嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014年第1号）

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：招商银行股份有限公司

重要提示

嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称"本基金"）根据2014年2月28日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》（证监许可【2014】238号）的注册进行募集，本基金基金合同于2014年5月16日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为2014年11月16日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2014年9月30日（未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	安奎
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字［1999］5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

邓红国先生，董事长，硕士研究生，中共党员。曾任物资部研究室、政策体制法规司副处长；中国人民银行国际司、外资金融机构管理司、银行监管一司、银行管理司副处长、处长、副巡视员；中国银监会银行监管三部副主任、四部主任；中诚信托有限责任公司董事长、党委书记、法定代表人。2014年12月2日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商期期货经纪有限公司、北京证券有限责任公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、总经理。

苗菁先生，董事，学士学位，中共党员。曾任中煤信托有限责任公司国际业务部项目经理，投资管理部业务经理；2004年3月至今历任中诚信托有限责任公司投资管理部业务经理、副经理、经理，投资总监兼投资管理部经理；现任中诚信托有限责任公司投资总监、公司党委委员。

Bernd Amlung先生，董事，德国籍，德国拜罗伊特大学商业管理专业硕士。自1989年起加入德意志银行以来，曾在私人财富管理、全球市场部工作。现任德意志资产与财富管理公司（Deutsche Asset & Wealth Management，London）全球战略与业务发展部负责人，MD。

Mark Cullen先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品（Darlington Commodities）商品交易主管，贝恩（Bain&Company）期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官，MD，现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官，MD。

韩家乐先生，董事，1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特汉姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事，中共党员，教授，加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士。清华大学商法研究中心副主任、清华大学法学院副教授，担任中国证券法学研究会常务理事、中国商法学研究会常务理事、北京市经济法学会常务理事、中国法学会检察学研究会金融检察专业委员会委员。曾任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现任上海证券交易所第三届上市委员会委员。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限责任公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部，现任法律部总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

张峰先生，副总经理，中共党员，硕士。曾就职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资银行部总经理，平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人，平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2、基金经理

（1）现任基金经理

张琦，硕士研究生，9年基金从业经历，具有基金从业资格，中国国籍。2005年7月加入嘉实基金，历任行业研究员、金融地产研究组组长，2011年3月至今担任研究部副总监，2013年5月28日至今任嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金基金经理，2013年12月6日至今任嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理，2014年5月16日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理

无。

3、股票投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼公司首席投资官（股票业务）邵健先生，公司总经理赵学军先生，公司研究总监陈勤先生，资深基金经理邹唯先生、张弢先生，定量投资部负责人张自力先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称"招商银行"）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：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

注册资本：252.198亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字【2002】83号

电话：0755—83077301

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：朱万鹏

（二）发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截止2014年9月30日，本集团总资产5.0331万亿元人民币，高级法下资本充足率11.45%，权重法下资本充足率10.89%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务支持室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工60人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立"因势而变、先您所想"的托管理念和"财富所托、信守承诺"的托管核心价值，独创"6S托管银行"品牌体系，以"保护您的业务、保护您的财富"为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出"网上托管银行系统"、托管业务综合系统和"6心"托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只"1+N"基金专户理财，第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

经过十年发展，招商银行资产托管规模快速壮大。2013年招商银行加大高收益托管产品营销力度，新增托管公募开放式基金18只，新增首发公募开放式基金托管规模377.37亿元。克服国内证券市场震荡下行的不利形势，托管费收入、托管资产均创出历史新高，实现托管费收入10.62亿元，较上年增长62.47%，托管资产余额1.86万亿元，较年初增长71.86%。作为公益慈善基金的首个独立第三方托管人，成功签约"壹基金"公益资金托管，为我国公益慈善资金监管、信息披露进行有益探索，该项目荣获2012中国金融品牌「金象奖」"十大公益项目"奖；四度蝉联获《财资》"中国最佳托管专业银行"。

（三）主要人员情况

李建红先生，本行董事长、非执行董事，2014年7月起担任本行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，本行行长、执行董事，2013年5月起担任本行行长、本行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

丁伟先生，本行副行长。大学本科毕业，副研究员。1996年12月加入本行，历任杭州分行办公室主任兼营业部总经理，杭州分行行长助理、副行长，南昌支行行长，南昌分行行长，总行人力资源部总经理，总行行长助理，2008年4月起任本行副行长。兼任招银国际金融有限公司董事长。

吴晓辉先生，招商银行资产托管部总经理，硕士研究生，高级经济师。1993年10月进入招商银行工作；历任招商银行总行计划资金部副总经理，总行资金交易部总经理，招银国际金融有限公司总裁；招商银行济南分行党委书记、行长，2011年7月起担任招商银行总行资产托管部总经理。

