（上接D6版）

②嘉实多利进取份额的折算方法

本基金出计算 嘉实多利进取份额到点折算比例”，再计算 到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额数”，将到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

[illegible]

嘉实多利进取份额到点折算比例”的计算结果，保留到小数点后 4 位。到点折算日折算后嘉实多利进取份额的份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

③嘉实多利优先份额的折算方法

本基金依次计算 嘉实多利优先份额到点折算比例”、 到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数”、 嘉实多利优先份额到点折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”，再将到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额净值调整为 1.0000 元，计算公式如下：

[illegible]

嘉实多利优先份额到点折算比例”的计算结果，保留到小数点后 4 位。到点折算日折算后嘉实多利优先份额的份额数”、及 嘉实多利优先份额到点折算为新增嘉实多利基金份额的场内份额数”的计算结果中，不足 1 份的零碎份，按各个零碎份从大到小的排序，依次向相应的基金份额持有人记增 1 份，直到所有零碎份的合计份额分配完毕。

3、到点折算后嘉实多利基金份额的总份额数

[illegible]

(在 基金份额到期折算和到点折算期间的基金业务办理

为保证基金份额到期折算和到点折算期间本基金的平稳运作，基金管理人可根据深圳证券交易所、注册登记机构的相关业务规定，暂停嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市交易和嘉实多利基金份额的申购或赎回等业务，具体见届时基金管理人公告。

(六) 基金份额到期折算和到点折算的公告

1、在到期折算日前三十个工作日 (基金合同生效日后不满三十个工作日的情形除外)，遵循深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将就暂停嘉实多利基金份额申购赎回、暂停嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易等相关业务、及基金份额到期折算等有关事项，进行提示性公告。

2、如果嘉实多利进取份额的份额净值在某一开放日高于 0.4500 元，但在下一开放日不高于 0.4500 元的；基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行提示性公告。

3、如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。基金管理人将就实施基金份额到点折算的有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行公告。

4、基金份额到期折算 (或到点折算)结束后，或因极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净大于或等于 1.0000 元，本基金未实施到点折算，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并按中国证监会备案。

(七) 风险提示

基金管理人不承诺也不保证嘉实多利优先份额的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实多利优先份额的基金份额持有人也可能损失本金。

第十九部分 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的终止运作

(一) 基金份额持有人大会决议通过，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额可以终止运作。

该基金份额持有人大会决议须经本基金所有份额以特别决议的形式表决通过，即须经参加基金份额持有人大会的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额各自的基金份额持有人或其代理人所持表决权的 2/3 以上 (含 2/3)通过方为有效。

(二) 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后的份额拆算

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后，除非基金份额持有人大会决议另有规定的，嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额将全部折算成场内嘉实多利基金份额。

1、份额折算基准日

份额折算基准日为分级份额终止运作日，即嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作日 (如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日)。

2、份额折算方式

分级份额终止运作日，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额按届时各自份额净值与嘉实多利基金份额净值之比折算为嘉实多利基金份额。

3、份额折算计算公式：

嘉实多利优先份额折算的嘉实多利基金份额数= 折算前嘉实多利优先份额数×NAVA ÷ NAV1

嘉实多利进取份额折算的嘉实多利基金份额数= 折算前嘉实多利进取份额数×NAVB ÷ NAV1

折算前嘉实多利优先份额数；指分级份额终止运作日开市后嘉实多利优先份额数

折算前嘉实多利进取份额数；指分级份额终止运作日开市后嘉实多利进取份额数

NAV1：终止运作日嘉实多利基金份额的份额净值

NAVA：终止运作日嘉实多利优先份额的份额净值

NAVB：终止运作日嘉实多利进取份额的份额净值

嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额折算成的嘉实多利基金份额数，场内份额数保留至整数位 (最小单位为 1 份)，余额计入基金资产。

4、份额折算后的基金运作

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额全部折算为场内嘉实多利基金份额后， 本基金转型为嘉实多利债券型证券投资基金 (LOF)，接受场外与场内申购和赎回。

5、份额折算的公告

基金管理人应不迟于嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作日前 2 日，就分级份额终止运作及份额折算事宜，在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告。嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额进行份额折算结束后，基金管理人应在 2 日内在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

