(上接B033版)

年度观察日基金份额净值的98%两者之中的较大值，当期运作期第三年的护本目标自当期运作期第二个年度观察日后至当期运作期期满的一年内有效；

4 依此类推，本基金在当期运作期的每一年重新确定护本目标，直至每个当期运作期期满。

在本基金合同中，嘉实固定比例投资组合保险机制是指，嘉实基金管理有限公司根据护本目标，在基金合同约定的资产配置比例范围内，动态分配基金资产在权益类资产和固定收益类资产上投资比例的投资规则和监控流程：

① 根据数量模型，确定基金的安全垫子；

② 根据安全垫子和放大倍数（小于等于3）确定权益类资产投资比例上限；

③ 动态调整权益类资产投资比例，权益类资产实际投资比例不超过权益类资产投资比例上限。

2、 债券投资策略

（1）构建组合

本基金将部分资产，投资于剩余期限匹配组合当期运作期剩余期限、具有较高信用等级的中短期债券，以持有到期策略为主，构建本基金组合的基本配置。

本基金在单个债券选择上，首先，根据个券的剩余期限、久期、信用等级、流动性指标，决定是否将该债券纳入组合的债券备选池；其次，根据个券的收益率（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，对照本基金的收益要求决定是否纳入组合；最后，根据个券的流动性指标（发行总量、流通量、上市时间），决定个券的投资总量。

（2）嘉实债券组合风险控制措施

在利率风险控制上，首先，本基金参照当期运作期剩余期限、保持部分债券资产持有到期的基本配置。再有，本基金主要从组合层面、个券层面、及交易场所选择等方面，防范和控制价格波动风险。在组合层面，本基金根据对市场利率变动趋势的主动预测及模型测试，调整和控制组合久期。在个券层面，本基金通过凸性分析，在债券备选池中选择波动特性较优的单个债券。在交易场所选择上，本基金根据对影响流动性因素的动态分析，适当控制在同一交易场所上市交易、且现券价格波动幅度较大的现券资产的配置比例。此外，在预测利率走势、控制基金资产净值波动幅度、保持组合适当流动性的基础上，本基金优化组合的期限结构，以适当降低机会成本风险和再投资风险。

在信用风险控制上，本基金根据国家有权机构批准或认可的信用评级机构的信用评级，依靠嘉实信用分析团队、及嘉实中央研究平台的其他资源，深入分析挖掘发债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况，严格遵守嘉实信用分析流程、执行嘉实信用投资纪律。

在流动性风险控制上，日常运作中，本基金优先由现金和到期的短期债券逆回购提供一级流动性保障；由现券或个股提供二级流动性保障，本基金通过适当配置流动性较好的类属品种、控制个券信用等级、分散化组合投资，保持二级流动性保障。每个当期运作期接近期满时，首先，本基金通过控制剩余期限匹配当期运作期剩余期限的债券资产的投资比例、运用以持有到期为主的投资策略，保护组合流动性；其次，本基金根据对投资人需求的动态跟踪和判断，适当提高流动性较高的资产的配置比例，增强组合流动性。

（3）优化组合

在嘉实债券组合风险控制措施下，本基金根据对宏观经济趋势、货币及财政政策趋势、债券市场供求关系、信用息差水平等因素的动态分析，还可对部分资产，适当运用久期调整、期限结构调整、互换、息差等积极的主动投资策略，挖掘生息资产的内在价值，优化组合的风险收益和流动性。

① 久期调整策略

本基金根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

② 期限结构调整策略

本基金通过考察市场收益率曲线的动态变化及预期变化，可适当调整长期、中期和短期债券的配置方式，以求适当降低机会成本风险和再投资风险，或从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。

③ 互换策略

本基金可同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，利用不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面的差别，赚取收益率差。

④ 息差策略

本基金可通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，获得杠杆放大收益。

3、 可转债投资策略

本基金将根据可转债的底价溢价率和到期收益率来判断其债性，根据可转债的平价溢价率和Delta系数大小来判断其股性强弱。当可转债类属资产的债性较强时，将参照债券类资产的投资策略予以管理，当可转债类属资产的股性较强时，将参照股票类资产的投资策略予以管理。

4、 权益类投资策略

本基金采用收益增强型权益类投资策略，遵守嘉实固定比例投资组合保险机制的投资规则，执行组合动态监控流程，谨慎运作。

（1） 新股申购策略

本基金将充分考虑新股中签率、锁定期、和上市后表现的预期等因素，有效识别并防范风险，深入发掘新股内在价值，相机参与新股申购。

（2） 二级市场股票投资策略

本基金将依据自上而下的动态研究，发挥时机选择能力，通过流动性较高的分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险。

