(上接B029版)

| | | | |
|---|---|---|---|
| 办公地址 | 北京市西城区新街口外大街28号C座5层 邮编:100088 | | |
| 注册地址 | 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 邮编:100032 | | |
| 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 http://www.txsec.com | 客服电话 | 010-66045678 |

(118)江海证券有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56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 | 刘爽 |
| 电话 | 0451-85863719 | 传真 | 0451-82287211 |
| 网址 | www.jhzq.com.cn | 客服电话 | 400-666-2288 |

(119)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 |

(120)厦门证券有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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 | 傅毅辉 | 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 |

(121)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 |

(122)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 |

(123)方正证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层 | | |
| 法定代表人 | 雷杰 | 联系人 | 郭军瑞? |
| 电话 | (0731)85832503 | 传真 | (0731)85832214 |
| 网址 | www.foundersc.com | 客服电话 | 95571 |

(124)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 |

(125)西南证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所 | 重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦 | | |
| 法定代表人 | 余维佳 | 联系人 | 张煜 |
| 电话 | (023)63786141 | 传真 | (023)6378212 |
| 网址 | www.swsc.com.cn | 客服电话 | 4008096096 |

(126)日信证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所 | 呼和浩特市新城区锡林南路18号 | | |
| 办公地址 | 北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层 | | |
| 法定代表人 | 孔佑杰 | 联系人 | 冯杰 |
| 电话 | (010)83991743 | 传真 | (010)66412537 |
| 网址 | www.rxzq.com.cn | 客服电话 | 4006609839 |

(127)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 | 400-800-8899 |

(128)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 | 客服电话 | 400-8888-993 |

(129)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 |

(130)国海证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 广西桂林市辅星路13号 | | |
| 法定代表人 | 张雅锋 | 联系人 | 牛孟宇 |
| 电话 | 0755-83709350 | 传真 | 0755-83700205 |
| 网址 | www.ghzq.com.cn | 客服电话 | 95563(全国) |

(131)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 | 齐晓燕 |
| 电话 | 0755-82130833 | 传真 | 0755-82133952 |
| 网址 | www.guosen.com.cn | 客服电话 | 95536 |

(132)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 | 客服电话 | 68777877 |

(133)华安证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 办公地址 | 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 | | |
| 注册地址 | 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 | | |
| 法定代表人 | 李工 | 联系人 | 甘霖、钱欢 |
| 电话 | 055165161821 | 传真 | 055165161672 |
| 网址 | www.hazq.com | 客服电话 | 96518,4008096518 |

(134)宏信证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 办公地址 | 四川省成都市人民南路2段18号川信大厦10楼 | | |
| 注册地址 | 四川省成都市人民南路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 |

(135)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 |

注:基金管理人于2005年1月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的基金申购业务的公告》,从即日起暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的嘉实理财通系列证券投资基金(暨嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券)的申购业务。对于此前通过闽发证券、汉唐证券认购、申购的嘉实理财通系列证券投资基金(暨嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券)基金份额,基金份额持有人仍可在闽发证券、汉唐证券正常办理赎回或转托管业务。

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系列基金,并及时公告。

(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

| | | | |
|---|---|---|---|
| 名称 | 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 | 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) | | |
| 住所 | 中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层 | | |
| 法定代表人 | 葛明 | 联系人 | 李慧民 |
| 电话 | (010)65246688 | 传真 | (010)85188298 |
| 经办注册会计师 | 李慧民、王珊珊 | | |

四、基金的名称

本系列基金名称:嘉实理财通系列开放式证券投资基金

五、基金的类型

本系列基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

1. 嘉实增长混合:投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。

2. 嘉实稳健混合:在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。

3. 嘉实债券:以本金安全为前提,追求较高的组合回报。

七、基金的投资方向

1. 嘉实增长混合:本基金限于投资具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的中、小市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资重点是在流通市值占市场后50%的上市公司中寻找具有高速成长潜力的中、小市值上市公司,投资于中、小市值上市公司的比例不少于基金股票部分的80%。

2. 嘉实稳健混合:本基金限于投资具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资重点是在流通市值占市场前50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司,投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的80%。

3. 嘉实债券:主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业(公司)债(包括可转债)、回购,以及中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金还可择机参与新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值的20%。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