第二十部分 基金的费用与税收

(一) 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、基金财产拨划支付的银行费用；

4、基金合同生效后的基金信息披露费用；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

7、基金的证券交易费用；

8、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(二) 上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

(三) 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

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的 0.7%年费率计提，计算方法如下：

H=E×0.7%÷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、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按基金资产净值的 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 为前一日基金资产净值

3、除管理费和托管费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

基金管理费、基金托管费每日计提，按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人和基金托管人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

(四) 不列入基金费用的项目

基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用不得从基金财产中列支。基金管理人与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，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。

(五) 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协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒体上刊登公告。

(六) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

第二十一部分 基金的会计与审计

(一) 基金的会计政策

1、基金管理人为本基金的会计责任方；

2、本基金的会计年度为公历每年的 1 月 1 日至 12 月 31 日；

3、本基金的会计核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位；

4、会计制度执行国家有关的会计制度；

5、本基金独立建账、独立核算；

6、基金管理人保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；

7、基金托管人定期与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并书面确认。

(二) 基金的审计

1、基金管理人聘请具有从事证券相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本基金年度财务报表及其他规定事项进行审计。会计师事务所及其注册会计师与基金管理人、基金托管人相互独立。

2、会计师事务所更换经为注册会计师职，应事先征得基金管理人同意。

3、基金管理人 (或基金托管人)认为有充足理由更换会计师事务所，经基金托管人 (或基金管理人)同意，并报中国证监会备案后可以更换，更换会计师事务所，基金管理人应当依照 《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

第二十二部分 基金的信息披露

基金的信息披露应符合 《基金法》、《信息披露办法》、《信息披露办法》、基金合同及其他有关规定。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应当依法披露基金信息，并保证所披露信息的真实性、准确性和完整性。

本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和其他组织。基金管理人、基金托管人和其他基金信息披露义务人应按规定将应予披露的基金信息披露事项在规定时间内通过中国证监会指定的全国性报刊 (以下简称 “指定报刊”)和基金管理人、基金托管人的互联网网站 (以下简称 “网站”)等媒介披露。

本基金信息披露义务人承诺公开披露的基金信息，不得有下列行为：

1.虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

2.对证券投资业绩进行预测；

3.违规承诺收益或者承担损失；

4.泄露其他基金管理人、基金托管人或者基金份额发售机构；

5.登载任何自然人、法人或者其他组织的祝贺性、恭维性或推荐性的文字；

6.中国证监会禁止的其他行为。

本基金公开披露的信息应采用中文文本，如同时采用外文文本的，基金信息披露义务人应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。

本基金公开披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。

公开披露的基金信息包括：

(一) 招募说明书

招募说明书是基金向社会公开发售时对基金情况进行说明的法律文件。

基金管理人按照 《基金法》、《信息披露办法》、基金合同编制并在基金份额发售的 3 日前，将基金招募说明书登载在指定报刊和网站上。基金合同生效后，基金管理人应当在每 6 个月结束之日起 45 日内，更新招募说明书并登载在网站上，将更新的招募说明书摘要登载在指定报刊上。基金管理人将在公告的 15 日前向中国证监会报送更新的招募说明书，并就有关更新内容提供书面说明。更新后的招募说明书公告内容的截止日为每 6 个月的最后 1 日。

(二) 基金合同、托管协议

基金管理人应在基金份额发售的 3 日前，将基金合同摘要登载在指定报刊和网站上；基金管理人、基金托管人应将基金合同、托管协议登载在各自网站上。

(三) 基金份额发售公告

基金管理人将按照 《基金法》、《信息披露办法》的有关规定，就基金份额发售的具体事宜编制基金份额发售公告，并在披露招募说明书的当日登载于指定报刊和网站上。

(四) 基金合同生效公告

基金管理人将在基金合同生效的次日在指定报刊和网站上登载基金合同生效公告。基金合同生效公告中将说明基金募集情况。

(五) 嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易公告书

本基金嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额获准在证券交易所上市交易后，基金管理人将在上市交易日前 3 个工作日，将嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易公告书登载在指定报刊和网站上。

(六) 基金资产净值公告、基金份额净值公告、基金份额累计净值公告

1、本基金的基金合同生效后，在开始办理嘉实多利基金份额申购或者赎回前，基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额净值、嘉实多利进取份额、嘉实多利基金份额累计净值。

