（上接D14版）

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×年托管费率÷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,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托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

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。

(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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(三)基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。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。

(四)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。

五、基金财产的投资范围和投资限制

(一)投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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)。

本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括公司债、企业债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、国债、金融债、债券回购、央行票据、银行存款(同业存款、银行通知存款等)以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可投资于一级市场新股申购、股票增发以及可转债转股所得的股票或权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但不可直接从二级市场上买入股票和权证。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制);权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%;在开放期内,本基金持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

(二)投资禁止行为

1、承销证券;

2、向他人贷款或者提供担保;

3、从事承担无限责任的投资;

4、买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

5、向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;

6、买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;

7、从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

8、依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动;

9、法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

(三)投资组合限制

本基金在投资策略上兼顾投资原则以及开放式基金的固有特点,通过分散投资降低基金财产的非系统性风险,保持基金组合良好的流动性。基金的投资组合将遵循以下限制:

(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;

(2)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(3)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(5)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;

(6)在封闭期内,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%(在开放期开始前三个月至开放期结束后三个月内,不受前述投资组合比例的限制);权益类资产的投资比例合计不超过基金资产的20%。在开放期内,本基金持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;

(7)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(8)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(9)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(11)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(12)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(13)本基金投资流通受限证券,基金管理人应事先根据中国证监会相关规定,与基金托管人在本基金托管协议中明确基金投资流通受限证券的比例,根据比例进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

法律法规或监管部门变更或取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式

本基金按以下方式进行估值:

1、证券交易所上市的有价证券的估值

(1)交易所上市的有价证券(包括股票、权证等),以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值;估值日无交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,以最近交易日的市价(收盘价)估值;如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格。

(2)交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值,估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(3)交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化,按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价格;

(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:

(1)送股、转增股、配股和公开增发的新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值;该日无交易的,以最近一日的市价(收盘价)估值;

(2)首次公开发行未上市的股票、债券和权证,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。

(3)首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值;非公开发行有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值。

4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。

5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的,从其规定。如有新增事项,按国家最新规定估值。

如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。

根据有关法律法规,基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任,因此,就与本基金有关的会计问题,如经相关各方在平等基础上充分讨论后,仍无法达成一致的意见,按照基金管理人对基金资产净值的计算结果对外予以公布。

七、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(本基金依据本基金合同的约定直接转换运作方式的除外);

(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。但根据适用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)终止基金上市,但因本基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外;

(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基金的申购费率、赎回费率或收费方式;

(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重大变化;

(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)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)《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或备案后将终止:

1.本基金开放期最后一个工作日的基金资产净值加上当日申购申请金额及基金转换中转入申请金额扣除赎回申请金额及基金转换中转出申请金额后的余额低于2亿元;

2.开放期最后一个工作日的基金份额持有人人数低于200人;

3.发生明显损害剩余持有人利益的大规模净赎回申请,其中净赎回申请为赎回申请总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额;

4.基金份额持有人大会决定终止的;

5.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;

6.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;

7.中国证监会规定的其他情况。

(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)参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优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基金份额比例进行分配。

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

基金财产清算公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由基金托管人保存15年以上。

八、争议的处理

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、基金合同的效力

基金合同是约定基金当事人之间、基金与基金当事人之间权利义务关系的法律文件。

(一) 本基金合同经基金管理人和基金托管人加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字,在基金募集结束,基金备案手续办理完毕,并获中国证监会书面确认后生效。基金合同的有效期自其生效之日起至该基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。

(二)本基金合同自生效之日起对包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人在内的基金合同各方当事人具有同等的法律约束力。