本基金运用嘉实研究平台，配置行业和个股，优化组合。本基金重点关注已经或即将进入成长期但距离成熟期和衰退期较远的行业，辅之以“行业轮换”策略，同时关注嘉实研究平台构建的动态“主题型企业群”，精选流动性高、安全边际高、具有上涨潜力的个股，力求增强组合的当期收益。

（3） 套利策略

本基金依托嘉实研究平台，采用定性定量方法，分析企业兼并收购中的风险收益，寻找低风险的套利机会，择机运用并购套利等策略适当操作，及时跟踪市场反映，更新评估分析，动态调整组合，力争在保持组合较低波动幅度的前提下获得稳定收益。

（二）投资决策

1、决策依据

（1）国家有关法律、法规和本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

本基金当期运作期平均年化收益率 = 三年期定期存款利率 + 1.6%

上述“三年期定期存款利率”是指当期运作期的第一个工作日中国人民银行网站上发布的三年期“金融机构人民币存款基准利率”。

上述业绩比较基准能反映本基金“以绝对回报型的债券基金，追求持续稳妥地高于存款利率的收益”的产品定位，符合本基金的风险收益特征，易于广泛地被投资人理解，因而较为适当。

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。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年7月16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2014年6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	144,967,058.79	7.43
	其中：股票	144,967,058.79	7.43
2	固定收益投资	1,700,964,708.40	87.22
	其中：债券	1,680,964,708.40	86.19
	资产支持证券	20,000,000.00	1.03
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	62,392,488.25	3.20
7	其他资产	41,978,197.06	2.15
	合计	1,950,302,452.50	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	9,661,115.26	0.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	34,445,503.62	2.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,536,654.10	0.68
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,993,767.10	1.16
J	金融业	57,800,800.51	3.73
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	14,529,218.20	0.94
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	144,967,058.79	9.35

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	600016	民生银行	3,418,758	21,230,487.18	1.37
2	000001	平安银行	2,084,622	20,658,604.02	1.33
3	600406	国电南瑞	1,349,870	17,993,767.10	1.16
4	000400	许继电气	770,431	15,447,141.55	1.00
5	000826	桑德环境	635,852	14,529,218.20	0.94
6	600820	隧道股份	2,172,506	10,536,654.10	0.68
7	601166	兴业银行	1,033,209	10,363,086.27	0.67
8	002477	雏鹰农牧	1,026,686	9,661,115.26	0.62
9	600388	龙净环保	358,775	8,664,416.25	0.56
10	601766	中国南车	1,223,895	5,507,527.50	0.36

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	80,016,000.00	5.16
	其中：政策性金融债	80,016,000.00	5.16
4	企业债券	734,827,804.00	47.41
5	企业短期融资券	412,783,000.00	26.63
6	中期票据	391,934,000.00	25.29
7	可转债	61,403,904.40	3.96
8	其他	-	-
	合计	1,680,964,708.40	108.45

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	041358064	13山钢CP002	1,000,000	100,890,000.00	6.51
2	130236	13国开36	800,000	80,016,000.00	5.16
3	041463015	14首钢CP001	800,000	79,968,000.00	5.16
4	041356036	13川高速CP001	600,000	60,582,000.00	3.91
5	124221	13武地产	600,000	59,160,000.00	3.82

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	119031	澜沧江3	200,000	20,000,000.00	1.29

注：报告期末，本基金仅持有上述1只资产支持证券。

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	51,269.15
2	应收证券清算款	4,722,838.64
3	应收股利	-
4	应收利息	37,167,057.38
5	应收申购款	37,031.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	41,978,197.06

(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	42,056,960.00	2.71
2	113005	平安转债	10,085,944.40	0.65

(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。

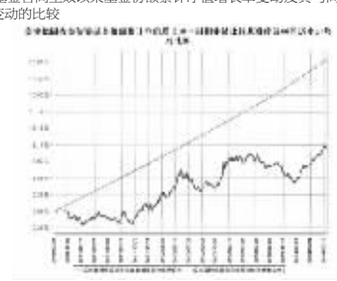
十二、基金的业绩

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。

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

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(2010年9月1日)起至2010年12月31日	-1.20%	0.12%	1.77%	0.02%	-2.97%	0.10%
2011年	1.82%	0.12%	4.93%	0.01%	-3.11%	0.11%
2012年	3.78%	0.17%	4.94%	0.01%	-1.16%	0.16%
2013年	0.15%	0.15%	5.16%	0.02%	-5.01%	0.13%
2014年上半年	4.56%	0.09%	2.86%	0.02%	1.70%	0.07%

2. 自基金合同生效以来基金份额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：嘉实稳固收益债券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
（2010年9月1日至2014年6月30日）