（四）基金托管业务经营情况

截至2014年9月30日，招商银行股份有限公司托管了招商安泰系列证券投资基金（含招商股票证券投资基金、招商平衡型证券投资基金和招商债券证券投资基金），招商现金增值开放式证券投资基金、华夏经典配置混合型证券投资基金、长城久泰沪深300指数证券投资基金、华夏货币市场基金、光大保德信货币市场基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、光大保德信新增长股票型证券投资基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、德盛优势股票证券投资基金、华富成长趋势股票型证券投资基金、光大保德信优势配置股票型证券投资基金、益民多利债券型证券投资基金、德盛红利股票证券投资基金、上证中央企业50交易型开放式指数证券投资基金、上投摩根行业轮动股票型证券投资基金、中银蓝筹精选灵活配置混合型证券投资基金、南方策略优化股票型证券投资基金、兴全合润分级股票型证券投资基金、中邮核心主题股票型证券投资基金、长盛沪深300指数证券投资基金（LOF）、中银价值精选灵活配置混合型证券投资基金、中银稳健双利债券型证券投资基金、银河创新成长股票型证券投资基金、嘉实多利分级债券型证券投资基金、国泰保本混合型证券投资基金、华宝兴业可转债债券型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、诺安保本混合型证券投资基金、鹏华新兴产业股票型证券投资基金、博时裕祥分级债券型证券投资基金、上证国有企业100交易型开放式指数证券投资基金、华安可转换债券债券型证券投资基金、中银转债增强债券型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金（LOF）、中银中小盘成长股票型证券投资基金、国泰成长优选股票型证券投资基金、兴全轻资产投资股票型证券投资基金（LOF）、易方达纯债债券型证券投资基金、中银沪深300等权重指数证券投资基金（LOF）、中银保本混合型证券投资基金、嘉实增强收益定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信14天理财债券型发起式证券投资基金、鹏华中小企业纯债债券型发起式证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中银纯债债券型证券投资基金、南方安心保本混合型证券投资基金、中银理财7天债券型证券投资基金、中海惠裕纯债分级债券型发起式证券投资基金、建信双月安心理财债券型证券投资基金、中银理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、中银稳健添利债券型发起式证券投资基金、博时亚洲票息收益债券型证券投资基金、工银瑞信增利分级债券型证券投资基金、鹏华丰利分级债券型发起式证券投资基金、中银消费主题股票型证券投资基金、工银瑞信信用纯债一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信保本3号混合型证券投资基金、中银标普全球精选自然资源等权重指数证券投资基金、博时月月薪定期支付债券型证券投资基金、中银保本二号混合型证券投资基金、建信安心回报两年定期开放债券型证券投资基金、中海惠利纯债分级债券型证券投资基金、富国恒利分级债券型证券投资基金、中银优秀企业股票型证券投资基金、中银多策略灵活配置混合型证券投资基金、华安新活力灵活配置混合型证券投资基金、宝盈新价值灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德新成长股票投资基金、嘉实对冲套利定期开放混合型投资基金、宝盈瑞祥养老混合型证券投资基金和银华永益分级债券型证券投资基金、中银聚利分级债券型证券投资基金、国泰新经济灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信新财富灵活配置混合型证券投资基金、东方红睿丰灵活配置混合型证券投资基金、博时月月盈短期理财债券型证券投资基金、中银新经济灵活混合型证券投资基金共85只开放式基金及其它托管资产，托管资产为29520.42亿元人民币。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：嘉实基金管理有限公司直销中心、上海直销中心、深圳、成都、青岛、杭州、福州、南京、广州分公司和嘉实网上交易。

（1）嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街7号北京万豪中心D座12层		
电话	（010）65215588	传真	（010）65215577
联系人	赵佳		

（2）嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03室		
电话	（021）38789658	传真	（021）68880023
联系人	鲍东华		

（3）嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段86号城市之心30H		
电话	（028）86202100	传真	（028）86202100
联系人	王启明		

（4）嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场T1—1202		
电话	（0755）25870686	传真	（0755）25870663
联系人	周炜		

（5）嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路10号颐和国际大厦A座3502室		
电话	（0532）66777766	传真	（0532）66777676
联系人	陈建林		

（6）嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路15号嘉华国际商务中心313室		
电话	（0571）87759328	传真	（0571）87759331
联系人	章文雷		

（7）嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路158号环球广场25层04单元		
电话	（0591）88013673	传真	（0591）88013670
联系人	吴志锋		

（8）嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路288号新世纪广场A座4202室		
电话	（025）66671118	传真	（025）66671100
联系人	徐莉莉		

（9）嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路183号大都会广场2415-2416室		
电话	（020）87555163	传真	（020）81552120
联系人	庄文胜		

2、代销机构

（1）招商银行股份有限公司

住所、办公地址	深圳市深南大道7088号招商银行大厦		
法定代表人	李建红	联系人	邓炯鹏
电话	（0755）83198888	传真	（0755）83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

（2）中国农业银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街69号		
法定代表人	蒋超良	联系人	滕涛
电话	（010）85108227	传真	（010）85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

（3）中国银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼		
注册地址	北京市西城区复兴门内大街1号		
法定代表人	田国立		
电话	（010）66596688	传真	（010）66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

（4）中国工商银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街55号		
法定代表人	姜建清	联系人	陶仲伟
电话	010-66105662	传真	010-66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