(三)本基金合同正本一式八份,除中国证监会和银行业监督管理机构各持两份外,基金管理人和基金托管人各持有两份。每份均具有同等的法律效力。

(四)本基金合同可印制成册,供投资人在基金管理人、基金托管人、代销机构和注册登记机构办公场所查阅,但其效力应以基金合同正本为准。

## 七、基金财务状况

(一)基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金资产中支付,其他各基金销售机构根据本基金招募说明书设定的费率收取认购费。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金募集结束后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金2012年10月18日资产负债表如下:

| 资　产 | 2012年10月18日 | 负债和所有者权益 | 2012年10月18日 |
|---|---|---|---|
| | 余　额 | | 余　额 |
| 资　产: | | 负债: | |
| 银行存款 | 20,273,080.00 | 短期借款 | |
| 结算备付金 | 6,123,293.86 | 交易性金融负债 | |
| 存出保证金 | | 衍生金融负债 | |
| 交易性金融资产 | 553,283,155.84 | 卖出回购金融资产款 | |
| 其中:股票投资 | | 应付证券清算款 | |
| 债券投资 | 553,283,155.84 | 应付赎回款 | 0.89 |
| 资产支持证券投资 | | 应付管理人报酬 | 184,170.45 |
| 基金投资 | | 应付托管费 | 61,390.15 |
| 衍生金融资产 | | 应付销售服务费 | |
| 买入返售金融资产 | | 应付交易费用 | 4,367.25 |
| 应收证券清算款 | 40,003,211.12 | 应付税费 | |
| 应收利息 | 5,612,516.49 | 应付利息 | |
| 应收股利 | | 应付利润 | |
| 应收申购款 | | 其他负债 | 138,993.70 |
| 其他资产 | | 负债合计 | 388,922.44 |
| | | 所有者权益: | |
| | | 实收基金 | 621,973,457.73 |
| | | 未分配利润 | 2,932,877.14 |
| | | 所有者权益合计 | 624,906,334.87 |
| | | | |
| 资产合计: | 625,295,257.31 | 负债与持有人权益总计: | 625,295,257.31 |

## 八、基金投资组合

截止2012年10月18日,本基金的投资组合如下:

(一)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 | 553,283,155.84 | 88.48 |
| | 其中:债券 | 553,283,155.84 | 88.48 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 26,396,373.86 | 4.22 |
| 6 | 其他资产 | 45,615,727.61 | 7.30 |
| 7 | 合计 | 625,295,257.31 | 100.00 |

(二)按行业分类的股票投资组合

2012年10月18日,本基金未持有股票。

(三)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

2012年10月18日,本基金未持有股票。

(四)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 | – | – |
| | 其中:政策性金融债 | – | – |
| 4 | 企业债券 | 273,292,155.84 | 43.73 |
| 5 | 企业短期融资券 | 279,991,000.00 | 44.81 |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | – | – |
| 8 | 其他 | – | – |
| 9 | 合计 | 553,283,155.84 | 88.54 |

(五)按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 041251015 | 12铁道CP001 | 1,000,000 | 100,080,000.00 | 16.02 |
| 2 | 041253056 | 12电网CP004 | 500,000 | 50,105,000.00 | 8.02 |
| 3 | 112097 | 12亚厦债 | 510,021 | 49,982,058.00 | 8.00 |
| 4 | 041251017 | 12华能集CP003 | 500,000 | 49,875,000.00 | 7.98 |
| 5 | 122596 | 12沪城开 | 300,000 | 30,000,000.00 | 4.80 |

(六)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

2012年10月18日,本基金未持有资产支持证券。

(七)按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

2012年10月18日,本基金未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2、本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | 40,003,211.12 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 5,612,516.49 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| 9 | 合计 | 45,615,727.61 |

(九)持有的处于转股期的可转换债券明细

2012年10月18日,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(十)前十名股票中存在流通受限情况的说明

2012年10月18日,本基金未持有股票。

## 九、重大事件揭示

本基金以下信息披露事项已通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》以及基金管理人的公司网站(www.99fund.com)进行公开披露,并已报送相关监管部门备案。

