（上接B62版）

（三）出具法律意见书的律师事务所

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）审计基金财产的会计师事务所

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：嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式，债券型基金

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债券、货币市场工具，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、中小企业私募债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、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，不参与一级市场股票首次公开发行或增发，但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等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出。因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的1个月内卖出。

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，本基金投资于债券和银行存款等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。其中投资于短期融资券及债项信用评级为非AAA级别的除短期融资券以外的其他信用债券的合计比例，不低于固定收益类资产的80%。开放期内，本基金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、中小企业私募债、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。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

1.资产配置

本基金在具备足够多预期风险可控、收益率良好的投资标的时，优先考虑短期融资券及债项信用评级为非AAA级别的除短期融资券以外的其他信用债券资产的配置。除主要的信用债券投资策略外，本基金还可通过其他债券投资策略，衍生工具投资策略（如：资产支持证券投资策略及其他金融工具投资策略）等辅助投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。

2.信用债券投资策略

本基金主要采用自下而上的个债精选策略，在短期融资券及债项信用评级为非AAA级别的除短期融资券以外的其他信用债券中，精选预期风险可控、收益率较高的债券，结合适度分散的行业配置策略，构造和优化组合，谋求为投资人创造较高的风险调整后回报。

本基金受研究驱动，不主要依靠国内信用评级机构的评级，而是采用“嘉实信用分析系统”的信用评级和信用分析，依赖信用分析师团队持续深入的基本面研究，遵循国际先进的评级方法，采用定性定量模型，为精选个债提供支持。

“嘉实信用分析系统”的信用分析框架包括：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。

（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“嘉实投资备选库流程”，生成或更新买入信用债券备选库，强化投资纪律，保护组合质量。

其次，本基金主要从信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类属、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）、剩余期限、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、通过自由现金流增强去杠杆的财务能力、资产估值更利于支持债务、更强大的公司管理、更稳定或更高的市场占有率、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：发债企业出现环境分析师预期的情况、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、个债已达到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，影响同一发债人的违约概率，影响不同发债人间的违约相关度，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风险收益。

（3）利差套利策略

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，可根据市场利率水平、收益率曲线的形态以及对利率期限结构的预期，调整回购放大的杠杆比例，控制杠杆放大的风险。

（4）信用风险控制措施

与高收益债券关联的较大部分风险是发债公司特有的，非市场系统性风险。

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。

（5）中小企业私募债投资策略

中小企业私募债票面利率较高、信用风险较大、二级市场流动性较差。

中小企业私募债收益率由基准收益率与信用利差叠加组成，信用风险表现在信用利差的变化上；信用利差主要受两方面影响，一是系统性信用风险，即该信用债对应信用水平的市场信用利差曲线变化；二是非系统性信用风险，即该信用债本身的信用变化。

针对市场系统性信用风险，本基金主要通过调整中小企业私募债类属资产的配置比例，谋求避险增收。因为经济周期的复苏初期通常是中小企业私募债表现的最佳阶段，而过热期通常是中小企业私募债表现的最差阶段。本基金运用深刻的基本面研究，力求前瞻性判断经济周期，在经济周期的复苏初期保持适当增加的中小企业私募债配置比例，在经济周期的过热期保持适当降低的中小企业私募债配置比例。

针对非系统性信用风险，本基金通过“嘉实信用分析系统”，分析发债主体的信用水平及个债增信措施，量化比较判断估值，精选个债，谋求避险增收。

针对流动性风险，本基金在控制信用风险的基础上，对中小企业私募债投资，主要采取分散投资，控制个债持有比例；主要采取买入持有到期策略；当预期发债企业的基本面情况出现恶化时，采取“尽早出售（first sale, best sale）”策略，控制投资风险。

另外，部分中小企业私募债内嵌转股选择权，本基金将通过深入的基本面分析及定性定量研究，自下而上地精选个债，在控制风险的前提下，谋求内嵌转股权潜在的增强收益。

3.其他债券投资策略

（1）久期调整策略

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）期限结构调整策略

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）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。

