（上接B146版）

（106）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	孔伯杰	联系人	冯杰
电话	(010)83991743	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn	客服电话	4006609839

（107）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

（108）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

（109）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

（110）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

（111）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-elsa.com	客服电话	68777877

（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	上海市通力律师事务所		
住所,办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	021)31358666	传真	021)31358600
经办律师	吕红、黎明		

（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	洪磊
电话	021)23238888	传真	021)23238800
经办注册会计师	许康玮、洪磊		

四、基金的名称

本基金名称:嘉实信用债券型证券投资基金

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

本基金在控制风险和保持资产流动性的基础上,追求长期稳定增值。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、货币市场工具、股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）,权证,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）。

本基金主要投资于短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、国债、央行票据、债券回购、银行存款等固定收益类资产。

本基金不从二级市场买入股票,权证等权益类金融工具,但可以参与一级市场股票首次公开发行或增发,还可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出。

本基金投资组合的资产配置范围为:债券等固定收益类资产占基金资产的比例不低于80%,其中信用债券的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票等权益类资产占基金资产的比例不超过20%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。

本基金所指信用债券是指短期融资券、中期票据、企业债、公司债、金融债（不含政策性金融债）、地方政府债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券等除国债和央行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他信用类金融工具。

如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他金融品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金将深刻的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,通过自上而下与自下而上的战略、战术运用,力争持续达到或超越业绩比较基准,为投资者长期稳定地保值增值。

首先,本基金在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上,以中长期利率趋势分析和债券市场供求关系研究为核心,自上而下地决定债券组合久期、动态调整大类金融资产比例,结合收益率水平曲线形态分析和类属资产相对估值分析,优化债券组合的期限结构和类属配置。其次,本基金在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。另外,本基金也会关注股票一级市场、权证一级市场等其它相关市场存在的投资机会,力争实现基金总体风险收益特征保持不变提下的基金资产增值最大化。

1、资产配置

本基金综合分析宏观经济趋势、国家宏观政策趋势、行业及企业盈利和信用状况、债券市场和股票市场估值水平及预期收益等,“自上而下”地挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会,在基金合同约定的范围内确定债券类资产、权益类资产和现金的配置比例,并随着各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整大类资产的投资比例,以规避或控制市场风险,提高基金收益率。

2、债券投资策略

（1）久期策略

本基金将通过积极主动地预测市场利率的变动趋势,相应调整债券组合的久期配置,以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。在确定债券组合久期的过程中,本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上,根据债券市场收益率曲线的当前形态,通过合理假设下的情景分析和压力测试,最后确定最优的债券组合久期。

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）期限结构和类属配置策略

在债券组合的久期确定后,本基金将通过收益率曲线形态分析和类属资产相对估值分析,在组合期限结构和类属配置两个主要方面对组合进行优化,以达到在相同组合久期的条件下,进一步提高债券组合收益的目的。在组合优化的过程中,本基金将根据各类属债券资产当前的收益率曲线,在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下,通过嘉实债券组合优化数量模型,确定最优的期限结构和类属配置。

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）信用策略

信用债收益率是在无信用风险的利率品种基准收益率上,叠加信用利差。信用利差是影响本基金信用收益的重要因素。由于信用利差收益率主要受两方面影响:一是该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线走势,二是该信用债本身的信用变化,本基金分别采取策略:

1）基于信用利差曲线变化策略:一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响,二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响,最后综合各种因素,分析信用利差曲线整体及分行业走势,确定信用债券总的及分行业投资比例。

2）基于信用债信用变化策略:发行人信用发生变化后,本基金将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。本基金主要依靠内部评级系统分析信用债的相对信用水平、违约风险及理论信用利差。

为控制信用风险,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。

（4）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。

（5）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。

（6）资产支持证券（含资产收益计划）投资策略

本基金将通过宏观经济、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,预测资产池未来现金流变化;研究标的证券发行条款,预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

（7）可转换债券投资策略

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、新股投资策略

本基金的股票投资包括新股申购、增发等一级市场投资。在参与股票一级市场投资的过程中,本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面,运用嘉实基金的研究平台和股票估值体系,深入发掘新股内在价值,结合市场估值水平和股市投资环境,充分考虑中签率、锁定期等因素,有效识别并防范风险,以获取较好收益。