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金份额发售公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月11日 |
| 2 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金招募说明书 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月11日 |
| 3 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同摘要 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月11日 |
| 4 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同 | 管理人网站 | 2012年6月11日 |
| 5 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金托管协议 | 管理人网站 | 2012年6月11日 |
| 6 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金上网发售提示性公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月13日 |
| 7 | 关于汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金增加中国银行为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月22日 |
| 8 | 关于汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金增加江苏银行为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月27日 |
| 9 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行为代销机构并参与电子渠道申购和定投基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年6月27日 |
| 10 | 关于汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金增加浦发银行为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年7月4日 |
| 11 | 汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同生效公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年7月27日 |
| 12 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加数米基金为代销机构并参与申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年8月6日 |
| 13 | 汇添富基金管理有限公司关于网上直销系统使用中国农业银行借记卡申购基金费率优惠的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年9月19日 |
| 14 | 汇添富基金管理有限公司关于旗下部分基金增加诺亚正行为代销机构的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年9月21日 |
| 15 | 汇添富基金管理有限公司关于开通现金宝快速取现服务的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站 | 2012年10月10日 |

## 十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三) 在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

## 十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:

(一)严格遵守《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则托管基金资产。

(二)根据《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金份额净值计算进行监督和核查;如发现基金管理人违反《证券基金法》、《证券基金投资运作管理办法》及本基金《基金合同》、《托管协议》的规定,将及时通知基金管理人纠正;基金管理人对基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将及时向中国证监会报告。

## 十二、备查文件目录

(一)本基金备查文件包括下列文件:

1、中国证监会核准汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金募集的文件;

2、《汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金基金合同》;

3、《汇添富季季红定期开放债券型证券投资基金托管协议》;

4、法律意见书;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、中国证监会要求的其他文件。

(二)备查文件的存放地点和投资者查阅方式:

以上备查文件存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间可供免费查阅。

**汇添富基金管理有限公司**

**2012年10月22日**

---

（上接D13版）

(101)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 |

(102)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 |

(103)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 | | |
| 法定代表人 | 丁之锁 | 联系人 | 梁宇 |
| 电话 | (010)58568007 | 传真 | (010)58568062 |
| 网址 | www.hrsec.com.cn | 客服电话 | (010)58568118 |

(104)财富里昂证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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.cf-clsa.com | 客服电话 | 68777877 |

(105)国元证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 安徽省合肥市寿春路179号 | | |
| 法定代表人 | 凤良志 | 联系人 | 陈玲玲 |
| 电话 | (0551)2246273 | 传真 | (0551)2272100 |
| 网址 | www.gyzq.com.cn | 客服电话 | 95578 |

(106)宏源证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所 | 新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦 | | |
| 办公地址 | 北京西城区太平桥大街19号宏源证券 | | |
| 法定代表人 | 冯戎 | 联系人 | 李巍 |
| 电话 | (010)88085858 | 传真 | (010)88085195 |
| 网址 | www.hysec.com | 客服电话 | 4008-000-562 |

(107)天相投资顾问有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 注册地址 | 北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701 | | |
| 办公地址 | 北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层 | | |
| 法定代表人 | 林义相 | 联系人 | 林爽 |
| 电话 | (010)66045608 | 传真 | (010)66045500 |
| 天相投顾网址 | http://www.txsec.com | | |
| 天相基金网网址 | http://jijin.txsec.com | | |
| 客服电话 | (010)66045678 | | |

(108)华西证券

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所 | 四川省成都市陕西街239号 | | |
| 办公地址 | 深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼深圳总部 | | |
| 法定代表人 | 杨炯洋 | 联系人 | 金达勇 |
| 电话 | (0755)83025723 | 传真 | (0755)83025991 |
| 网址 | www.hx168.com.cn | 客服电话 | 4008-888-818 |

(109)中国国际金融有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所 | 北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 | | |
| 办公地址 | 北京建国门外大街1号国贸大厦2座28层 | | |
| 法定代表人 | 李剑阁 | 联系人 | 马强 |
| 电话 | (010)65051166 | 传真 | (010)85679535 |
| 网址 | www.ciccs.com.cn | | |
| 客服电话 | (010)85679238;(010)85679169 | | |