（4）流动性管理策略

为合理控制本基金开放期的流动性风险，并满足每次开放期的流动性需求，本基金在投资管理中将持有债券的组合久期与封闭期进行适当的匹配。

4.资产支持证券（含资产收益计划）投资策略

本基金综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。本基金可根据市场发展，精选投资夹层工具，在控制风险的前提下谋求收益增强。

5.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，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：中债企业债总财富指数收益率

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，能反映我国企业债市场整体价格及投资回报，适合作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的债券指数时，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。

十、基金的风险收益特征

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。

本基金托管人招商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	569,586,008.00	75.30
	其中：债券	494,197,008.00	65.34
	资产支持证券	75,389,000.00	9.97
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	176,544,146.32	23.34
6	其他资产	10,267,104.30	1.36
	合计	756,397,258.62	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	49,650,000.00	7.89
	其中：政策性金融债	49,650,000.00	7.89
4	企业债券	116,337,008.00	18.49
5	企业短期融资券	328,210,000.00	52.15
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	494,197,008.00	78.53

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	130243	13国开43	500,000	49,650,000.00	7.89
2	041355036	13沪城投CP001	500,000	49,570,000.00	7.88
3	041360047	13苏国信CP002	300,000	30,057,000.00	4.78
4	011316004	13华电股SCP004	300,000	29,949,000.00	4.76
5	041355032	13重汽CP002	300,000	29,844,000.00	4.74

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	123504	13汇元A2	500,000	50,000,000.00	7.94
2	061204003	12中银1B	200,000	18,114,000.00	2.88
3	061205002	12上元1B	100,000	7,275,000.00	1.16

注：报告期末，本基金仅持有上述3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	753,013.78
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,514,090.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	10,267,104.30

(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。

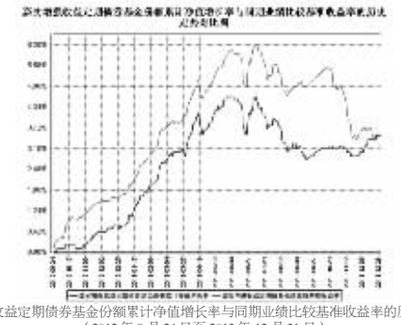
十二、基金的业绩

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.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

	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2012年12月31日	0.80%	0.04%	1.73%	0.04%	-0.93%	0.00%
2013年	2.67%	0.09%	1.76%	0.09%	0.91%	0.00%

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：嘉实增强收益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（2012年9月24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“第十三部分（二）投资范围和（六）投资禁止行为与限制”的有关约定。

十三、基金的费用与税收

（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)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)在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；

(9)基金的开户费用、账户维护费用；

(10)依法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

在通常情况下，基金管理费按基金资产净值的0.8%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.8%÷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。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月首日起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。

本条第1款第（3）至第（10）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

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、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。

（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的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，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。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	申购费率
M<100万元	0.40%
100万元≤M<200万元	0.32%
200万元≤M<500万元	0.20%
500万元≤M<1000万元	0.08%
M≥1000万元	按笔收取，1000元/笔

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）	申购费率
M<100万元	1.0%
100万元≤M<200万元	0.8%
200万元≤M<500万元	0.5%
500万元≤M<1000万元	0.2%
M≥1000万元	按笔收取，1000元/笔

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、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、招商银行借记卡的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。

2、赎回费

本基金对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

基金管理人可以在法律法规和本基金合同规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。

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、电话交易等)等进行基金交易的投资人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和基金赎回费率。

3、转换费

2013年9月18日，本基金管理人发布了《关于嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金开放及暂停申购、赎回和转换业务的公告》，本基金第一个开放期（即2013年9月24日至2013年10月14日）开通的转换业务安排如下：

（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转换为嘉实增强收益定期债时，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）嘉实增强收益定期债与嘉实公司旗下原有其他22支开放式基金（包括：嘉实成长收益混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券A、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、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、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、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票）之间互转（仅限于与旗下原有其他22支基金的前端收费模式所得份额的转换），以及嘉实增强收益定期债转入嘉实货币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。

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该基金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。

