（上接B057版）

| | | |
|---|---|---|
| 146 | 中山证券有限责任公司 | 办公地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层<br>法定代表人：林炳城<br>联系人：罗芝琳<br>电话：0755-82943755<br>传真：0755-82960582<br>客服电话：95329<br>网址：http://www.zszq.com.cn |
| 147 | 国融证券股份有限公司 | 办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18路<br>法定代表人：张智河<br>联系人：董晶盛<br>电话：(010)66412937<br>传真：(010)66412537<br>客服电话：4006609839<br>网址：http://www.grzq.com |
| 148 | 江海证券有限公司 | 办公地址：哈尔滨市松北区创新三路833号<br>法定代表人：赵洪波<br>联系人：周俊<br>电话：0451-85863726<br>传真：0451-82337279<br>客服电话：400-666-2288<br>网址：http://www.jhzq.com.cn/ |
| 149 | 国金证券股份有限公司 | 办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼<br>法定代表人：冉云<br>联系人：刘明鹏、贾鹏<br>电话：028-86690057，028-86690058<br>传真：028-86690126<br>客服电话：95310<br>网址：http://www.gjzq.com.cn |
| 150 | 华宝证券有限责任公司 | 办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层<br>法定代表人：陈林<br>联系人：夏元<br>电话：(021)68777222<br>传真：(021)68777822<br>客服电话：4008209898<br>网址：http://www.cnhbstock.com |
| 151 | 长城国瑞证券有限公司 | 办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼<br>法定代表人：王勇<br>联系人：林丹<br>电话：(0592)2079259<br>传真：(0592)2079602<br>客服电话：400-0099-886<br>网址：https://www.gwgsc.com/ |
| 152 | 爱建证券有限责任公司 | 办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼（陆家嘴商务广场）<br>法定代表人：祝健<br>联系人：姚盛盛<br>电话：(021)22229888<br>传真：021-68728703<br>客服电话：4001962502<br>网址：http://www.ajzq.com |
| 153 | 华融证券股份有限公司 | 办公地址：北京朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦18层<br>法定代表人：祝献忠<br>联系人：李慧灵<br>电话：010-85556100<br>传真：010-85556088<br>客服电话：400-898-4999<br>网址：http://www.hrsec.com.cn |
| 154 | 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<br>法定代表人：余磊<br>联系人：岑妹妹<br>电话：027-87617017<br>传真：027-87618963<br>客服电话：4008000026<br>网址：http://www.tfzq.com |
| 155 | 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 | 办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006<br>法定代表人：马勇<br>联系人：文爱<br>电话：010-83363101<br>传真：010-83363072<br>客服电话：400-118-1166<br>网址：http://www.xinlande.com.cn |
| 156 | 上海挖财基金销售有限公司 | 办公地址：上海浦东杨高南路799号3号楼5楼<br>法定代表人：冷飞<br>联系人：孙琦<br>电话：021-50810687<br>传真：021-58300279<br>客服电话：021-50810673<br>网址：http://www.wacaijijin.com |
| 157 | 腾安基金销售(深圳)有限公司 | 办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼<br>法定代表人：刘明军<br>联系人：谭广锋<br>电话：0755-86013388-80618<br>传真：-<br>客服电话：95017<br>网址：http://www.tenganxinxi.com 或 http://www.txfund.com |
| 158 | 北京百度百盈基金销售有限公司 | 办公地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101<br>法定代表人：张旭阳<br>联系人：杨琳<br>电话：010-61952702<br>传真：010-61951007<br>客服电话：95055 |
| 159 | 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 | 办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座12楼<br>法定代表人：祖国明<br>联系人：韩爱彬<br>电话：021-60897840<br>传真：0571-26697013<br>客服电话：4000-766-123<br>网址：http://www.fund123.cn |
| 160 | 北京汇成基金销售有限公司 | 办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室<br>法定代表人：王伟刚<br>联系人：丁向坤<br>电话：010-56282140<br>传真：010-62680827<br>客服电话：400-619-9059<br>网址：http://www.hcjijin.com/ |
| 161 | 北京新浪仓石基金销售有限公司 | 办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室<br>联系人：付文红<br>电话：010-62676405<br>传真：010-62676582<br>客服电话：010-62675369<br>网址：http://www.xincai.com |
| 162 | 上海万得基金销售有限公司 | 办公地址：中国（上海）浦东新区福山路33号9楼<br>法定代表人：王廷富<br>联系人：姜吉灵<br>电话：021-68882280<br>传真：021-68882281<br>客服电话：400-821-0203<br>网址：https://www.520fund.com.cn/ |
| 163 | 凤凰金信(银川)基金销售有限公司 | 办公地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路142号14层办公房<br>法定代表人：程刚<br>联系人：张旭<br>电话：010-58160168<br>传真：010-58160173<br>客服电话：400-810-555919<br>网址：http://www.fengjrd.com/ |
| 164 | 和耕传承基金销售有限公司 | 办公地址：郑州市郑东新区东风东路康宁街北6号楼6楼602、603房间<br>法定代表人：李淑慧<br>联系人：裴小龙<br>电话：0371-85518395 4000-555-671<br>传真：0371-85518397<br>网址：HOCFB.COM |
| 165 | 南京途牛金融信息服务有限公司 | 办公地址：南京市玄武区玄武大道699-32号<br>法定代表人：宋时琳<br>联系人：王旋<br>电话：025-86853960 025-86853969<br>传真：025-86853969<br>网址：http://www.tuniufu.com |
| 166 | 北京肯特瑞基金销售有限公司 | 办公地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06<br>法定代表人：江卉<br>联系人：江卉<br>电话：4000988511<br>传真：010-89188000<br>客服电话：010-89188462<br>网址：http://fund.jd.com |
| 167 | 北京蛋卷基金销售有限公司 | 办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222907<br>法定代表人：钟斐斐<br>联系人：侯芳芳<br>电话：010-61840688<br>传真：010-61840699<br>客服电话：400-159-9288<br>网址：http://www.ncfj.com |
| 168 | 深圳前海微众银行股份有限公司 | 办公地址：广东省深圳市南山区沙河西路1819号深圳湾科技生态园7栋A座<br>法定代表人：顾敏<br>联系人：苏菱<br>电话：13469952231<br>传真：0755-86700688<br>客服电话：400-999-8877<br>网址：http://www.webank.com/ |