(二)基金注册登记机构

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 | 普华永道中天会计师事务所有限公司 | | |
| 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 | 上海市卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼 | | |
| 法定代表人 | 杨绍信 | 联系人 | 金毅 |
| 电话 | (021)61238888 | 传真 | (021)61238800 |
| 经办注册会计师 | 许康玮、金毅 | | |

**四、基金的名称**

本基金名称:嘉实回报灵活配置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**

力争每年获得较高的绝对回报。

**七、基金的投资方向**

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、衍生工具(权证等)、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)、资产支持证券、央行票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货等金融衍生产品或其它品种,可以根据有关规定将其纳入投资范围,并报证监会备案。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票等权益类资产占基金资产的比例为30-80%;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5-70%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。

若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定,适用新的规定。

**八、基金的投资策略**

本基金强调自上而下、从大类资产到个券选择的配置策略。灵活的大类资产配置、多策略的行业及主题配置以及精选个股个券是获得持续稳定回报的主要来源,而纪律性的风险管理策略是保证回报的重要手段。因此,本基金将运用大类资产配置模型、行业选择和个券选择三个层次的投资策略,并综合运用风险管理策略实现基金的投资目标。

1.资产配置策略

在大类资产配置上,依据自主开发的战术资产配置模型(Tactical Asset Allocation, TAA Model),在遵守有关投资限制规定的前提下,合理分配各类资产投资比例。本基金的大类资产配置TAA模型综合考虑了以下几方面因素:

(1)宏观因素:宏观面关注基本面的重要经济数据以及货币和财政政策的变化。经济基本面我们特别关注GDP增长、工业增加值等各种国民生产统计指标,从而分析对股票市场的影响。而货币和财政政策主要分析利率、CPI、信贷等的影响。

(2)市场因素:市场方面我们关注流动性的变化对市场的影响。同时通过反映投资者情绪和信息的技术和统计指标预测未来的市场变化趋势。

(3)估值因素:估值方面我们不仅关注股票市场的绝对估值因素,同时也比较不同市场之间的相对估值变化,以在大类资产间寻找相对的估值洼地。

在预期股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时,本基金将大幅减少股票投资比例,而主要投资于债券市场,以回避股票市场下跌的系统性风险,避免组合损失,从而实现组合的稳健增值。

2.股票投资策略

本基金秉持自上而下的投资理念,在股票投资策略中,优先进行行业配置,然后在行业内精选个股。同时,本基金也着力发掘有价值的主题性投资机会。

(1)行业及主题选择策略

基金经理通过分析行业赢利能力、发展前景、周期性,并综合考虑政策影响和市场认同度等因素,确定各行业以及主题的投资比例,并根据市场情况动态调整。

(2)个股选择策略

在个股选择上,采用对基本面的深度研究为主、数量分析为辅的选股策略,并积极寻找各类主题型机会,从多层面多角度发掘有价值的股票。本基金运用数量方法,根据宏观经济和市场的最新情况,对全市场股票按照给定条件进行初步筛选,得到初级股票池。在此基础上,对于初级股票池中的个股从多角度进行深度研究,寻找价值被低估或者有良好成长性的股票形成投资股票池。同时,本基金积极发掘有价值的投资主题,通过细致的市场调研和分析,寻找相关的优良投资品种。

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,合理利用衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会,并帮助基金实现保值和锁定收益的目的。

5.风险管理策略

风险管理策略是本基金实现稳定增值目标的重要保障。本基金将运用风险预算模型(Risk Budgeting Model, RB Model)技术,根据基金资产的变化和外部市场环境的变化,动态调整本基金的持仓,以锁定收益、减少亏损,达到稳定升值的目的

