

(上接B103版)

住所 北京朝阳区广外大街1号国际大厦22层及28层
办公地址 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层
注册地址 北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层
法定代表人 丁学东 联系人 魏晓宇
电话 010-65051166 传真 010-65057623
网址 http://www.cpic.com.cn 客服电话 400 910 1166

(60)联讯证券股份有限公司
住所 广东省深圳市福田区江北东三路66号广电新闻中心西面一层大
厦第三、四层
办公地址 广东省深圳市福田区江北东三路66号广电新闻中心西面一层大
厦第三、四层
注册地址 广东省深圳市福田区江北东三路66号广电新闻中心西面一层大
厦第三、四层
法定代表人 徐刚 联系人 蔡文 彭彦
电话 0755-83331166 传真 0755-83331166
网址 http://www.lxsec.com 客服电话 86564

(81)宏信证券有限责任公司
办公地址 成都市人民南路一段18号川信大厦10楼
注册地址 成都市锦江区人民南路二段十八号川信大厦10楼
法定代表人 吴玉刚 联系人 魏海
电话 028-86190278 传真 028-86190982
网址 http://www.hx18.com 客服电话 4008936636

(82)中信期货有限公司
办公地址 深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北楼13层1303-1305
室、14层
注册地址 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北楼13层1303-1305
室、14层
法定代表人 张皓 联系人 胡震
电话 010-60833764 传真 0755-83217421
网址 http://www.citicsf.com 客服电话 400-990-8826

(83)东海期货有限责任公司
办公地址 江苏省常州市延陵西路23、26、27、29号,上海市浦东新区东陆路1128号
马陆商务大厦2楼
注册地址 江苏省常州市延陵西路23、26、27、29号
法定代表人 陈杰 联系人 李天宇
电话 021-68771042 传真 021-68757102
网址 http://www.qh168.com.cn 客服电话 86631400888888

(84)长江证券股份有限公司
住所 湖北省武汉市新华路88号长江证券大厦
办公地址 湖北省武汉市江汉区新华路88号
注册地址 湖北省武汉市江汉区新华路88号
法定代表人 尤洪强 联系人 李晨
电话 027-16679999 传真 027-16681000
网址 http://www.cjsc.com 客服电话 4008-888-889

(85)万联证券股份有限公司
住所 广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼
办公地址 广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼
注册地址 广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F座18、19楼
法定代表人 张建军 联系人 尹剑斌
电话 020-122976020 传真 020-22277110-1013
网址 http://www.wljsc.com.cn 客服电话 4008881133

(86)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 天津市南开区水上西道80号
注册地址 天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室
法定代表人 王春峰 联系人 王树强
电话 022-88461961 传真 022-88461862
网址 http://www.bhsc.com.cn 客服电话 4006515888

(87)山西证券股份有限公司
住所 太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址 太原市府西街69号山西国际贸易中心西塔楼21层
注册地址 山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人 侯晓 联系人 刘
电话 0351-2686969 传真 0351-2686916
网址 http://www.sxjz.com 客服电话 400-666-1618

(88)东吴证券股份有限公司
住所 苏州工业园区星阳街2号
办公地址 苏州工业园区星阳街2号
注册地址 苏州工业园区星阳街2号
法定代表人 范力 联系人 方晓丹
电话 0512-62669136 传真 0512-62669821
网址 http://www.dwzq.com.cn 客服电话 96330

(89)信达证券股份有限公司
住所 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址 北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
注册地址 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 http://www.cindasc.com 客服电话 96321

(90)上海证券有限责任公司
住所 上海市四川中路213号久事商务大厦7楼
办公地址 上海市西藏中路330号国际大厦9楼
注册地址 上海市西藏中路213号
法定代表人 李俊杰 联系人 廖静珍
电话 021-63098888 传真 021-63096100-7008
网址 http://www.shzq.com 客服电话 4008918818

(91)新时代证券股份有限公司
住所 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
办公地址 北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501
注册地址 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 尹继华 联系人 尹继华
电话 010-62569146 传真 010-62569146
网址 http://www.xndzq.cn 客服电话 96390

(92)大同证券有限责任公司
住所 山西省大同市迎宾街15号恒安国际大厦21层
办公地址 山西省大同市迎宾街15号恒安国际大厦21层
注册地址 山西省大同市迎宾街15号恒安国际大厦21层
法定代表人 薛峰 联系人 薛峰
电话 0351-4133322 传真 0351-4133322
网址 http://dtbbs.com.cn 客服电话 4007121212