1. 嘉实增长混合

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制订大类资产配置比例的基础上,本基金重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票。

a. 资产配置在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:40%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%,现金留存比例:5%左右。

b. 股票选择

本基金重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,从公司基本面的分析入手,挑选具有成长潜力的股票。本基金将重点在流通市值占市场后50%的上市公司中选择具有如下特征的公司:

(i)股本规模相对较小的中小型上市公司,主营业务突出,过去两年主营业务收入占总收入80%以上,预期未来具有较强的股本扩张能力。

(ii)公司所处的行业发展前景良好,公司在本行业内具有独特的竞争优势,能充分把握行业发展的机遇,主营业务收入的增长率高于GDP增长率,预期净利润增长率大于10%。

(iii)公司的经营模式和技术创新能力与同行相比保持相对优势,能够不断推出符合市场需求的新产品,满足市场需要。

(iv)公司管理层具有良好的应变能力,能够对外部环境变化迅速作出反应。

基金管理人建立了一套基于成长性的上市公司综合评价指标体系,通过对上市公司所处行业的持续增长潜力及其在行业中的竞争地位、包括盈利能力和偿债能力在内的财务状况、企业的经营管理能力及研发能力等多方面的因素进行评估,综合考察上市公司的成长性以及这种成长性的可靠性和持续性,结合其股价所对应的市盈率水平与其成长性相比是否合理,作出具体的投资决策。

c. 债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。本基金可投资于国债、金融债和企业(公司)债(包括可转债),以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求,国债投资比例不低于基金资产的20%。

2. 嘉实稳健混合

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制订大类资产配置比例的基础上,本基金重点投资于具有竞争优势的行业龙头、优势企业的上市公司的股票,通过基本面分析挖掘行业优势企业,获取稳定的长期回报。

a. 资产配置

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。在正常市场状况下,投资组合中股票投资比例浮动范围:40%-75%;债券投资比例浮动范围:20%-55%,现金留存比例:5%左右。

b. 股票选择

主要投资于那些具有竞争优势的行业龙头、优势企业。

本基金将重点在流通市值占市场前50%的上市公司中选择具有如下特征的公司:

(i)行业发展状况良好,企业已经经历了一段快速成长期,步入稳定发展阶段,企业具备较强的抗风险能力,已经或即将成为行业的龙头、优势企业,企业经营在相对稳健的同时能够保持一定的持续成长能力;

(ii)企业市场竞争能力强,盈利能力稳定,主营业务利润率大于当年行业平均水平,预期主营业务收入增长率超过行业平均水平;

(iii)良好的财务状况,财务管理能力较强,现金收支安排有序,资产盈利水平较高,剔除资产负债率大于85%的公司(金融行业上市公司除外),具备潜在的良好的分红能力;

(iv)企业在产品开发、技术进步方面具有竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应。

c. 债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;另一方面考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。本基金可投资于国债、金融债和企业(公司)债(包括可转债),以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求,国债投资比例不低于基金资产的20%。

3. 嘉实债券

在有效管理风险的基础上,采取主动的自上而下的投资策略,通过对投资组合的相对价值分析,充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会;应用久期调整、凸度挖掘、息差比较等策略构建组合,实现基金的保值增值。

a. 资产配置

本基金资产配置的基本原则是:充分比较各类资产的预期风险收益状况,在满足组合流动性要求的条件下,追求尽可能高的组合收益率。本基金投资于国债及信用等级为BBB级及以上(或者有高信用等级机构或相当优质资产担保)的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券的比例不低于基金非现金资产的80%。

(i)类属配置

整个债券组合中类属债券投资中轴配置比例为:银行间国债40%,交易所国债30%,金融债20%,企业债10%。

如果流动性改善的趋势持续,将在现有的类属债券投资中轴配置比例的基础上,考虑增持金融债与企业债。增持后,两者比例合计最多可以达到50%的上限。

(ii)期限配置

投资组合中债券的剩余期限的配置是债券投资中资产配置的另一个重要方面,与期限结构配置相关的因素主要是市场利率水平的变化方向和幅度的大小,本基金将结合收益率曲线变化的预测,采取两种策略进行期限结构配置:首先是采用主动型的策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定短、中、长期三类债券的投资比例;然后与数量化方法相结合,完成投资组合中债券的期限结构配置。