2、在开始办理嘉实多利基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额及扣除应计提的基金管理费和托管费后的基金份额净值和嘉实多利基金份额的基金份额累计净值。

3、基金管理人将公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自的基金份额净值和嘉实多利基金份额累计净值。基金管理人应当在上述市场交易日的次日，将基金资产净值、嘉实多利基金份额、嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额各自的基金份额净值和嘉实多利基金份额的基金份额累计净值，登载在指定报刊和网站上。

(七) 嘉实多利基金份额申购、赎回价格公告

基金管理人应当在本基金的基金合同、招募说明书等信息披露文件上载明嘉实多利基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资人能够在基金份额发售网点查阅或者复制前述信息资料。

(八) 基金年度报告、基金半年度报告、基金季度报告

1、基金管理人应当在每年结束之日起 90 日内，编制完成基金年度报告，并将年度报告正文登载于网站上，将年度报告摘要登载在指定报刊上。基金年度报告需经具有从事证券相关业务资格的会计师事务所审计后，方可披露；

2、基金管理人应当在上半年结束之日起 60 日内，编制完成基金半年度报告，并将半年度报告正文登载在网站上，将半年度报告摘要登载在指定报刊上；

3、基金管理人应当在每个季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，并将季度报告登载在指定报刊和网站上；

4、基金合同生效不足 2 个月的，本基金管理人可以不编制当期季度报告、半年度报告或年度报告。

5、基金定期报告应当按有关规定分别报中国证监会和基金管理人主要分公司所在地中国证监会派出机构备案。

(九) 基金信息传送方式

1、在到期折算日前三十个工作日 (基金合同生效日后不满三十个工作日的情形除外)，遵循深圳证券交易所的业务规则，基金管理人将就暂停嘉实多利基金份额申购赎回、暂停嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易等相关业务、及基金份额到期折算等有关事项，进行提示性公告。

2、如果嘉实多利进取份额的份额净值在某一开放日高于 0.4500 元，但在下一开放日不高于 0.4500 元的；基金管理人将就基金份额实施到点折算的可能性及有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行提示性公告。

3、如果某个工作日嘉实多利进取份额的份额净值小于或等于 0.4000 元，则基金管理人确定该日后的第二个工作日为到点折算日。基金管理人将就实施基金份额到点折算的有关事项在至少一家指定媒体和管理人网站进行公告。

4、基金份额到期折算 (或到点折算)结束后，或因极端变化，到点折算日折算前嘉实多利进取份额的份额净大于或等于 1.0000 元，本基金未实施到点折算，基金管理人应在至少一家指定媒体和基金管理人网站公告，并报中国证监会备案。

(十) 临时报告与公告

在基金运作过程中发生如下可能对基金份额持有人权益或者嘉实多利基金份额的价格产生重大影响的事件时，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，予以公告，并在公开披露日分别报中国证监会和基金管理人主要办公所所在地中国证监会派出机构备案：

1.基金份额持有人大会的召开及决议；

2.终止基金合同；

3.转换基金运作方式；

4.更换基金管理人、基金托管人；

5.基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

6.基金管理人股东及其出资比例发生变更；

7.基金募集期延长；

8.基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

9.基金管理人的董事在一年内变更超过 50%；

10.基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过 30%；

11.涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

12.基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

13.基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚，基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

14.重大关联交易事项；

15.基金收益分配事项；

16.管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

17.基金份额净值计价错误达基金份额净值 0.5%；

18.基金改聘会计师事务所；

19.基金变更、增加或减少代销机构；

20.基金更换注册登记机构；

21.本基金开始办理嘉实多利基金份额申购、赎回；

22.本基金嘉实多利基金份额申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

23.本基金发生巨额赎回并延期支付；

24.本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

25.本基金暂停接受嘉实多利基金份额申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

26.本基金接受或暂停接受场内份额配对转换；

27.本基金暂停接受场内份额配对转换后恢复办理场内份额配对转换；

28.本基金实施基金份额折算；

29.嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作；

30.嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额终止运作后嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额的份额折算；

