事项”部分：列示了2014年12月12日至2015年6月12日本基金临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2015年7月25日

关于九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金调低管理费率和托管费率的公告

由本公司担任基金管理人、中国农业银行担任基金托管人的九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证监会证监许可[2014]1135号文批准，成立于2015年7月23日。

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》等相关法律法规及本基金《基金合同》、《招募说明书》等基金发售法律文件有关规定，经本公司深入的研究分析，决定调低本基金管理费率和托管费率。具体如下：

一、费率调整

根据《九泰天宝灵活配置混合型证券投资基金基金合同》“第八部分 基金份额持有人大会”、“第十五部分 基金费用与税收”等章节的相关规定：本基金在运作期调低基金管理费、基金托管费的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改基金合同，无需召开基金份额持有人大会。

本基金现行管理费率和托管费率如下所示：

费率种类	年费率
基金管理费	1.50%
基金托管费	0.25%

经本公司深入研究分析，考虑将本基金管理费率和托管费率调整为：

费率种类	年费率
基金管理费	0.80%
基金托管费	0.15%

基金管理人将在更新本基金招募说明书时对招募说明书中相应内容进行及时更新。

二、上述变更事项对本基金投资及基金份额持有人利益无不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规及基金合同的规定。上述修改自公告之日起生效。

特此公告。

九泰基金管理有限公司
2015年7月25日

证券代码：601599 证券简称：鹿港科技 公告编号：2015-041

江苏鹿港科技股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

重要内容提示：

● 公司股票连续三个交易日收盘价格涨幅偏离值累计超过 20%，属于股票交易异常波动。

● 经公司自查并向控股股东及实际控制人核实，不存在应披露而未披露的重大信息。

一、股票交易异常波动的具体情况

2015 年 7月 22 日、7 月23 日、7月 24日，公司股票交易价格连续三个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计超过 20%，根据《上海证券交易所交易规则》的有关规定，属于股票交易价格异常波动的情形。

二、公司关注并核实的相关情况

经公司自查，公司目前生产经营正常，公司前期披露的收购浙江天意影视有限公司、艺能（北京）科技有限的相关事项尽职调查和审计评估工作已完成；公司披露投资上海望盛金融信息服务有限公司也在尽职调查过程中；公司前期非公开发行股票事项仍在反馈过程中，未出现以上事项中止情况或停止情况，都在有序进行中。

公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。公司不存在其他应披露而未披露的重大信息，包括但不限于重大资产重组、发行股份、上市公司收购、债务重组、业务重组、资产剥离和资产注入等重大事项。

经向实际控制人钱文龙先生函证确认，公司实际控制人不存在应披露而未披露的重大信息，包括但不限于重大资产重组、发行股份、上市公司收购、债务重组、业务重组、资产剥离和资产注入等重大事项。

三、是否存在应披露而未披露的重大信息的声明

公司董事会确认，根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定，公司目前不存在任何应披露而未披露的事项或与该事项有关的筹划、商谈、意向、协议等，董事会也未获悉本公司有根据《股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的、对公司股票交易价格产生较大影响的信息。”

四、上市公司认为必要的风险提示

公司指定信息披露网站、媒体为上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》，有关公司信息以公司在上述指定网站、媒体刊登的公告为准，敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

江苏鹿港科技股份有限公司
2015 年 7 月24日

证券代码：600379 证券简称：宝