(iii)浮息债券和固息债券的配置

浮息债券具有规避利率上涨风险的功能,但是浮息债券在规避利率上涨风险的同时,还要承担收益率较低的风险。因此,将从两方面确定固息债券和浮息债券的投资比例,一是利率走势的判断,如果判断利率水平上涨,本基金将增加浮息债券的投资比例。二是比较短期债券和浮息债券的当期收益状况,用浮息债券代替短期债券,提高组合的收益水平。

b. 组合构建策略与方法

在确定每类属资产配置以后,在每一类属债券内部,本产品采取一系列策略构建债券投资组合。本基金产品的组合构建策略主要包括:久期调整、凸度挖掘、波动性交易、品质互换、回购套利等。

c. 债券选择标准

本基金的选券基本标准为:在符合本基金产品资产配置策略和组合构建策略的条件下,选择能够保持策略延续性和稳定性、投资组合流动性及风险控制要求的债券。

(i)符合实施前述的资产配置策略、投资策略的要求;

(ii)保持投资策略的延续性和稳定性;

(iii)符合风险管理指标,包括VaR和流动性指标的要求;

(iv)价值严重被低估且符合投资总体理念的要求;

(v)降低积极管理风险的要求;

(vi)银行间市场询价达到三家以上;

(vii)在其他条件相同时,优先选择双边报价商报价债券列表中的债券;

(viii)优先选择央行公开市场操作的品种。

(二)投资管理程序

1、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小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下,基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金的合同规定,提出下一阶段本系列基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例,并制订基金在其他重要股票资产类别上的具体配置计划。

3、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本系列基金的总体投资策略,审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资目标,构建投资组合。

5、基金经理小组将投资指令下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

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。监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

7、基金经理小组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、在确保基金份额持有人利益的前提下,基金管理人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

嘉实增长混合:巨潮500(小盘)指数

嘉实稳健混合:巨潮200(大盘)指数

嘉实债券:中央国债登记结算公司的中国债券指数

十、基金的风险收益特征

1.嘉实增长混合:本基金属于中高风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。

2.嘉实稳健混合:本基金属于中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的β值保持在0.5至0.8之间。

3.嘉实债券:本基金属于低风险证券投资基金,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金,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。

本系列基金托管人中国银行股份有限公司根据本系列基金合同规定,于2015年1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2014年12月31日("报告期末"),本报告所列财务数据未经审计。

1.嘉实增长混合

(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 | 1,961,913,103.24 | 69.61 |
| | 其中:股票 | 1,961,913,103.24 | 69.61 |
| 2 | 固定收益投资 | 644,895,479.20 | 22.88 |
| | 其中:债券 | 644,895,479.20 | 22.88 |
| | 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 | 9,305,992.51 | 0.33 |
| 7 | 其他资产 | 202,228,887.18 | 7.18 |
| | 合计 | 2,818,343,462.13 | 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 | 743,522,303.34 | 26.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 76,593,451.20 | 2.74 |
| F | 批发和零售业 | 88,860,796.14 | 3.18 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 81,766,002.72 | 2.92 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 777,677,515.47 | 27.82 |
| J | 金融业 | 163,525,641.99 | 5.85 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,853,939.00 | 0.10 |
| 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 | 2,530,564.50 | 0.09 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 7,827,116.88 | 0.28 |
| S | 综合 | 16,755,772.00 | 0.60 |
| | 合计 | 1,961,913,103.24 | 70.17 |

(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 | 002439 | 启明星辰 | 6,086,243 | 145,096,033.12 | 5.19 |
| 2 | 002450 | 康得新 | 3,949,790 | 114,425,416.30 | 4.09 |
| 3 | 300104 | 乐视网 | 3,348,570 | 108,627,610.80 | 3.89 |
| 4 | 600570 | 恒生电子 | 1,948,685 | 106,709,990.60 | 3.82 |
| 5 | 300253 | 卫宁软件 | 1,179,450 | 82,526,116.50 | 2.95 |
| 6 | 600446 | 金证股份 | 1,733,585 | 81,270,464.80 | 2.91 |
| 7 | 002081 | 金螳螂 | 4,559,134 | 76,593,451.20 | 2.74 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 7,119,892 | 75,898,048.72 | 2.71 |
| 9 | 600525 | 长园集团 | 5,847,656 | 67,189,567.44 | 2.40 |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 4,195,600 | 65,828,964.00 | 2.35 |

(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 | 589,189,000.00 | 21.07 |
| | 其中:政策性金融债 | 589,189,000.00 | 21.07 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 55,706,479.20 | 1.99 |
| 8 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 644,895,479.20 | 23.07 |