31.嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额上市交易；

32.中国证监会或本基金合同规定的其他事项。

(十一) 信息披露文件的存放地点

在本基金合同存续期限内，任何公共媒体中出现的或者在市场上流传的消息可能对嘉实多利基金份额份格产生误导性影响或者引起投资人做出决策的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。

(十二) 基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决议应自生效之日起 2 日内在指定媒体公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须附公证书全文。公证机关名称及公证员姓名等。（待公告。

(十三) 中国证监会规定的其他信息

(十四) 信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专人负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则的规定。

基金托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会规定和基金合同的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、嘉实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额净值、嘉实多利进取份额净值、嘉实多利基金份额累计净值公告书面确认意见。

(十五) 基金信息披露文件的存放与查阅

基金合同、托管协议、招募说明书或更新后的招募说明书、年度报告、半年度报告、季度报告和嘉实多利基金份额净值、嘉实多利优先份额净值与嘉实多利进取份额净值公告等文本文件在编制完成后，将存放于基金管理人所在地、基金托管人所在地、供公众查阅、投资人在交付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复制件或复印件。

投资人也可在基金管理人指定的网站上进行查阅。本基金的信息披露事项将在指定媒体上公告。

本基金的信息披露将按照法律法规和基金合同的规定。

第二十三部分 风险揭示

投资人投资于本基金，须自行承担投资风险；基金管理人与基金代销机构都不能保证本基金收益或本金安全。

(一) 市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

1、政策风险：因国家宏观政策 (如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等)发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

2、经济周期风险：随经济运行的周期性变化，证券市场的收益水平也呈周期性变化。基金投资于国债与上市公司的股票，收益水平也会随之变化，从而产生风险。

3、利率风险：金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着国债的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润，基金投资于证券，其收益水平会受到利率变化的影响。

4、上市公司经营风险：上市公司的经营好坏受多种因素影响，如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等，这些都会导致企业的盈利发生变化。如果基金所投资的上市公司经营不善，其投票价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，使基金投资收益下降。虽然基金可以通过投资多样化来分散这种非系统风险，但不能完全规避。

5、购买力风险：基金的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。

6、信用风险：主要是指债务人的违约风险，若债务人经营不善，资不抵债，债权人可能会损失掉大部分的投资，这主要体现在企业债中。

7、再投资风险：债券、票据提前付本息后以及回购到期后可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来利率，由此本基金面临再投资风险。

(二) 管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。因此，本基金的收益水平与基金管理人的管理水平、管理手段和管理技术等相关性较大。因此本基金可能因为基金管理人的因素而影响基金收益水平。

(三) 流动性风险

因市场交易量不足，导致证券不能迅速、低成本地转变为现金的风险。流动性风险还包括：由于本基金出现投资者大额赎回，致使本基金没有足够的现金应付基金赎回支付的要求所引发的风险。

(四) 特定风险

1、债券投资风险

本基金为债券型基金，主要投资债券类资产，力求稳定收益；择机参与新股申购、投资二级市场权益类资产、权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，以增加收益。因此，本基金可能因投资债券类资产而面临债券市场系统性风险；因参与新股申购而面临新股发行放缓甚至空仓停滞，或者新股中签收益率下降甚至出现亏损所带来的风险；因少量投资可转债或二级市场权益类资产而承担一定程度的市场整体或个别证券价格下跌的风险。

2、基金运作的特有风险

① 嘉实多利优先份额的本金风险

基金管理人不承诺也不保证嘉实多利优先份额的基金份额持有人获得最低收益或不亏损，在本基金出现极端损失的情形下，嘉实多利优先份额的基金份额持有人也可能损失本金。

② 嘉实多利进取份额的杠杆性风险

嘉实多利进取份额具有一定的杠杆性，因此，表现出比一般债券型基金更高的风险特征。

为减小嘉实多利进取份额的份额净值下跌风险，本基金设定在嘉实多利进取份额的份额净值不高于 0.4000 元时触发基金份额到点折算，但极端情况下，嘉实多利进取份额的份额净值仍有归零的风险。

③ 场内份额配对转换的风险

基金合同生效后，本基金将根据基金合同约定，办理场内的嘉实多利基金份额与分级份额之间的场内份额配对转换业务。场内份额配对转换，一方面，可能改变嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的市场供求关系，从而可能影响基金份额的交易价格；另一方面，可能出现暂停办理该业务的情形，投资人的份额配对转换申请也可能存在不能及时确认的风险。