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。

（3）对于2013年9月23日在嘉实公司登记在册的本基金份额持有人，将嘉实增强收益定期债转入为嘉实公司旗下原有其他22只基金（包括：嘉实成长收益混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券A、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、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、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、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票）的前端收费模式所得份额的情况，转换费率将进行优惠，具体计算公式如下：

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为嘉实增强收益定期债的对应赎回费率的25%；

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

以上转换费率安排仅适用于本次开放期的转换业务，本基金后续的转换业务安排请参见基金管理人届时公告。

注1：自2011年1月7日起，嘉实增长混合实施暂停转入业务；自2011年1月7日起，嘉实策略混合实施暂停转入业务；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。

（三）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。

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：增加数米基金、天天基金、长量基金为代销机构，并更新相关代销机构和会计师事务所联系人信息。

5.在“九、基金份额的申购与赎回”部分：根据相关公告，增加了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“十、基金转换”部分：更新了基金转换的相关信息。

7.在“十三、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.“十四、基金的业绩”：基金业绩更新至2013年四季度末。

9.在“二十八、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2013年9月24日至2014年3月24日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2014 年5月6日

证券代码：002363　证券简称：隆基机械　公告编号：2014-027

山东隆基机械股份有限公司第二届董事会第三十次会议决议公告

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

特别提示：公司股票自 2014 年 5 月 6 日开市起复牌

山东隆基机械股份有限公司（以下简称“公司”）第二届董事会第三十次会议于 2014 年 5 月 5 日上午在公司六楼会议室召开。本次会议已于 2014 年 4 月 29 日以电话和传真的方式通知各位董事、监事和高级管理人员。会议采取现场表决的方式召开。会议应到董事 7 人，实到董事 7 人，全体监事、高管列席了会议，会议由董事长张海燕女士召集并主持，会议的召开符合《中华人民共和国公司法》等法律法规和《山东隆基机械股份有限公司章程》的规定，会议合法有效。

本次会议以投票表决方式审议通过了如下决议：

一、审议通过《关于对外投资设立隆基海晨汽车电子有限公司的议案》。

详细内容请见登载于 2014 年 5 月 6 日的 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）上的《山东隆基机械股份有限公司对外投资公告》。

表决结果：7 票赞成，0 票反对，0 票弃权。

特此公告

山东隆基机械股份有限公司
董事会
2014 年5月6日

证券代码：002363　证券简称：隆基机械　公告编号：2014-028

山东隆基机械股份有限公司对外投资公告

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

山东隆基机械股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于 2014 年 5 月 5 日召开第二届董事会第三十次会议，审议通过了《关于对外投资设立隆基海晨汽车电子有限公司的议案》。现就相关事项公告如下：

一、对外投资概述

2014 年 5 月 5 日，公司经过与烟台海晨科技有限公司（以下简称“海晨科技”）协商，双方一致同意签订《合资意向书》，拟在山东龙口市共同投资设立隆基海晨汽车电子有限公司（以下简称“隆基海晨”）（暂定名，具体以工商登记部门核准的名称为准）。隆基海晨拟注册资本 10000 万元，其中本公司出资 5100 万元，持有 51%的股权，海晨科技出资 4900 万元，持有 49%的股权。

本次对外投资不构成关联交易，不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。本次对外投资事项的批准权限在本公司董事会对外投资权限内，无需经股东大会批准。

二、交易对方基本情况

对方名称：烟台海晨科技有限公司

法定地址：龙口市外向型工业加工区黄城西环路北首

法定代表人：彭玉华

注册资本：500 万元

经营范围：电子产品、自动化设备、计算机及应用系统、电视监控、防盗报警及信息产业。

本公司与上述交易对方不存在关联关系。

三、对外投资基本情况

1、公司名称：隆基海晨汽车电子有限公司（暂定名，具体以工商登记部门核准的名称为准）

2、拟注册地址：山东省龙口经济开发区

3、拟注册资本：10000 万元

5、拟业务范围：新能源汽车充电机，汽车空气质量控制系统，其他汽车电子、电器配、部件。

投资人及持股比例：

投资人	出资方式	出资金额（万元）	持股比例
山东隆基机械股份有限公司	现金方式出资	5100	51%
烟台海晨科技有限公司	以技术、市场、现金方式出资	4900	49%