5、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,其投资原则为有利于基金资产增值。本基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,立足于无风险套利,尽力减少组合净值波动率,力求稳健的超额收益。

6、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

本基金业绩比较基准:中国债券总指数收益率

该指数由中央国债登记结算公司编制,样本券涵盖面广泛,在中国债券网（www.chinabond.com.cn）公开发布,具有良好的市场代表性、较强的权威性和市场影响力,适合作为本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年1月15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2013年12月31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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	547,179,661.40	97.56
	其中:债券	507,179,661.40	90.43
	资产支持证券	40,000,000.00	7.13
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	1,951,275.11	0.35
6	其他资产	11,727,130.69	2.09
	合计	560,858,067.20	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,785,000.00	8.74
	其中:政策性金融债	39,785,000.00	8.74
4	企业债券	194,013,661.40	42.60
5	企业短期融资券	158,922,000.00	34.90
6	中期票据	114,459,000.00	25.13
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	507,179,661.40	111.36

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	1182159	11威利MTN1	400,000	38,412,000.00	8.43
2	122609	12扬城控	300,000	30,450,000.00	6.69
3	041356033	13苏交通CP006	300,000	29,814,000.00	6.55
4	041361043	13中电投CP003	300,000	29,766,000.00	6.54
5	041355036	13沪城投CP001	300,000	29,742,000.00	6.53

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

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	119027	侨城05	400,000	40,000,000.00	8.78

注:报告期末,本基金仅持有以上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名的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

8. 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。

9. 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。

10. 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	237,659.39
2	应收证券清算款	928,528.50
3	应收股利	-
4	应收利息	10,535,056.09
5	应收申购款	25,886.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	11,727,130.69

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(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基金的招募说明书。

1. 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

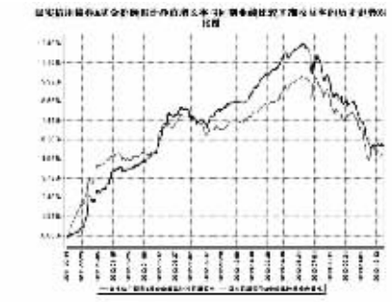
（1）嘉实信用债券A

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
2011年9月14日（基金合同生效日）至2011年12月31日	3.31%	0.11%	4.89%	0.13%	-1.58%	-0.02%
2012年	5.20%	0.07%	2.51%	0.07%	2.69%	0.00%
2013年	-2.62%	0.11%	-2.10%	0.11%	-0.52%	0.00%

（2）嘉实信用债券C

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
2011年9月14日（基金合同生效日）至2011年12月31日	3.11%	0.12%	4.89%	0.13%	-1.78%	-0.01%
2012年	4.80%	0.07%	2.51%	0.07%	2.29%	0.00%
2013年	-3.03%	0.11%	-2.10%	0.11%	-0.93%	0.00%

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



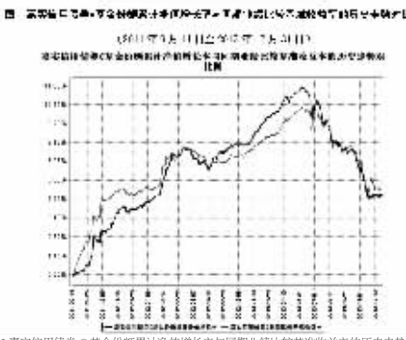


图2:嘉实信用债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年9月14日至2013年12月31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）投资禁止行为与限制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）销售服务费;

（4）因基金的证券交易或结算而产生的费用;

（5）基金合同生效以后的信息披露费用;

（6）基金份额持有人大会费用;

（7）基金合同生效以后的会计师费和律师费;

（8）基金资产的资金汇划费用;

（9）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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.7%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0.7%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

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个工作日内从基金资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0.2%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。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个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

（3）销售服务费

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别,适用不同的销售服务费率。其中,A类不收取销售服务费,C类销售服务费年费率为0.35%。

各类别基金份额的销售服务费计算方法如下:

H=E×R÷当年天数

H 为各类别基金份额每日应计提的销售服务费

E 为各类别基金份额前一日基金资产净值

R 为各类别基金份额适用的销售服务费率

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中划出,经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。