**九、基金的业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为同期人民币一年期定期存款利率(税前)。

**十、基金的风险收益特征**

本基金为混合型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金,高于债券基金及货币市场基金。

**十一、基金的投资组合报告**

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年7月16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2012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 | 1,343,547,929.71 | 69.96 |
| | 其中:股票 | 1,343,547,929.71 | 69.96 |
| 2 | 固定收益投资 | 368,428,314.30 | 19.18 |
| | 其中:债券 | 368,428,314.30 | 19.18 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | 35,000,000.00 | 1.82 |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 135,622,021.06 | 7.06 |
| 6 | 其他资产 | 37,899,597.00 | 1.97 |
| | 合计 | 1,920,497,862.07 | 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 | 38,013,042.93 | 2.01 |
| B | 采掘业 | 35,468,959.54 | 1.87 |
| C | 制造业 | 721,401,525.80 | 38.11 |
| C0 | 食品、饮料 | 182,644,862.32 | 9.65 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | – | – |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 66,297,368.84 | 3.50 |
| C5 | 电子 | 57,277,390.35 | 3.03 |
| C6 | 金属、非金属 | – | – |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 269,310,494.35 | 14.23 |
| C8 | 医药、生物制品 | 145,871,409.94 | 7.71 |
| C99 | 其他制造业 | – | – |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 59,146,551.08 | 3.12 |
| E | 建筑业 | 27,380,393.65 | 1.45 |
| F | 交通运输、仓储业 | 39,349,867.92 | 2.08 |
| G | 信息技术业 | 9,244,450.54 | 0.49 |
| H | 批发和零售贸易 | – | – |
| I | 金融、保险业 | 113,958,075.25 | 6.02 |
| J | 房地产业 | 194,459,694.43 | 10.27 |
| K | 社会服务业 | 100,900,180.57 | 5.33 |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | 4,225,188.00 | 0.22 |
| | 合计 | 1,343,547,929.71 | 70.97 |

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 | 000024 | 招商地产 | 2,997,397 | 73,526,148.41 | 3.88 |
| 2 | 601601 | 中国太保 | 3,015,314 | 66,879,664.52 | 3.53 |
| 3 | 000069 | 华侨城A | 10,008,549 | 63,854,542.62 | 3.37 |
| 4 | 000157 | 中联重科 | 5,907,710 | 59,254,331.30 | 3.13 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 2,841,962 | 58,487,577.96 | 3.09 |
| 6 | 002241 | 歌尔声学 | 1,770,715 | 57,277,390.35 | 3.03 |
| 7 | 000616 | 亿城股份 | 14,122,981 | 51,690,110.46 | 2.73 |
| 8 | 002304 | 洋河股份 | 323,077 | 43,470,010.35 | 2.30 |
| 9 | 600048 | 保利地产 | 3,775,989 | 42,819,715.26 | 2.26 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 1,999,926 | 41,698,457.10 | 2.20 |

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 | 145,415,000.00 | 7.68 |
| 3 | 金融债券 | 207,490,000.00 | 10.96 |
| | 其中:政策性金融债 | 207,490,000.00 | 10.96 |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 企业短期融资券 | – | – |
| 6 | 中期票据 | – | – |
| 7 | 可转债 | 15,523,314.30 | 0.82 |
| 8 | 其他 | – | – |
| | 合计 | 368,428,314.30 | 19.46 |

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 | 110411 | 11农发11 | 1,000,000 | 104,440,000.00 | 5.52 |
| 2 | 110412 | 11农发12 | 1,000,000 | 103,050,000.00 | 5.44 |
| 3 | 1101094 | 11央行票据94 | 1,000,000 | 96,960,000.00 | 5.12 |
| 4 | 1101088 | 11央行票据88 | 500,000 | 48,455,000.00 | 2.56 |
| 5 | 113002 | 工行转债 | 102,310 | 11,150,766.90 | 0.59 |

6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

8.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 | 1,119,192.57 |
| 2 | 应收证券清算款 | 24,827,464.93 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 11,872,586.85 |
| 5 | 应收申购款 | 80,352.65 |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 待摊费用 | – |
| 8 | 其他 | – |
| | 合计 | 37,899,597.00 |

(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 | 113002 | 工行转债 | 11,150,766.90 | 0.59 |
| 2 | 110013 | 国投转债 | 4,372,547.40 | 0.23 |