(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 | 120215 | 12国开15 | 2,100,000 | 209,832,000.00 | 7.51 |
| 2 | 120212 | 12国开12 | 1,200,000 | 119,820,000.00 | 4.29 |
| 3 | 140437 | 14农发37 | 800,000 | 79,992,000.00 | 2.86 |
| 4 | 113005 | 平安转债 | 308,760 | 55,706,479.20 | 1.99 |
| 5 | 140213 | 14国开13 | 500,000 | 50,000,000.00 | 1.79 |

(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 | 725,534.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | 185,623,662.26 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,632,297.83 |
| 5 | 应收申购款 | 247,392.85 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 202,228,887.18 |

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 | 113005 | 平安转债 | 55,706,479.20 | 1.99 |

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 | 002439 | 启明星辰 | 145,096,033.12 | 5.19 | 重大事项停牌 |

2.嘉实稳健混合

(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 | 6,005,526,727.69 | 73.31 |
| | 其中:股票 | 6,005,526,727.69 | 73.31 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,915,745,463.40 | 23.38 |
| | 其中:债券 | 1,915,745,463.40 | 23.38 |
| | 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 | 240,992,187.59 | 2.94 |
| 7 | 其他资产 | 30,012,777.87 | 0.37 |
| | 合计 | 8,192,277,156.55 | 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 | 390,863,469.12 | 4.82 |
| C | 制造业 | 3,364,691,164.49 | 41.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 109,643,858.05 | 1.35 |
| E | 建筑业 | 114,379,411.25 | 1.41 |
| F | 批发和零售业 | 114,131,453.17 | 1.41 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 101,872,662.84 | 1.26 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 672,452,032.85 | 8.29 |
| J | 金融业 | 744,050,144.70 | 9.18 |
| K | 房地产业 | 384,792,930.42 | 4.75 |
| L | 租赁和商务服务业 | 1,967,516.88 | 0.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,682,083.92 | 0.08 |
| 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 | 6,005,526,727.69 | 74.08 |

(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 | 601633 | 长城汽车 | 14,308,685 | 594,525,861.75 | 7.33 |
| 2 | 000651 | 格力电器 | 12,954,141 | 480,857,713.92 | 5.93 |
| 3 | 600340 | 华夏幸福 | 7,137,178 | 311,180,960.80 | 3.84 |
| 4 | 600486 | 扬农化工 | 9,296,611 | 279,827,991.10 | 3.45 |
| 5 | 000060 | 中金岭南 | 28,058,706 | 266,277,119.94 | 3.28 |
| 6 | 600309 | 万华化学 | 11,476,675 | 249,961,981.50 | 3.08 |
| 7 | 600030 | 中信证券 | 4,902,433 | 166,192,478.70 | 2.05 |
| 8 | 300168 | 万达信息 | 2,982,270 | 137,780,874.00 | 1.70 |
| 9 | 600050 | 中国联通 | 25,320,098 | 125,334,485.10 | 1.55 |
| 10 | 600010 | 包钢股份 | 30,000,000 | 122,400,000.00 | 1.51 |

(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 | 854,550,000.00 | 10.54 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 810,814,000.00 | 10.00 |
| | 其中:政策性金融债 | 810,814,000.00 | 10.00 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | 250,381,463.40 | 3.09 |
| 8 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 1,915,745,463.40 | 23.63 |

(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 | 120004 | 12附息国债04 | 3,000,000 | 298,140,000.00 | 3.68 |
| 2 | 110024 | 11附息国债24 | 2,600,000 | 259,480,000.00 | 3.20 |
| 3 | 113005 | 平安转债 | 1,387,770 | 250,381,463.40 | 3.09 |
| 4 | 120009 | 12附息国债09 | 2,500,000 | 245,950,000.00 | 3.03 |
| 5 | 140213 | 14国开13 | 1,400,000 | 140,000,000.00 | 1.73 |

(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 | 1,493,537.93 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 27,986,166.02 |
| 5 | 应收申购款 | 533,073.92 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 30,012,777.87 |

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 | 113005 | 平安转债 | 250,381,463.40 | 3.09 |

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 | 300168 | 万达信息 | 137,780,874.00 | 1.70 | 重大事项停牌 |