（二）基金注册登记机构

| | |
|---|---|
| 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 | 经雷 |
| 联系人 | 彭鑫 |
| 电话 | （010）65215588 |
| 传真 | （010）65185678 |

（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 | 韩炯 | 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 | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室 | | |
| 办公地址 | 上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心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、基金名称

本基金名称：嘉实优化红利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

本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

## 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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），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、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等固定收益类资产，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：股票资产占基金资产的比例为60-95%；债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为5-40%，其中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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

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

红利是投资者进行股票投资并获得投资收益的重要组成，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，通过严格执行投资风险管理固化和明晰基金的风格特征，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值；同时以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险；并且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。

1、大类资产配置策略

在大类资产配置上，本基金首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，投资决策委员会将重点评估以下几个因素：宏观因素——包含重要经济数据以及货币和财政政策的变化；市场因素——包含货币供给指标以及流动性的变化对资本市场的影响；估值因素——包含不同市场之间的相对估值变化；同时，本基金作为主动管理的股票基金，也将参考宏观策略部门提供的研究分析建议，并结合投资组合的长期收益获取能力综合考虑作出大类资产配置决策。

在控制风险的前提下，本基金将优先配置股票资产，同时以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。本基金股票资产占基金资产的比例为60-95%，本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的股票。

2、红利股票投资策略

本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票。在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票，稳定的股息收入是当期收益的重要组成，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。市场的波动也为投资者进行红利再投资以获得高额复利回报提供了机会。红利策略在牛市中是锦上添花，在熊市中提供复利回报，这是红利策略能够穿越牛熊市，实现长期价值投资回报的基本逻辑。监管层提出的要求上市公司树立牢固的分红意识，上市公司采取措施完善分红政策及其决策机制，进一步加强对上市公司利润分配决策过程和执行情况的监管，以及要求在公司招股说明书中细化回报规划、分红政策和分红计划是对分红理念的肯定。

本基金在股票池的选取上突出对红利股票的侧重，本基金的股票池由市场上高股息率的股票组成，不分红或低分红的股票被自动排除在股票池外。本基金根据上市公司的分红历史，选取在过去两年连续分红，过去两年累积净利润大于0的公司组成备选股票池，本基金按照股息率对备选股票池的股票进行排序，选取排名前50%的股票构成最终的红利股票池。

高红利的股票提供了高的当期回报，而红利的稳定增长决定了未来的资本利得。在一个偏重价值属性的股票库中挑选具有成长性的股票是本基金投资策略的核心。本基金通过运用嘉实优化红利股票模型，通过选取能够体现公司的竞争优势、盈利能力、内生增长能力的因子和能够体现公司财务状况、抗周期波动能力、和分红持续性的因子，寻找基本面健康、具有技术优势、品牌优势和市场优势、内生增长能力好、财务健康、经营风险小、抗周期能力强，且能够实现稳定增长的高红利股票进行投资。