上述第（一）条第1款“基金费用的种类”中第（4）-（9）项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

3、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。

4、费用调整

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。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的规定在指定媒体上刊登公告。

（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A类基金份额前端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。具体如下:

申购金额（含申购费）	申购费率
M<100万元	0.8%
100万元≤M<300万元	0.5%
300万元≤M<500万元	0.3%
M≥500万元	单笔1000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在线支付方式申购开放式基金业务,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;个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统采用汇款支付方式申购本基金以及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%的则按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。

本基金C类基金份额申购费率为0。

（2）赎回费

本基金对A、C类基金份额收取赎回费,在投资者赎回基金份额时收取。基金份额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。

本基金A类基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限（t）	赎回费率
H<365天	0.10%
365天≤H<730天	0.05%
H≥730天	0

本基金C类基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限（t）	赎回费率
H<30天	0.10%
H≥30天	0

（3）转换费

基金转换费由基金份额持有人承担,用于支付有关手续费和注册登记费。本基金转换费率按照如下方式收取:

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信用债券型证券投资基金A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信用债券型证券投资基金C时,无转换费用;

③嘉实信用债券型证券投资基金与嘉实公司旗下原有其他24只开放式基金（包括:嘉实成长收益证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健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、嘉实优质商业股票型证券投资基金、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、嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金、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、嘉实纯债债券型发起式证券投资基金A/C、嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金）之间互转,以及嘉实信用债券型证券投资基金转换为嘉实货币市场基金、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和嘉实纯债债券型发起式证券投资基金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。

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。

基金管理人可以在不违背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）或在特定时间段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,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注1: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2013年8月2日起,嘉实信用债券A、嘉实信用债券C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1月9日起,嘉实研究精选股票暂停转换转入业务;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。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

注2:2013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4月12日起,在本公司基金网上直销系统（含电话交易）开通旗下部分基金产品的后端收费模式（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（含电话交易）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。

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。

（三）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

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:新增数米基金、天天基金、长量基金三家代销机构,并更新了相关直销机构、代销机构信息和会计师事务所信息。

5. 在“八、基金份额的申购与赎回”部分:根据相关公告,增加了自2014年3月3日起降低投资者通过本公司网上直销办理首次投资金额、追加投资金额、赎回最低限额以及最低账面份额的单笔最低要求。

6. 在“九、基金转换”部分:更新了基金转换的相关内容。

7.在“十二、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“十三、基金的业绩”:基金业绩更新至2013年12月31日。

9.在“二十七、其他应披露事项”部分:列示了本基金自2013年9月14日至2014年3月14日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2014年4月26日

证券代码:000668 证券简称:荣丰控股 编号:2014-28

荣丰控股集团股份有限公司二〇一四年第一次临时股东大会决议公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

一、重要提示:会议召开没有增加、否决或变更提案。

二、会议召开情况:

1、召开时间:2014年4月25日上午10:00

2、召开地点:双赢酒店

3、召开方式:现场方式

4、召集人:公司董事会

5、主持人:董事长王征

6、会议的召开符合《公司法》、《上市规则》和《公司章程》的规定。

三、会议的出席情况

出席本次股东大会的股东及股东代表10人,代表公司58,494,501股,占公司股份总额的39.84%。

四、提案审议和表决情况

(一)审议通过《关于向德邦创新资本有限公司申请成立资产管理计划并提供担保的议案》。

表决情况:

同意58,494,501票,占出席会议有表决权股东所持表决票的39.84%。0票反对,0票弃权。

(二)审议通过《关于调整独立董事津贴的议案》

表决情况:

同意58,494,501票,占出席会议有表决权股东所持表决票的39.84%。0票反对,0票弃权。

(三)补选聂成根先生为公司第七届监事会监事

表决情况:

同意58,494,501票,占出席会议有表决权股东所持表决票的39.84%。0票反对,0票弃权。

五、律师出具的法律意见

本次股东大会经湖北正信律师事务所律师答邦彪、温天相现场见证,并出具《法律意见书》,认为,荣丰控股本次股东大会的召集、召开程序符合《公司法》和荣丰控股《公司章程》的规定,出席会议人员、召集人的资格合法、有效,会议表决程序、表决结果合法、有效。