3.嘉实债券

(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 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 固定收益投资 | 748,224,954.98 | 93.49 |
| | 其中:债券 | 748,224,954.98 | 93.49 |
| | 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 | 36,772,072.46 | 4.59 |
| 7 | 其他资产 | 15,324,826.80 | 1.91 |
| | 合计 | 800,321,854.24 | 100.00 |

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合报告期末,本基金未持有股票。

(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

报告期末,本基金未持有股票。

(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 | 95,121,274.30 | 17.31 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 38,627,168.00 | 7.03 |
| | 其中:政策性金融债 | 38,627,168.00 | 7.03 |
| 4 | 企业债券 | 240,184,929.68 | 43.70 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,037,000.00 | 5.47 |
| 6 | 中期票据 | 333,386,000.00 | 60.66 |
| 7 | 可转债 | 10,868,583.00 | 1.98 |
| 8 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 748,224,954.98 | 136.15 |

(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 | 010213 | 02国债(13) | 850,370 | 82,817,534.30 | 15.07 |
| 2 | 101459023 | 14人福MTN001 | 500,000 | 50,500,000.00 | 9.19 |
| 3 | 122157 | 12广控01 | 334,160 | 33,416,000.00 | 6.08 |
| 4 | 101473010 | 14港中旅MTN002 | 300,000 | 30,984,000.00 | 5.64 |
| 5 | 101469018 | 14京汽MTN001 | 300,000 | 30,972,000.00 | 5.64 |

(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 | 51,438.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 15,095,387.78 |
| 5 | 应收申购款 | 178,000.57 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 15,324,826.80 |

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 | 125089 | 深机转债 | 2,532,340.00 | 0.46 |

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,本基金未持有股票。

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系列基金的招募说明书。

(一)嘉实增长混合

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2003年7月9日至2003年12月31日 | 6.49% | 0.41% | -17.35% | 1.16% | 23.84% | -0.75% |
| 2004年度 | 15.56% | 0.89% | -15.41% | 1.52% | 30.97% | -0.63% |
| 2005年度 | 8.85% | 0.93% | -13.29% | 1.67% | 22.14% | -0.74% |
| 2006年度 | 114.77% | 1.16% | 92.66% | 1.59% | 22.11% | -0.43% |
| 2007年度 | 107.39% | 1.60% | 197.05% | 2.59% | -89.66% | -0.99% |
| 2008年度 | -39.36% | 1.76% | -58.35% | 1.92% | 18.99% | -0.16% |
| 2009年度 | 60.33% | 1.37% | 134.03% | 2.28% | -73.70% | -0.91% |
| 2010年度 | 24.87% | 1.20% | 11.30% | 1.80% | 13.57% | -0.60% |
| 2011年度 | -18.72% | 0.95% | -32.34% | 1.55% | 13.62% | -0.60% |
| 2012年度 | 5.55% | 0.95% | 0.39% | 1.59% | 5.16% | -0.64% |
| 2013年度 | 14.12% | 1.12% | 18.38% | 1.46% | -4.26% | -0.34% |
| 2014年度 | 14.88% | 1.00% | 41.15% | 1.27% | -26.27% | -0.27% |

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

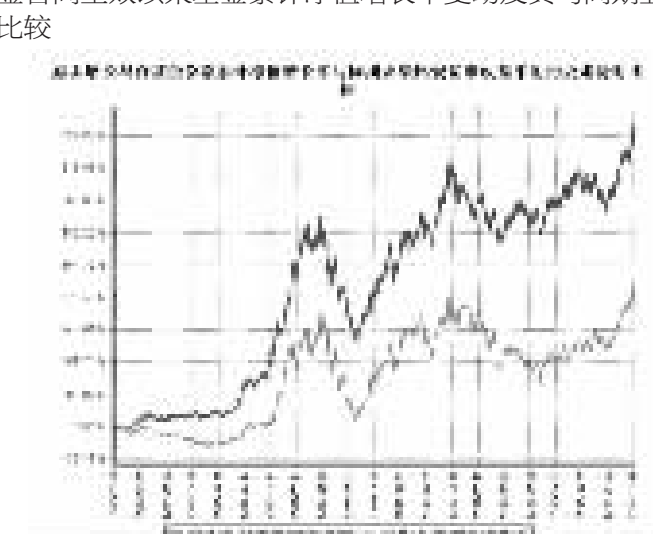


图:嘉实增长混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年7月9日至2014年12月31日)