注1：按基金合同约定，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投资组合比例符合基金合同“十一、基金的投资（二）投资范围和（六）2.投资组合限制”的有关约定。

注2：2014年4月18日，本基金管理人发布《关于嘉实稳固收益债券基金经理变更的公告》，陈绪新先生不再担任本基金基金经理；聘请曲扬女士担任本基金基金经理职务。

注3：2014年6月20日，本基金管理人发布《关于新增嘉实稳固收益债券基金经理的公告》，聘请裴晓辉先生担任本基金基金经理职务，与现任基金经理曲扬女士共同管理本基金。

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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.65%年费率计提。计算方法如下：

H = E × 0.65% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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、公休假等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.18%年费率计提。计算方法如下：

H=E × 0.18% ÷ 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付。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（3）销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.4%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H = E × 0.4% ÷ 当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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销售服务费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中划出，经基金注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金申购费率最高不超过申购金额的5%。

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。

本基金申购费率为零。

（2）赎回费

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金赎回费全部归入基金财产。

在运作期和间歇期，本基金按不同的方式收取赎回费。

1）运作期的赎回费

在运作期内，本基金的赎回费率按照基金份额持有人在当期运作期的持有时间递减，即相关基金份额在当期运作期的持有时间越长，所适用的赎回费率越低。

在适用本基金运作期的赎回费率时，本基金只计算基金份额持有人在当期运作期的持有期限，对于基金份额持有人在当期运作期以外的间歇期或运作期的持有期限不累计计算。具体如下：

当期运作期持有期限	赎回费率
不满90天	0.8%
满90天，但不满365天	0.3%
满365天，但不满730天	0.2%
满730天，至本基金3年当期运作期期满日之间(含该期满日)	0.1%

2）间歇期的赎回费

在间歇期内，本基金的赎回费率为零。

（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）

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转入嘉实稳固收益债券时，不收取转换费用，计算公式如下：

净转入金额=B × C + 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；

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.嘉实稳固收益债券与嘉实信用债券C、嘉实纯债债券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。

c.嘉实稳固收益债券转换为嘉实成长收益混合、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、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券A、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、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 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。

d.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、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、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、嘉实优化红利、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、嘉实泰和混合转入嘉实稳固收益债券时，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。

e.嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接转入嘉实稳固收益债券时，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。

f.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转入嘉实稳固收益债券时，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。

2）通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务

a.对于“前端转前端”的模式，采用以下规则：

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、嘉实安心货币转入嘉实稳固收益债券时，不收取转换费用，计算公式如下：

净转入金额=B × C + 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；

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。

②嘉实稳固收益债券与嘉实信用债券C、嘉实纯债债券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。

③嘉实稳固收益债券转换为嘉实成长收益混合、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、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券A、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、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。

④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、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、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、嘉实泰和混合转入嘉实稳固收益债券时，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。

b.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：自2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务；2014年3月12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100万元；2014年3月12日起，嘉实安心货币单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过100万元；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9月4日起，嘉实研究精选股票单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过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。

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

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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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。

（三）费用调整

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、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，或在不提高基金管理费、基金托管费或基金销售服务费费率水平的情况下改变收费方式，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日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（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：更新了基金托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分：新增苏州银行、和讯信息科技、瑞丰银行、同花顺、华安证券、宏信证券六家代销机构，并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内容。

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2014年二季度末。

8.在“二十五、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2014年3月1日至2014年9月1日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2014年10月14日

证券代码：000918 证券简称：嘉凯城 公告编号：2014-039

嘉凯城集团股份有限公司股票交易异常波动公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、股票交易异常波动情况

嘉凯城集团股份有限公司（以下简称“公司”、“本公司”）股票2014年10月9日、10月10日和10月13日连续三个交易日收盘价格涨幅偏离值累计超过20%，根据《深圳证券交易所交易规则》的有关规定，属于股票交易异常波动。

二、关注、核实情况说明

经与公司董事会、管理层及控股股东核实，就有关情况说明如下：

1、公司前期披露的信息不存在需要更正、补充之处。

2、近期公共传媒未报道可能或已经对本公司股票交易价格产生较大影响的未公开重大信息。

3、近期公司经营情况及内外部经营环境未发生或预计将要发生重大变化。

4、公司目前除了已披露的信息外，公司、控股股东和实际控制人不存在关于本公司的应披露而未披露的重大事项，也不存在处于筹划阶段的其他重大事项。

5、经查询，控股股东及实际控制人在本公司股票交易异常波动期间未买卖本公司股票。

三、不存在应披露而未披露信息的说明

公司董事会确认，公司目前没有任何根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露的事项或有关重大事项正在筹划、商谈、意向、协议等情形；董事会也未获悉本公司有根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定应予以披露而未披露，对本公司股票交易价格产生较大影响的信息；公司不存在违反公平信息披露的情形；公司前期披露的信息亦不存在需要更正、补充之处。