④ 流动性风险

在嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易后，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的规模可能较小或交易量不足，导致投资人不能迅速、低成本地变现或买入的风险。

⑤ 基金份额折算的风险

由于本基金各级份额的风险收益特征不同，经基金份额到期折算或到点折算后，嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额折算成嘉实多利基金份额的部分；或者当嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额运作终止，嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额折算成嘉实多利基金份额后，基金份额持有人所持有的嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额将面临风险收益特征变化的风险。

⑥ 本基金在场内、场外嘉实多利基金份额转托管、场内基金份额配对转换等业务过程中，一些证券公司可能由于其自身原因限制，存在无法进行场内交易的风险。

⑦ 基金份额的折溢价交易风险

嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额上市交易后，基金份额的交易价格与其基金份额净值之间可能发生偏离并出现折溢价交易的风险。

受场内份额配对转换业务与本基金开放式机制的影响，八份嘉实多利优先份额与两份嘉实多利进取份额的市价总和将与十份嘉实多利基金份额份额净值之和趋同，但是，嘉实多利优先份额或嘉实多利进取份额仍有可能处于折溢价交易状态。此外，由于场内份额配对转换业务与本基金开放式机制会形成一定的套利机会，嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的交易价格可能会相互影响。

(五) 其他风险

1、因技术因素而产生的风险，如电脑系统不可靠产生的风险；

2、因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

3、因人为因素而产生的风险，如内幕交易、操纵行为等产生的风险；

4、对主要业务人员在基金经理的依赖而可能产生的风险；

5、因业务竞争压力可能产生的风险；

6、战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产的损失，影响基金收益水平，从而带来风险；

7、其他意外导致的风险。

第二十四部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算

(一) 基金合同的变更

1.基金合同变更内容对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的，应召开基金份额持有人大会，基金合同变更的内容应经基金份额持有人大会决议同意。

① 转换基金运作方式；

② 变更基金类别；

③ 变更基金投资目标、投资范围或投资策略 (法律法规、基金合同和中国证监会另有规定的除外)；

④ 变更基金份额持有人大会程序；

⑤ 更换基金管理人、基金托管人；

⑥ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的相关规定提高该等报酬标准的除外；

⑦ 本基金与其他基金的合并；

⑧ 终止嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的运作；

⑨ 对基金合同当事人权利、义务产生重大影响的其他事项；

⑩ 法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

但出现下列情况时，可不经基金份额持有人大会决议，由基金管理人和基金托管人同意变更后公布，并报中国证监会备案：

① 调低基金管理费、基金托管费和其他应由基金承担的费用；

② 在法律法规和本基金合同规定的范围内变更收费方式、费率和费用计提方式、基金托管人的选任；

③ 因相应的法律法规发生变动必须对基金合同进行修改；

④ 对基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生变化；

⑤ 基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

⑥ 根据中国证监会及深圳证券交易所变动基金上市交易的规则等相关规定，本基金修改嘉实多利优先份额与嘉实多利进取份额的上市与交易规定；

⑦ 在不变更本基金合同其他约定的条件下，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嘉实多利基金份额的收益分配方式；

⑧ 按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

2. 关于变更基金合同的基金份额持有人大会决议应报中国证监会核准或备案，并于中国证监会核准或出具无异议意见后生效执行，并自生效之日起 2 日内在至少一种指定媒体公告。

(二) 本基金合同的终止

有下列情形之一的，本基金合同经中国证监会核准后将终止：

1.基金份额持有人大会决定终止的；

2.基金管理人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金管理人的职务，而在 6 个月内无其他适当的基金管理公司承接其原有权利义务；

3.基金托管人因解散、破产、撤销等事由，不能继续担任基金托管人的职务，而在 6 个月内无其他适当的托管机构承接其原有权利义务；

4.中国证监会规定的其他情况。

如果本基金合同终止，本基金将嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额全部折算为场内嘉实多利基金份额，份额折算基准日为本基金合同终止日 (如该日为非工作日，则顺延至下一个工作日)，份额折算方式和份额折算计算方式，适用本基金第二十二章第 (二)款第 1 款至第 3 款的约定。