具体的，本基金主要运用下列量化指标分析上市公司的基本面特征，具体包括：

（1）毛利率。高毛利率的公司具有一定的技术优势，品牌优势和市场优势，主要集中在壁垒较高的行业或掌握核心技术，具有技术优势，品牌优势和市场优势的细分行业龙头；

（2）ROE，即净资产收益率。高ROE公司具有较高的资本的利用效率，在没有外来融资的情况下，高ROE的公司具有高的内生增长的潜力；

（3）业绩波动。低业绩波动的公司经营稳定，抗周期能力强，分红的持续性好；

（4）负债率和流通比率。低负债率和高流通比率的公司财务健康、流通性好、经营风险小。

本基金将充分利用基金管理人强大的研究平台及有关团队的成果，对高红利的公司股票进行深入分析，尽力降低陷入价值陷阱的概率，从而降低投资的非系统性风险，力争提高长期的投资回报。本基金在充分考虑交易成本后，对股票组合进行优化分析，以实现风险收益的最佳匹配。

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、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。

5、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。

## 九、基金的业绩比较基准

中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本，指数加权方式同沪深300指数，以反映A股市场高红利股票的整体状况和走势。

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，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，属较高风险、较高收益的品种。

## 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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019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2019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 | 2,323,654,414.76 | 90.00 |
| | 其中：股票 | 2,323,654,414.76 | 90.00 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 129,831,000.00 | 5.03 |
| | 其中：债券 | 129,831,000.00 | 5.03 |
| | 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 | 78,705,582.82 | 3.05 |
| 8 | 其他资产 | 49,785,133.53 | 1.93 |
| 9 | 合计 | 2,581,976,131.11 | 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 | 87,259,322.52 | 3.42 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,417,722,543.25 | 55.61 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 152,513,693.80 | 5.98 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 47,215,962.41 | 1.85 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 32,902.94 | 0.00 |
| J | 金融业 | 215,055,953.04 | 8.44 |
| K | 房地产业 | 241,711,368.80 | 9.48 |
| 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 | 162,142,668.00 | 6.36 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,323,654,414.76 | 91.14 |

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 | 000661 | 长春高新 | 668,558 | 211,926,200.42 | 8.31 |
| 2 | 600763 | 通策医疗 | 2,299,896 | 162,142,668.00 | 6.36 |
| 3 | 002032 | 苏泊尔 | 1,958,549 | 146,949,931.47 | 5.76 |
| 4 | 002415 | 海康威视 | 3,944,949 | 138,349,361.43 | 5.43 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 1,603,088 | 123,598,084.80 | 4.85 |
| 6 | 600660 | 福耀玻璃 | 4,669,400 | 113,606,502.00 | 4.46 |
| 7 | 601933 | 永辉超市 | 12,101,700 | 104,558,688.00 | 4.10 |
| 8 | 600048 | 保利地产 | 6,932,600 | 98,720,224.00 | 3.87 |
| 9 | 000858 | 五粮液 | 1,021,600 | 97,052,000.00 | 3.81 |
| 10 | 000002 | 万科A | 3,016,590 | 92,669,644.80 | 3.63 |

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 | 129,831,000.00 | 5.09 |
| | 其中：政策性金融债 | 129,831,000.00 | 5.09 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 129,831,000.00 | 5.09 |

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 | 190301 | 19进出01 | 1,300,000 | 129,831,000.00 | 5.09 |

注：报告期末，本基金仅持有上述1支债券。

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)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 | 619,144.59 |
| 2 | 应收证券清算款 | 45,267,617.13 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 680,349.11 |
| 5 | 应收申购款 | 3,218,022.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 49,785,133.53 |

(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

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

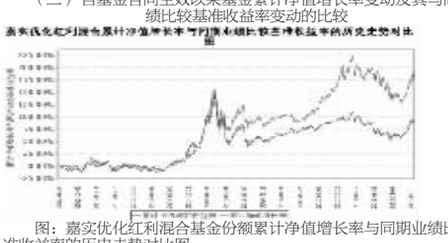
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效（2012年6月26日）起至2012年12月31日 | 1.70% | 1.04% | 5.56% | 1.13% | -3.86% | -0.09% |
| 2013年度 | -1.18% | 1.22% | -9.43% | 1.41% | 8.25% | -0.19% |
| 2014年度 | 21.29% | 1.06% | 48.99% | 1.08% | -27.70% | -0.02% |
| 2015年度 | 81.03% | 2.27% | 26.25% | 2.51% | 54.78% | -0.24% |
| 2016年度 | -13.58% | 1.20% | -7.01% | 1.35% | -6.57% | -0.15% |
| 2017年度 | 55.03% | 1.03% | 16.69% | 0.56% | 38.34% | 0.47% |
| 2018年度 | -20.73% | 1.47% | -18.08% | 1.14% | -2.65% | 0.33% |
| 2019年1月1日至2019年3月31日 | 26.32% | 1.36% | 22.42% | 1.24% | 3.90% | 0.11% |

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实优化红利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



图：嘉实优化红利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

（2012年6月26日至2019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“第十二部分 二、投资范围和 四、投资限制”的有关约定。