(93)国联证券股份有限公司
住所 江苏省无锡市金融一街9号
办公地址 江苏省无锡市金融一街9号
注册地址 江苏省无锡市金融一街9号
法定代表人 姚志勇 联系人 孙昊
电话 0610-82531662 传真 0610-82530162
网址 http://www.guolian.com 客服电话 96570

(94)平安证券股份有限公司
住所 深圳市福田区中心区金田路4030号平安大厦16-20层
办公地址 深圳市福田区益田路4033号平安金融中心16-19层
注册地址 深圳市福田区益田路4033号平安金融中心16-19层
法定代表人 何江江 联系人 魏一博
电话 021-58674336 传真 021-58991896
网址 http://www.pingan.com.cn 客服电话 96611-8

(95)国海证券股份有限公司
住所 广西桂林市临江路3号
办公地址 广西壮族自治区南宁市滨湖路46号国海大厦
注册地址 广西壮族自治区桂林市临江路3号
法定代表人 符学峰 联系人 李宇平
电话 0755-83967889 传真 0755-83963003
网址 http://www.guohai.com.cn 客服电话 966631-50300

(96)东莞证券股份有限公司
住所 广东省东莞市可园南路1号金源中心304室
办公地址 广东省东莞市莞城区可园南路1号
注册地址 广东省东莞市莞城区可园南路1号
法定代表人 梁国勇 联系人 李荣
电话 0769-22115712 传真 0769-22115712
网址 http://www.dgzq.com.cn 客服电话 96328

(97)中原证券股份有限公司
住所 郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址 河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
注册地址 河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人 程广军 联系人 程月梅、李海岭
电话 0371-48909822 传真 0371-48968899
网址 http://www.zysec.com 客服电话 96377

(98)国都证券股份有限公司
住所 北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
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
注册地址 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 李全 联系人 魏静
电话 010-84183289 传真 010-84183211
网址 http://www.guodu.com 客服电话 400-818-8118

(99)东海证券有限责任公司
住所 江苏省常州市延陵西路23号投资广场10楼
办公地址 江苏省常州市延陵西路23号投资广场10楼
注册地址 江苏省常州市延陵西路23号投资广场10楼
法定代表人 赵强 联系人 王正
电话 021-10333333 传真 021-60468825
网址 http://www.dhsec.com 客服电话 400-888-8888

(100)国盛证券有限责任公司
住所 江西省南昌市北京东路88号
办公地址 江西省南昌市北京东路88号江信国际金融大厦
注册地址 江西省南昌市北京东路88号江信国际金融大厦
法定代表人 徐晓勇 联系人 魏静
电话 0791-83981306 传真 0791-190931306
网址 http://www.guosen.com 客服电话 4008222111

(101)金元证券股份有限公司
住所 海南省海口市南沙路36号证券大厦4层
办公地址 海南省海口市南沙路36号证券大厦4层
注册地址 海南省海口市南沙路3号证券大厦4楼
法定代表人 李文 联系人 马涛
电话 0756-66661022 传真 0756-66662626
网址 http://www.jysec.com 客服电话 400-8888-238

(102)华龙证券股份有限公司
办公地址 甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
注册地址 甘肃省兰州市东岗西路638号兰州财富中心21楼
法定代表人 李耀安 联系人 范彤
电话 0931-4890200 传真 0931-4890289
网址 http://www.hlzq.com 客服电话 96368

(103)上海华信证券有限责任公司

办公地址 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心L9层
注册地址 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心L9层
法定代表人 魏刚 联系人 魏刚
电话 021-387948187 传真 021-68778878
网址 http://www.hwhzsc.com/ 客服电话 68877877

(104)瑞银证券有限责任公司
住所 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层
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、15层
注册地址 北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12、15层
法定代表人 钱宇军 联系人 魏静
电话 010-186281212 传真 010-1938329748
网址 http://www.ubssecurities.com 客服电话 400-887-8827

(105)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
注册地址 深圳市福田区科田路一浩华证券高新研发大厦7楼
法定代表人 黄志刚 联系人 罗宇峰
电话 0755-82570986 传真 0755-82006682
网址 http://www.zszq.com 客服电话 96320

(106)国融证券股份有限公司
住所 呼和浩特市新城区海拉尔路18号
办公地址 呼和浩特市新城区海拉尔路18号
注册地址 呼和浩特市新城区海拉尔路18号
法定代表人 张智勇 联系人 魏静
电话 010-63919127 传真 010-60941267
网址 http://www.guor.com 客服电话 4000600639