(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 | 002241 | 歌尔声学 | 21,856,000.00 | 1.15 | 非公开发行流通受限 |

**十二、基金的业绩**

基金业绩截止日为2012年6月30日。

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.本基金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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效起至2009年12月31日 | 5.59% | 1.12% | 0.84% | 0.01% | 4.75% | 1.11% |
| 2010年 | 11.25% | 1.19% | 2.33% | 0.01% | 8.92% | 1.18% |
| 2011年 | -23.24% | 0.92% | 3.33% | 0.01% | -26.57% | 0.91% |
| 2012年上半年 | 2.52% | 0.84% | 1.74% | 0.01% | 0.78% | 0.83% |

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:嘉实回报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

(2009年8月18日至2012年6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(十四(二)投资范围和(七)2、基金投资组合比例限制)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;

(2)基金托管人的托管费;

(3)因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);

(4)基金合同生效以后的信息披露费用;

(5)基金份额持有人大会费用;

(6)基金合同生效以后的会计师费和律师费;

(7)基金的资金汇划费用;

(8)按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,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。

(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0.25%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

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,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。

上述1、基金费用的种类中第(3)-(8)项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。

3、不列入基金费用的项目

本条第1款约定以外的其他费用,以及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等不列入基金费用。处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

4、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调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费

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。

本基金申购费率最高不超过申购金额的5%,具体如下:

| 申购金额(含申购费) | 申购费率 |
|---|---|
| M<50万元 | 1.5% |
| 50万元≤M<200万元 | 1.2% |
| 200万元≤M<500万元 | 0.8% |
| M≥500万元 | 单笔1,000元 |

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。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。优惠后费率如果低于0.6%,则按0.6%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%。

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

本基金的赎回费率按照持有时间递减,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 |
|---|---|
| <365天 | 0.50% |
| 365天≤M<730天 | 0.25% |
| ≥730天 | 0 |

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担,其中25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

3、转换费

(1)嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金B、嘉实安心货币市场基金转换为嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金时,转换费率均为转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

净转入金额=(转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值)/(1+转换费率)+M

转换费用=(转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值)×转换费率/(1+转换费率)

转入份额=净转入金额/转入当日转入基金的基金份额净值

其中M为嘉实货币市场基金、嘉实安心货币市场基金全部转出时账户当前累计未付收益

(2)嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金与嘉实公司旗下其他20只开放式基金(包括:嘉实成长收益证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、嘉实主题精选混合型证券投资基金、嘉实策略增长混合型证券投资基金、嘉实优质企业股票型证券投资基金、嘉实研究精选股票型证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金A、嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金、嘉实价值优势股票型证券投资基金、嘉实稳固收益债券型证券投资基金、嘉实主题新动力股票型证券投资基金、嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、嘉实信用债券型证券投资基金、嘉实周期优选股票型证券投资基金、嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金、嘉实优化红利股票型证券投资基金)之间互转,以及嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金转入嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金B、嘉实安心货币市场基金时,均采用"赎回费+申购费率补差"算法,计算公式如下:

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 为对应的申购补差费率,当转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率时,则申购补差费率G为零;

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

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)。

注:自2010年5月26日起嘉实主题混合暂停转入业务;自2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务;自2011年1月7日起嘉实策略混合暂停转入业务;自2012年3月16日起,嘉实信用债券A、嘉实信用债券C单日单个基金账户单笔申购(或转入、定投)不超过500万元;2012年6月8日起,嘉实货币单日单个基金账户单笔申购(或转入、定投)不超过1亿元。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

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。

(三)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:更新相关代销机构信息。

5.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。

6.在"十二、基金的业绩"部分:说明了自2009年8月18日本基金合同生效日至2009年12月31日、2010年、2011年、2012年上半年的基金业绩。

7.在"二十五、其他应披露事项"部分:列示了本基金自2012年2月18日至2012年8月18日相关临时公告事项。

**嘉实基金管理有限公司**

**2012年10月22日**