注:按基金合同规定,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各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

(二)嘉实稳健混合

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2003年7月9日至2003年12月31日 | 6.29% | 0.55% | -3.73% | 0.94% | 10.02% | -0.39% |
| 2004年度 | 2.23% | 0.91% | -15.97% | 1.28% | 18.20% | -0.37% |
| 2005年度 | 2.96% | 0.87% | -7.37% | 1.31% | 10.33% | -0.44% |
| 2006年度 | 101.90% | 1.10% | 122.43% | 1.38% | -20.53% | -0.28% |
| 2007年度 | 123.76% | 1.73% | 156.00% | 2.26% | -32.24% | -0.53% |
| 2008年度 | -51.26% | 1.93% | -64.24% | 3.01% | 12.98% | -1.08% |
| 2009年度 | 42.07% | 1.24% | 95.84% | 2.03% | -53.77% | -0.79% |
| 2010年度 | -5.54% | 0.94% | -13.35% | 1.56% | 7.81% | -0.62% |
| 2011年度 | -17.63% | 0.89% | -21.72% | 1.27% | 4.09% | -0.38% |
| 2012年度 | 0.68% | 0.90% | 11.27% | 1.24% | -10.59% | -0.34% |
| 2013年度 | 13.74% | 1.05% | -7.65% | 1.42% | 21.39% | -0.37% |
| 2014年度 | 12.34% | 0.98% | 52.42% | 1.24% | -40.08% | -0.26% |

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较

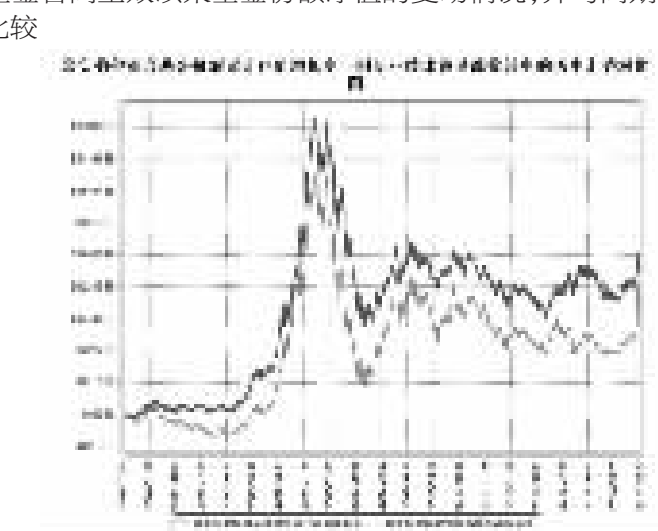


图:嘉实稳健混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003年7月9日至2014年12月31日)

注1:按基金合同规定,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三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

注2:2014年11月26日,本基金管理人发布《关于新增嘉实稳健混合基金经理的公告》,聘请郭东谋先生担任本基金基金经理职务,与基金经理许少波先生共同管理本基金。

(三)嘉实债券

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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2003年7月9日至2003年12月31日 | 0.70% | 0.15% | -1.24% | 0.31% | 1.94% | -0.16% |
| 2004年度 | -7.45% | 0.27% | -2.42% | 0.35% | -5.03% | -0.08% |
| 2005年度 | 13.14% | 0.19% | 10.55% | 0.18% | 2.59% | 0.01% |
| 2006年度 | 27.17% | 0.55% | 2.62% | 0.09% | 24.55% | 0.46% |
| 2007年度 | 30.28% | 0.41% | -1.80% | 0.08% | 32.08% | 0.33% |
| 2008年度 | 0.41% | 0.31% | 14.89% | 0.21% | -14.48% | 0.10% |
| 2009年度 | 4.03% | 0.38% | -1.24% | 0.10% | 5.27% | 0.28% |
| 2010年度 | 7.05% | 0.21% | 1.92% | 0.10% | 5.13% | 0.11% |
| 2011年度 | -0.44% | 0.18% | 5.72% | 0.11% | -6.16% | 0.07% |
| 2012年度 | 6.06% | 0.10% | 2.51% | 0.07% | 3.55% | 0.03% |
| 2013年度 | 0.47% | 0.10% | -2.10% | 0.11% | 2.57% | -0.01% |
| 2014年度 | 9.68% | 0.13% | 11.23% | 0.15% | -1.55% | -0.02% |