(107)江海证券有限公司
办公地址 哈尔滨市松北区创新一路2333号
注册地址 哈尔滨市松北区创新一路6号
法定代表人 孙洪波 联系人 魏静
电话 0451-85863726 传真 0451-82327929
网址 http://www.jhsc.com.cn 客服电话 400-666-2288

(108)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96号
注册地址 四川省成都市青羊区东城根上街96号
法定代表人 冉云 联系人 魏静
电话 028-86609077 传真 028-86609126
网址 http://www.guojin.com 客服电话 96310

(109)华宝证券有限责任公司
住所 上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心L67层
办公地址 上海市浦东新区世纪大道100号7层
注册地址 上海市浦东新区世纪大道100号7层
法定代表人 魏刚 联系人 魏刚
电话 021-16877222 传真 021-16877222
网址 http://www.hwbz.com.cn 客服电话 4008209888

(110)长城国瑞证券有限公司
住所 厦门自贸片区二期会展路171号七楼
办公地址 厦门自贸片区二期会展路171号七楼
注册地址 厦门自贸片区二期会展路171号七楼
法定代表人 王勇 联系人 魏静
电话 0592-62792629 传真 0592-62799002
网址 http://www.gwazq.com.cn 客服电话 400-0099-896

(111)爱建证券有限责任公司
住所 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼(陆家嘴商务广场)
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)
注册地址 上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人 倪捷 联系人 魏静
电话 021-13225888 传真 021-68726762
网址 http://www.ajsc.com 客服电话 021-63340676

(112)华融证券股份有限公司
住所 北京市西城区金融大街9号
办公地址 北京朝内北大街18号中国人寿大厦1层
注册地址 北京市西城区金融大街9号
法定代表人 魏刚 联系人 李慧灵
电话 010-86561100 传真 010-86560388
网址 http://www.hfsc.com.cn 客服电话 400-888-4999

(113)天风证券股份有限公司
办公地址 湖北省武汉中南路99号保利广场A座17楼
注册地址 湖北省武汉市中南路99号保利广场A座17楼
法定代表人 余文斌 联系人 魏静
电话 027-87617077 传真 027-87618863
网址 http://www.tfzq.com 客服电话 4000600600

(114)深圳市新华德证券投资咨询有限公司
住所 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
办公地址 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
注册地址 深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006
法定代表人 李勇 联系人 文雯
电话 010-83363101 传真 010-83363072
网址 http://www.xhd.com.cn 客服电话 400-119-1166

(115)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西溪路55号
注册地址 浙江省杭州市西湖区西溪路55号
法定代表人 胡晓明 联系人 魏静
电话 021-60897940 传真 0671-26897013
网址 http://www.fund123.com 客服电话 4000-706-123

(116)北京汇成基金销售有限公司
办公地址 北京市西城区宣武门外大街1号11层1108室
注册地址 北京市西城区宣武门外大街1号11层1108室
法定代表人 王树刚 联系人 于勇
电话 010-16629140 传真 010-62008272
网址 http://www.hcfn.com 客服电话 400-619-0099

(117)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96号理想国际大厦900室
注册地址 北京市海淀区北四环西路96号理想国际大厦900室
联系人 付文红 电话 010-62768682
网址 http://www.xindacn.com 客服电话 010-62765369

(118)上海万得基金销售有限公司
办公地址 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
注册地址 中国(上海)自由贸易试验区福山路33号11楼B座
法定代表人 王廷富 联系人 姜吉灵
电话 021-68922990 传真 021-48892811
网址 http://www.wand.com.cn 客服电话 400-821-0203

(119)凤凰信(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央商务区万寿路142号14层1402号办公
注册地址 宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402号办公
法定代表人 程刚 联系人 程刚
电话 010-58160168 传真 010-58160173
网址 http://www.fenghuangx.com 客服电话 400-810-5519

(120)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南路东宇北路26号融业中心B602-0602房间
注册地址 郑州市郑东新区东风南路东宇北路26号融业中心B602-0602房间
法定代表人 李洪军 联系人 魏静
电话 0371-85381826 传真 4000-565-071
网址 310300PC00 客服电话 0371-85618397

(121)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99号1号楼22层2203-06
注册地址 北京市海淀区中关村东路99号1号楼22层2203-06
法定代表人 李志刚 联系人 王洁
电话 4000888111 传真 010-89108000
网址 http://fund.jd.com 客服电话 010-89189462

(122)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9号楼22层220207
注册地址 北京市朝阳区阜通东大街1号院9号楼22层220207
法定代表人 梁娟娟 联系人 魏静
电话 010-61940688 传真 010-61940689
网址 http://www.danjuan.com 客服电话 4000-618-518