## 十三、费用概览

（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

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。管理费的计算方法如下：

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、公休假等，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0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷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3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）与基金运作有关的其他费用

主要包括基金合同生效以后的信息披露费用、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、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。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

（二）与基金销售有关的费用

1、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 | 1.5% |
| 100万元≤M＜200万元 | 1.0% |
| 200万元≤M＜500万元 | 0.6% |
| M≥500万元 | 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。

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。

注：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年 | 0.20% |
| 1年≤T（3年 | 0.10% |
| T≥3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、本基金的赎回费率按照持有时间递减，并对持有期限少于两年的基金份额的赎回收取赎回费，即相关基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|
| T＜7天 | 1.50% |
| 7天≤T＜365天 | 0.50% |
| 365天≤T＜730天 | 0.25% |
| T≥730天 | 0 |

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中对持续持有期少于7日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产；除此之外的赎回费中25%的部分归入基金资产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

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体上公告。

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。

在开放期内，本基金可对通过基金管理人直销“定期定额投资”的方式申购基金的投资者按累计定投期数实施特殊申购费率安排，具体规定以本基金份额发售公告和届时相关公告为准。

3、基金转换费用

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

（1）通过代销机构办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

（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）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时，每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费；非0申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

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。

（3）通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式）

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。

（4）基金转换份额的计算方式

基金转换采取未知价法，以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下：

转出基金金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值

转出基金赎回费用=转出基金金额×转出基金赎回费率

转出基金申购费用=（转出基金金额-转出基金赎回费用）×转出基金申购费率÷（1+转出基金申购费率）

转入基金申购费用=（转出基金金额-转出基金赎回费用）×转入基金申购费率÷（1+转入基金申购费率）

申购补差费用=MAX（0，转入基金申购费用-转出基金申购费用）

转换费用=转出基金赎回费用+申购补差费用

净转入金额=转出基金金额-转换费用

转入份额=净转入金额/转入基金当日基金份额净值

转出基金有赎回费用的，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。

注：嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实超短债债券、嘉实新趋势混合、嘉实信用债券、嘉实多元债券、嘉实逆向策略股票、嘉实快钱货币A、嘉实债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）有单日单个基金账户的累计申购（转入）限制；嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合暂停申购（含转入）业务；具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

5.3 其他与转换相关的事项

（1）基金转换的时间：投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

（2）基金转换的原则：

①采用份额转换原则，即基金转换以份额申请；

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

③基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算；

1 公告基本信息

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实丰益纯债定期债券 |
| 基金主代码 | 000116 |
| 基金运作方式 | 契约型、以定期开放方式运作 |
| 基金合同生效日 | 2013年5月21日 |
| 基金管理人名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人名称 | 中国银行股份有限公司 |
| 基金注册登记机构名称 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 公告依据 | 《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金招募说明书》 |
| 申购起始日 | 2019年8月12日 |
| 赎回起始日 | 2019年8月12日 |
| 转换转入起始日 | 2019年8月12日 |
| 转换转出起始日 | 2019年8月12日 |

注：投资者范围：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构

投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

2 申购、赎回、转换业务的办理时间

（1）开放日及开放时间

2019年8月12日（含该日）至2019年8月23日（含该日）为本基金第六个开放期。投资人在开放期内的每个开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

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

（2）申购、赎回开始日及业务办理时间

在确定开放期申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

如果由于不可抗力的原因导致原定开放起始日或开放期不能办理基金的申购与赎回，开放起始日或开放期相应顺延。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的，详见招募说明书的有关规定。

3 申购业务

3.1 申购金额限制

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币1元，追加申购单笔最低限额为人民币1元。投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元，但已持有本基金份额的投资者可以通用首次单笔最低限额人民币1元，追加申购单笔最低限额为人民币1元。但若有代销机构特别约定首次申购单笔及追加单笔最低限额并已经发布临时公告，则以该等公告为准。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制。

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

3.2 申购费率

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。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户包括全国社会保障基金、地方社会保障基金（若法规允许）、企业年金单一计划及集合计划、企业年金养老金产品等。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率见下表：

| 申购金额（含申购费） | 申购费率 |
|---|---|
| M＜50万元 | 0.24% |
| 50万元≤M＜100万元 | 0.20% |
| 100万元≤M＜300万元 | 0.16% |
| 300万元≤M＜500万元 | 0.08% |
| M≥500万元 | 按笔收取，1000元/笔 |

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：

| 申购金额（含申购费） | 申购费率 |
|---|---|
| M＜50万元 | 0.60% |
| 50万元≤M＜100万元 | 0.50% |
| 100万元≤M＜300万元 | 0.40% |
| 300万元≤M＜500万元 | 0.20% |
| M≥500万元 | 按笔收取，1000元/笔 |

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购开放式基金业务，其申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%。但中国银行长城借记