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动进行比较



图:嘉实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

(2003年7月9日至2014年12月31日)

注:按基金合同规定,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三部分(四、(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(3)投资于国债及信用等级为BBB级及以上(或者有高信用等级机构或相当优质资产担保)的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券的比例不低于基金非现金资产的80%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级;(4)本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月;(5)新股投资比例不超过基金资产总值的20%。

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

①以下条款适用于嘉实增长混合和嘉实稳健混合

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金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为前一日基金资产净值

②以下条款适用于嘉实债券

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.6%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的0.6%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.6%÷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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的基金托管费

①以下条款适用于嘉实增长混合和嘉实稳健混合

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。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

②以下条款适用于嘉实债券

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.2%÷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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3)与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金成立后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金成立后与基金相关的会计师费和律师费。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。

(4)上述系列基金/基金费用由基金管理人按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

上述基金费用由相应的基金独立承担,本系列基金费用按各基金份额与各基金份额总和之比分摊。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

1.本系列基金/基金的申购费按申购金额采用比例费率,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。费率表如下:

| 申购金额(含申购费) | 申购费率 | |
|---|---|---|
| | 嘉实增长混合/嘉实稳健混合 | 嘉实债券 |
| 100万元以下 | 1.5% | 0.8% |
| 100万元(含)—500万元 | 1.2% | 0.6% |
| 500万元(含)以上 | 每笔1000元 | 每笔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。。

2.赎回费根据持有时间实行递减收费。费率表如下:

| 持有期限 | 赎回费率 | |
|---|---|---|
| | 嘉实增长混合/嘉实稳健混合 | 嘉实债券 |
| 1年之内 | 0.5% | 0.3% |
| 1年(含)-2年 | 0.25% | 0.15% |
| 2年(含)以上 | 0 | 0 |

基金的赎回费用由赎回人承担,在扣除必要的手续费后,赎回费余额不得低于赎回费总额的25%,并归入基金财产。

(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转换为嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券时,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。

2)嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券转换为嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券时,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。

3)嘉实增长混合、嘉实稳健混合与嘉实成长收益混合、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、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票之间互转,以及嘉实成长收益混合、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、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票转入嘉实债券、嘉实丰益纯债定期债券,以及嘉实丰益纯债定期债券与嘉实债券之间互转时,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。

4)嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接转入嘉实债券时,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。

5)嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券转入嘉实增长混合、嘉实稳健混合时,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。

6)嘉实债券与嘉实多元债券A、嘉实信用债券A、嘉实纯债债券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、嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券C、嘉实纯债债券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。

7)嘉实债券转入嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实泰和混合时,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。

8)嘉实债券转入嘉实成长收益混合、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、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票时,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

(1)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B转换为嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券时,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。

2)嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券转换为嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券时采用"赎回费+申购费率":

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。

3)嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实稳健混合、与嘉实成长收益混合、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、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票之间互转,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。

其中赎回费的25%归入转出基金资产(嘉实稳固收益债券基金和嘉实纯债债券C除外);根据嘉实稳固收益债券基金合同的约定,该基金的赎回费全部归入该基金资产(注:在运作期和间歇期,该基金按不同的方式收取赎回费);根据嘉实纯债债券型发起式证券投资基金基金合同的约定,对于持有期限少于30日的C类基金份额所收取的赎回费全额计入基金财产。

注1:嘉实增长混合与嘉实策略混合之间尚未开办基金转换业务。

注2: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11月13日起,嘉实纯债债券单日单个基金账户累计申购(含转入及定投)金额不得超过100万元;2015年2月10日起,嘉实研究精选股票暂停申购(含转入)业务;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。

(4)销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费,用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

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可磋商酌情调低部分或全部基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告;此项调整无须召开基金份额持有人大会。

(四)基金的税收

本系列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2003年5月29日刊登的本系列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:新增同花顺、华安证券、宏信证券、展恒基金、深圳腾元、锦州银行、宜信普泽七家代销机构,并更新了相关直销机构、代销机构信息。

5.在"八、基金份额的申购与赎回"部分:更新了基金申购费率优惠的内容。

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:基金业绩更新到2014年12月31日。

9.在"二十四、其他应披露事项"部分:增加了2014年7月9日至2015年1月9日本系列基金/基金的相关临时公告事项列表。

嘉实基金管理有限公司

2015年2月17日