(二) 登记机构
名称 国信证券股份有限公司
住所 中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号上海国信中心二期3010室-11F
办公地址 北京市西城区门大街甲9号华国国际大厦
法定代表人 邵宇军 联系人 魏静
电话 010-186215688 传真 010-186215678

(三) 律师事务所和经办律师
名称 国浩律师(北京)事务所
住所、办公地址 北京市西城区车公庄三环路9号国浩金融大厦9层
负责人 王卫东 联系人 王磊
电话 010-68090680 传真 010-65176800/0381
经办律师 魏伟 王磊

(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 上海市黄浦区四川路202号瑞泰广场二座普华永道中心11楼
法定代表人 李丹 联系人 魏静
电话 021-12328888 传真 021-12328890
经办注册会计师 薛斐、张勇

四、基金名称
本基金名称:嘉实丰益纯债定期开放债券型证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型:契约型,以定期开放方式运作。
六、基金的投资目标
本基金在审慎的投资管理和风险控制下,力争当期总回报最大化,以谋求长期保值增值。

七、基金的投资范围
本基金投资于国内依法发行或上市的可转债、货币市场工具,以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:国债、央

行票据、金融债券、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、地方政府债、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金,法律法规和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相关规定)。
本基金不直接参与二级市场买入股票、权证、可转债等,也不参与一级市场申购,可转换申购或增发新股。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
基金的投资组合比例为:除每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月以外的期间,本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%,开放期内,本基金持有现金或到期日在1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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。
八、基金的投资策略
本基金在控制基金组合风险的基础上,追求实现良好收益的目标。
1、资产配置策略
在资产配置方面,本基金通过密切关注经济运行趋势,深入分析财政及货币政策对经济运行的影响,结合各大类资产的预期收益率、流动性及波动性等方面因素,做出最佳的资产配置,并定期对投资组合类属资产进行优化配置和调整。在规避基金组合风险的同时进一步增强基金组合收益。

2、利率策略
本基金将通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,积极主动的预测未来的利率趋势。组合久期及反映利率风险最重要的指标,本基金管理人将根据相关因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,以较多地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的久期,以减小债券价格下降带来的风险。

3、信用债券投资策略
本基金通过承担适度的信用风险来获取信用溢价,主要关注个别债券的选择和行业配置两方面。在定性定量分析结合的基础上,通过自下而上的策略,在信用类固定收益金融工具中进行个债的精选,结合适度分散的行业配置策略,构建和优化组合。
通过采用“嘉实信用分析系统”的信用评级和信用分析,包括宏观信用环境分析、行业趋势分析、管理层素质与公司治理分析、运营与财务状况分析、债务契约分析、特殊事项风险分析等,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。

(1) 个别债券选择
首先,本基金依据“嘉实信用分析系统”的研究成果,执行“嘉实投资备选流程”,生成或更新买入信用债券备选库,强化投资组合,保护组合质量。
其次,本基金主要以信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类别、信用评级、收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)、剩余额度、久期、凸性、流动性(发行总量、流通量、上市时间)等指标,结合组合管理层面的要求,决定是否将个债纳入组合及其投资数量。

再有,因信用改善而支持本基金投资的个债信用指标可以包括但不限于:更稳定或增强的现金流、更强的自由现金流增长或更好的财务能力、资产价值更利于支持债券、通过大的资产重组或更稳健更高的市场占有率、更易于获得资金等;个债因信用恶化而支持本基金卖出的指标可以包括但不限于:发债企业出现低于分析师预期的情况、发债企业没有去杠杆的财务能力、发债企业覆盖债务的资产减少、发债企业市场竞争地位恶化、发债企业获得资金的途径减少、发债企业发生管理层的重大变化、个债已到达本基金对其设定的目标价格,本基金对该个债评估的价格上行空间有限等。

(2) 行业配置
宏观信用环境变化、影响一发债人的违约概率,影响不同发债人之间的违约相关性,影响既定信用等级发债人在信用周期不同阶段的违约损失率,影响不同信用等级发债人的违约概率。同时,不同行业对宏观经济的相关性差异显著,不同行业的潜在违约率差异显著。本基金借助“嘉实信用分析系统”及嘉实中央研究平台,基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面的研究,运用定性定量模型,在自下而上的个债精选策略基础上,采取适度分散的行业配置策略,从组合层面动态优化投资组合。