四、对外投资合作协议的主要内容

1、合作方式

（1）、投资总额：预计为人民币 10000 万元。甲方出资 5100 万元，占公司总股本的 51%；乙方出资 4900 万元，占公司总股本的 49%。

（2）、甲方以现金出资，乙方以技术、市场、现金方式出资。

（3）、甲乙双方的首次出资额不低于注册资本的百分之二十，其余部分在公司成立后两年内缴足。

2、经营范围

新能源汽车充电机，汽车空气质量控制系统，其他汽车电子、电器配、部件。

五、对外投资的目的和对公司的影响

随着国家对环保问题的重视和新能源汽车的崛起，公司管理层从长远角度出发，经过详细分析与论证制定该项目。本项对外投资是基于市场发展方向，借助自身为国内自主品牌传统汽车和新能源汽车配套制动产品的优势，利用海晨科技在新能源汽车充电机领域的先进技术与成熟的销售渠道，发挥各自优势，在提高公司汽车制动产品配套能力的同时，积极涉足新能源汽车其它部件领域，促进公司新能源汽车业务的发展。

隆基海晨为新设立的有限公司，可能在经营过程中面临市场风险、政策风险、运营风险、财务风险等，本公司将会拟定积极的应对策略和风险控制措施，以获得良好的投资回报。

本次对外投资的资金将全部以自有资金进行支付，不会影响公司现金流的正常运转。

五、备查文件

1. 第二届董事会第三十次会议决议；

2. 《山东隆基机械股份有限公司与烟台海晨科技有限公司共同设立隆基海晨汽车电子有限公司合资意向书》。

特此公告

山东隆基机械股份有限公司
董事会
2014年5月6日

证券代码：002363　证券简称：隆基机械　公告编号：2014-029

山东隆基机械股份有限公司重大事项复牌公告

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

山东隆基机械股份有限公司（以下简称“公司”）因筹划重大事项，于 2014 年 4 月 30 日发布了《重大事项停牌公告》。鉴于相关事项尚存在不确定性，为了维护投资者利益，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，经公司董事会考虑研究，公司股票（股票简称：隆基机械，股票代码：002363）于 2014 年 4 月 29 日下午 13：00 开市起停牌。

2014 年 5 月 5 日公司召开第二届董事会第三十次会议，审议通过《关于对外投资设立隆基海晨汽车电子有限公司的议案》，经公司申请，公司股票自 2014 年 5 月 6 日开市起复牌，恢复正常交易。

特此公告

山东隆基机械股份有限公司
董事会
2014 年5月6日

证券代码：002377　证券简称：国创高新　公告编号：2014-043 号

湖北国创高新材料股份有限公司关于重大经营合同中标的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

一、中标概况

2014年5月5日，湖北国创高新材料股份有限公司（以下简称“本公司”）接到陕西省交通建设集团公司发来的《中标通知书》，本公司被确定为延安至延川（陕晋界）高速公路沥青供货LQ-2标段的中标单位。中标金额为：人民币114,330,000元。本公司于2014年4月1日在证券时报、中国证券报、上海证券报、证券日报及巨潮资讯网上发布了《湖北国创高新材料股份有限公司日常经营重大合同公示提示性公告》，公告编号：2014-024号。

二、项目概况

延安至延川（陕晋界）高速公路项目全线采用双向四车道高速公路标准，主线全长115.526km，其中马家沟至姚店段36.134Km及延川立交至陕晋界段31.465 Km，设计速度为80Km/h，路基宽度24.5m；姚店至延川立交段47.927公里设计速度为100Km/h，路基宽度26.0m。项目初步设计概算118.26亿元，预计工期三年。

本次招标房建工程2组、沥青供货计划于2014年1月1日进场，房建工程2组施工工期为18个月，沥青供货期为20个月。

本次招标房建工程2组施工分为3个标段1个组别，沥青供货分为3个标段。标段划分及主要工程内容具体情况如下：

标段划分及主要工程内容一览表

| 类别 | 标段 | 组别 | 起讫桩号 | 路