四、公司认为必要的风险提示

1、本公司承诺，未来三个月内不会筹划重大资产重组、重大资产收购、发行股份等重大事项。

2、本公司预计，2014年1-9月，公司归属于上市公司股东的净利润约为-6000万元（详细情况见本公司8月13日披露的《2014年三季度业绩预告》）。

3、经自查，公司不存在违反信息公平披露的情形。

五、公司信息披露的指定媒体

公司指定的信息披露媒体为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网，有关公司的信息均以在上述指定媒体刊登的信息为准，请广大投资者理性投资，注意风险。

特此公告。

嘉凯城集团股份有限公司董事会
二〇一四年十月十三日

证券代码：000977 证券简称：浪潮信息 公告编号：2014-064

浪潮电子信息产业股份有限公司 2014年前三季度业绩预增公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、本期业绩预计情况

1. 业绩预告期间：2014年1月1日-2014年9月30日

2. 预计的业绩：(亏损 (扭亏为盈 √同向上升 (同向下降

项 目	本报告期	上年同期	增减变动(%)
	2014年1月1日-2014年9月30日	2013年1月1日-2013年9月30日	
净利润	17,333.54万元-22,148.42万元	9,629.75万元	增长：80%-130%
基本每股收益	0.3698元-0.4725元	0.2240元	增长：65%-111%

二、业绩预告预审计情况

本次业绩预告未经注册会计师预审计。

三、业绩变动原因说明

公司2014年前三季度业绩同向大幅增长的主要原因为：本公司2014年前三季度主营业务增长及处置部分东港股份有限公司股票（该公司于2007年3月2日在深圳中小企业板挂牌交易，证券代码：002117，证券简称：东港股份），致使公司2014年前三季度归属于母公司所有者的净利润大幅提升。

四、其他相关说明

本次业绩预告为公司财务部门初步测算，关于2014年前三季度经营业绩的具体数据，本公司将在2014年三季度报告中详细披露，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

浪潮电子信息产业股份有限公司董事会
2014年10月13日

证券代码：000428 证券简称：华天酒店 公告编号：2014-085

华天酒店集团股份有限公司2014年前三季度业绩预告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

1. 业绩预告期间：2013 年 1 月 1 日---2013 年 6 月 30 日

一、本期业绩预计情况

1. 业绩预告期间：2014年1月1日---2014年9月30日

2. 预计的业绩：亏损

项 目	本报告期 2014年1月1日至2014年9月30日	上年同期 2013年1月1日至2013年9月30日
归属于上市公司股东的净利润	亏损：1,000万元 - 300万元	盈利：15,456.49万元
基本每股收益	亏损：约0.014元-0.004元	盈利：0.215元

其中，2014 年第三季度单季度业绩情况如下：

项 目	本报告期 2014年7月1日至2014年9月30日	上年同期 2013年7月1日至2013年9月30日
归属于上市公司股东的净利润	比上年同期下降：66.91% - 59.29%	盈利：9,196.30万元
	盈利：3,043.47万元-3,743.47万元	

二、业绩预告预审计情况

本次业绩预告未经过注册会计师审计。

三、业绩变动原因说明

1、公司前三季度酒店业受相关政策持续性影响，高端酒店餐饮业绩出现下滑，酒店业亏损比上年同期有所加大；同时，资产运营业务在报告期内未有利润贡献，而去年同期资产运营业务利润贡献较大。

2、公司第三季度经营状况环比向好，主要是公司积极发展以委托合作开发为运营模式的旅游地产业，为公司作出了一定的利润贡献。

四、其他相关说明

以上财务数据均为预测数据，具体财务数据将在本公司2014年第三季度报告中详细披露。本公司信息披露的指定媒体为《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮网http://www.cninfo.com.cn/，公司所有信息均以在上述媒体正式披露的公告为准。请投资者注意投资风险。

特此公告。

华天酒店集团股份有限公司董事会
2014年10月14日

股票代码：000988 股票简称：华工科技 公告编号：2014-43

华工科技产业股份有限公司2014年前三季度业绩预告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、本期业绩预计情况

1、 业绩预告期间：2014年1月1日至2014年9月30日

2、 预计的业绩：□亏损□扭亏为盈√同向上升□同向下降

（1）预计2014年1-9月业绩变动情况

项目	2014年1-9月	2013年1-9月
归属于上市公司股东的净利润	比上年同期增长：51.57 %-62.34%	盈利：9290.55万元
	盈利：14082.09万元-15082.09 万元	
基本每股收益	盈利：0