(三) 基金财产的清算

1.基金财产清算组

① 基金合同终止时，成立基金财产清算组，基金财产清算组在中国证监会的监督下进行基金清算。

② 基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。

③ 基金财产清算组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法进行必要的民事活动。

2.基金财产清算程序

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

① 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

② 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

③ 对基金财产进行清理和确认；

④ 对基金财产进行估价和变现；

⑤ 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

⑥ 聘请律师事务所出具法律意见书；

⑦ 将基金财产清算结果报告中国证监会；

⑧ 地加与基金财产有关的民事诉讼；

⑨ 公布基金财产清算结果；

⑩ 对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组先从基金财产中支付。

4.基金财产按下列顺序清偿：

① 支付清算费用；

② 交纳所欠税款；

③ 清偿基金债务；

④ 按基金份额持有人持有的嘉实多利基金份额的份额比例进行分配。

基金财产未按前款 (1)-(3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件在基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同保存在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买 (基金合同复制件或复印件，但内容应以 《基金合同》正本为准。

第二十六部分 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室

办公地址：北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

邮政编码：100005

法定代表人：王忠民

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字 [1999]5 号文

组织形式：有限责任公司 (中外合资)

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整

存续期限：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

(二) 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司 (简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

① 基金托管人根据法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

① 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

② 基金合同终止时，由基金财产清算组统一接管基金财产；

③ 对基金财产进行清理和确认；

④ 对基金财产进行估价和变现；

⑤ 聘请会计师事务所对清算报告进行审计；

⑥ 聘请律师事务所出具法律意见书；

⑦ 将基金财产清算结果报告中国证监会；

⑧ 地加与基金财产有关的民事诉讼；

⑨ 公布基金财产清算结果；

⑩ 对基金剩余财产进行分配。

3.清算费用

清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算组先从基金财产中支付。

4.基金财产按下列顺序清偿：

① 支付清算费用；

② 交纳所欠税款；

③ 清偿基金债务；

④ 按基金份额持有人持有的嘉实多利基金份额的份额比例进行分配。

基金财产未按前款 (1)-(3) 项规定清偿前，不分配给基金份额持有人。

5.基金财产清算的公告

基金财产清算报告于基金合同终止并报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算组公告；清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算结果经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，由基金财产清算组报中国证监会备案并公告。

6.基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件在基金托管人保存 15 年以上。

八、争议解决方式

对于因基金合同的订立、内容、履行和解释或与基金合同有关的争议，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对各方当事人均有约束力。仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本基金合同受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得基金合同的方式

基金合同保存在基金管理人、基金托管人、代销机构的办公场所和营业场所查阅；投资者也可按工本费购买 (基金合同复制件或复印件，但内容应以 《基金合同》正本为准。

第二十六部分 基金托管协议的内容摘要

一、基金托管协议当事人

(一) 基金管理人

名称：嘉实基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室

办公地址：北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

邮政编码：100005

法定代表人：王忠民

成立时间：1999 年 3 月 25 日

批准设立机关：中国证券监督管理委员会

批准设立文号：中国证监会证监基字 [1999]5 号文

组织形式：有限责任公司 (中外合资)

注册资本：人民币壹亿伍仟万元整

存续期限：持续经营

经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

(二) 基金托管人

名称：招商银行股份有限公司 (简称：招商银行)

住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码：518040

法定代表人：傅育宁

成立时间：1987 年 4 月 8 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [2002]83 号

经营范围：吸收公众存款；发放贷款；办理结算；办理票据贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券；同业拆借；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；外汇存款；外汇贷款；外汇汇款；外币兑换；国际结算；结汇、售汇；同业外汇拆借；外汇借款；外汇担保；发行和代理发行股票以外的外币有价证券；买卖和代理买卖股票以外的外币有价证券；自营和代客外汇买卖；资信调查、咨询、见证业务；离岸金融业务。经中国人民银行批准的其他业务。

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 215.77 亿元

存续期间：持续经营

二、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查

(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金投资范围、投资对象进行监督。

① 基金托管人根据法律法规和基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

基金合同终止，应当按法律法规和本基金合同的有关规定对基金财产进行清算。基金财产清算程序主要包括：

① 基金合同终止后，发布基金财产清算公告；

②