(3) 信用风险控制措施
本基金实施谨慎的信用评估和市场分析、个债和行业层面的分散化投资策略,当发债企业的基本面情况出现恶化时,运用“尽早出售(first sale, best sale)”策略,控制投资风险。
本基金使用各信用级别持仓量、行业分散度、组合持仓分布、各项重要偿债指标范围等描述性统计指标,还运用VaR、Credit Metrics、Credit Portfolio Views等模型,估计组合在给定置信水平和事件期限内可能遭受的最大损失,以便有效评估和控制组合信用风险暴露。

4、期限结构配置策略
本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,在给定组合久期以及其他组合约束条件的情况下,通过嘉实债券组合优化数量模型,确定最佳的期限结构。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。

5、骑乘策略
本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭时,也即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将缩短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,对应的将是债券价格的走高,而这一期间债券的涨幅将会高于其他期间,这样就可以获得丰厚的价差收益即资本利得收入。

6、息差策略
本基金利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。
7、资产支持证券投资策略
本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,对个券进行风险和价值评估后选择风险调整后收益较高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

8、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市场的判断决定基金的投资策略,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) 相关部门或岗位根据嘉实中央研究平台、嘉实信用分析系统等流程规定,进行分析判断,提出分析报告。
3) 基金经理根据投资决策委员会的决议,参考相关部门提出的报告,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) 监察稽核部负责监督基金的投资管理是否合法、法规及基金合同和公司相关管理制度的规定,风险管理部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、基金业绩比较基准
本基金的业绩比较基准=一年期银行定期存款税后收益率+0.5%
上述“一年期银行定期存款收益率”是指当期封闭期的前1个工作日中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威、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,而无需召开基金份额持有人大会。
十、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基金、混合基金,高于货币市场基金。
十一、基金销售有关信息
基金管理人的董事会及基金管理人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2018年10月23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

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金资产净值的比例(%)

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。
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权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。
6. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末,本基金未参与股指期货交易。
7. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末,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

Table with 4 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值(元), 占基金资产净值的比例(%)

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
报告期末,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
报告期末,本基金未参与国债期货交易。

十二、基金业绩
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

Table with 5 columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

(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
嘉实丰益纯债定期债券基金自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:嘉实丰益纯债定期债券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
(2013年5月21日至2018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“第十二部分(二)投资范围和(四)投资限制”的有关规定。
十三、基金的费用与税收
(一) 与基金运作有关费用
1、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) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
(4) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费;
(5) 基金份额持有人大会费用;
(6) 基金的证券交易费用;
(7) 基金的其他费用;
(8) 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。
2、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0.4%年费率计提。管理费的计算方法如下:
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,经基金管理人授权基金托管人核一致后,由基金托管人于次月首日起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、公休日等,支付日期顺延。
(2) 基金托管人的托管费
本基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.1%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经基金管理人授权基金托管人核一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
(三) 与基金销售有关费用
1、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单笔申购,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、登记等各项费用,不列入基金财产。
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化的申购费率。
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、企业年金养老客户等。如将来出现经养老金监管部门认可的新的养老金类型,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。非养老金客户申购本基金时,基金管理人可按照申购费率见下表:

Table with 2 columns: 申购金额(含申购费), 申购费率

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) M<50万元 申购费率 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 按成交额,1000元/笔

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9月13日,本基金管理人发布了《嘉实基金管理有限公司关于增加开通后端收费基金产品的公告》,自2013年9月17日起,开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式(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、赎回费率
本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,对于所收取的基金份额赎回费,基金管理人将其总额的100%计入基金财产。
本基金基金份额的赎回费率如下:

Table with 2 columns: 持有期限(日), 赎回费率

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同约定范围内调整申购费率和赎回费率,费率如发生变更,基金管理人应在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。
4、基金管理人可以在不违反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,针对以特定交易方式(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必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率。
3、转换费
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) 转出基金赎回费用按照基金赎回费率(“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”)的模式)
转出基金有赎回费用的,收取该基金的赎回费用。从申购费用基金向非申购费用基金转换时,每次按照非申购费用基金申购费用收取申购补差费;非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)
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-转出基金赎回费用-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,收取的赎回费用计入基金财产的比例不得高于转出基金的基金合同及招募说明书的相关约定。
基金转换费率为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:嘉实新兴产业股票、嘉实快线货币A、嘉实逆向策略股票、嘉实新兴趋势投资、嘉实货币A、嘉实超短债债券、嘉实多元债券A、嘉实多元债券B、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实货币B、嘉实中证中期企业债指数(LOP A)、嘉实中证