特此公告。

荣丰控股集团股份有限公司董事会

二〇一四年四月二十五日

证券代码:002437 证券简称:誉衡药业 公告编号:2014-054

哈尔滨誉衡药业股份有限公司关于继续停牌的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

2014年4月19日,哈尔滨誉衡药业股份有限公司(以下简称"公司")在指定媒体《证券时报》、《中国证券报》及巨潮资讯网 http://www.cninfo.com.cn 发布了《关于继续停牌的公告》;公司目前正在筹划另外一项对外投资事宜,鉴于该事项尚在筹划之中且存在重大不确定性,为保证公平信息披露,维护投资者利益,避免对公司股价造成重大影响,根据深圳证券交易所的相关规定,特申请公司股票(股票简称"誉衡药业",股票代码"002437")自2014年4月21日开市起继续停牌。

目前,筹划的收购事项尚在进一步洽谈中,因此,经公司申请,公司股票于2014年4月28日开市起继续停牌。

待上述事项确定后,公司将及时发布相关公告并申请复牌。停牌期间,公司将根据事项进展情况,严格按照有关法律法规的规定和要求及时履行信息披露义务,敬请投资者关注相关公告并注意投资风险。

特此公告。

哈尔滨誉衡药业股份有限公司

二〇一四年四月二十六日

申万菱信基金管理有限公司关于旗下基金对长期停牌的股票变更估值方法的提示性公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》([2008]38号)、中国证券投资基金业协会《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》(中基协发[2013]13号)及申万菱信基金管理有限公司(以下简称"本公司")长期停牌股票的估值政策和程序,基金持有已停牌股票且潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,相应股票应参考应用上述有关规定中的行业估值指数确定其公允价值。

本公司旗下部分基金持有的"宇通客车"(股票代码:600066)因重大事项自2014年4月15日起停牌。经与托管行协商一致,自2014年4月25日起采用"指数收益法"对本公司旗下基金持有的"宇通客车"进行估值。敬请投资者予以关注。

待上述股票复牌且其交易体现了活跃市场交易特征后,将恢复为采用当日收盘价格进行估值,届时不再另行公告。

特此公告。

申万菱信基金管理有限公司

2014年4月26日

工银瑞信基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的长期停牌股票估值方法调整的公告

根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》的相关规定,自2014年4月24日起,我公司对旗下证券投资基金持有的长期停牌股票"锦龙股份000712"、"华闻传媒000793"、"汉得信息300170"、"三六五网300295"、"广汇能源600256"、"宇通客车600066"按指数收益法每日估值,直至其复牌交易。

投资者可通过以下途径咨询有关详情:

工银瑞信基金管理有限公司网站:www.icbccs.com.cn

客户服务电话:400-811-9999（免长途费）

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,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预示其未来表现。投资者投资于本公司管理的基金时应认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,并注意投资风险。

特此公告。

工银瑞信基金管理有限公司

二〇一四年四月二十六日

证券代码:002348 证券简称:高乐股份 公告编号:2014-012

广东高乐玩具股份有限公司关于股东进行股票质押式回购交易的公告

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

近日,广东高乐玩具股份有限公司(以下简称"公司")接到公司股东普宁市新鸿辉实业投资有限公司(以下简称"新鸿辉实业")关于进行股票质押式回购交易的通知,现将有关情况公告如下:

新鸿辉实业将其持有的6730.6万股公司股票与海通证券股份有限公司进行股票质押式回购交易,本次交易已于2014年4月22日办理了相关手续。初始交易日为2014年4月22日,购回交易日为2015年4月22日。上述股份质押期限自该日起,至向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理解除质押登记为止,质押期间该股份予以冻结不能转让。

截止本公告披露日,新鸿辉实业持有公司股份7200万股,占公司总股本的15.20%,全部为限售流通股,质押股票合计6730.6万股,占公司总股本的14.21%。

特此公告。

广东高乐玩具股份有限公司

董 事 会

二〇一四年四月二十六日

证券代码:002366 证券简称:丹甫股份 公告编号:2014-031

四川丹甫制冷压缩机股份有限公司关于重大资产重