（5）中国建设银行股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街25号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心		
法定代表人	王洪章		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

（6）交通银行股份有限公司

办公地址	上海市银城中路188号		
注册地址	上海市银城中路188号		
法定代表人	牛锡明	联系人	曹榕
电话	021-58781234	传真	021-58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

（7）中国邮政储蓄银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街3号		
注册地址	北京市西城区金融大街3号		
法定代表人	李国华	联系人	王硕
传真	（010）68858117		
网址	www.psbc.com	客服电话	95580

（8）上海浦东发展银行股份有限公司

办公地址	上海市中山东一路12号		
注册地址	上海市中山东一路12号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	高天、虞谷云
电话	（021）61618888	传真	（021）63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

（9）中信银行股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座		
法定代表人	常振明	联系人	廉赵峰
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

（10）平安银行股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦		
法定代表人	肖遂宁	联系人	张青
电话	0755-22166118	传真	0755-82080406
网址	www.bank.pingan.com	客服电话	95511-3或95501

（11）乌鲁木齐商业银行股份有限公司

住所	乌鲁木齐市新华北路8号		
办公地址	乌鲁木齐市新华北路8号商业银行大厦		
法定代表人	农惠臣	联系人	何佳
电话	（0991）8824667	传真	（0991）8824667
网址	www.uccb.com.cn	客服电话	（0991）96518

（12）渤海银行股份有限公司

住所、办公地址	天津市河西区马场道201-205号		
法定代表人	刘宝凤	联系人	王宏
电话	（022）58316666	传真	（022）58316569
网址	www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811

（13）北京农村商业银行股份有限公司

办公地址	北京市朝阳区朝阳门北大街16号元亨大厦		
注册地址	北京市朝阳区朝阳门北大街16号元亨大厦		
法定代表人	王金山	联系人	王薇娜
电话	（010）85605006	传真	（010）85605345
网址	www.bjrcb.com	客服电话	96198

（14）烟台银行股份有限公司

住所、办公地址	山东省烟台市芝罘区海港路25号		
法定代表人	叶文君	联系人	王淑华
电话	0535-6699660	传真	0535-6699884
网址	www.yantaibank.net	客服电话	4008-311-777

（15）河北银行股份有限公司

住所、办公地址	石家庄市平安北大街28号		
法定代表人	乔志强	联系人	王娟
电话	0311-88627587	传真	0311-88627027
网址	www.hebbank.com	客服电话	4006129999

（16）嘉实财富管理有限公司

住所	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
法定代表人	赵学军	联系人	景琪
电话	021-20289890	传真	021-20280110
网址	www.harvestwm.cn	客服电话	400-021-8850

（17）上海好买基金销售有限公司

办公地址	上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室		
注册地址	上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室		
法定代表人	杨文斌	联系人	张茹
电话	021-20613999	传真	021-68596916
网址	www.ehowbuy.com	客服电话	4007009665

（18）上海天天基金销售有限责任公司

办公地址	上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼		
注册地址	上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层		
法定代表人	其实	联系人	潘世友
电话	021-54509998	传真	021-64385308
网址	http://www.1234567.com.cn/	客服电话	400-1818-188

（19）杭州数米基金销售有限公司

办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼		
注册地址	杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号		
法定代表人	陈柏青	联系人	张裕
电话	021-60897840	传真	0571-26697013
网址	http://www.fund123.cn/	客服电话	4000-766-123

（20）上海长量基金销售投资顾问有限公司

办公地址	上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层		
注册地址	上海市浦东新区高翔路526号2幢220室		
法定代表人	张跃伟	联系人	单丙烨
电话	021-20691869	传真	021-20691861
网址	www.erichfund.com	客服电话	400-089-1289

（21）深圳腾元基金销售有限公司

办公地址	广东省深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808室		
注册地址	广东省深圳市福田区金田路2028号卓越世纪中心1号楼1806-1808室		
法定代表人	曾革	联系人	鄢萌莎
电话	0755-33376922	传真	0755-33065516
网址	www.tenyuanfund.com	客服电话	4006877899

（22）锦州银行股份有限公司

办公地址	辽宁省锦州市科技路68号		
注册地址	辽宁省锦州市科技路68号		
法定代表人	张伟	联系人	张华阳
电话	0416-3220085	传真	0416-3220003
网址	www.jinzhoubank.com	客服电话	400-6696178

（23）北京展恒基金销售有限公司

办公地址	北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层		
注册地址	北京市顺义区后沙峪镇安富街6号		
法定代表人	闫振杰	联系人	翟飞飞
电话	13520236631	传真	010-62020355
网址	010-62020355	客服电话	4008886661

（24）中信证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	（010）60833722	传真	（010）60833739
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

（25）中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路66号4号楼		
办公地址	北京市朝阳门内大街188号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	（010）65183880	传真	（010）65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

（26）申银万国证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市常熟路171号		
法定代表人	储晓明	联系人	李清怡
电话	（021）54033888	传真	（021）54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	（021）962505

（27）国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路618号		
办公地址	上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼		
法定代表人	万建华	联系人	芮敏祺
电话	（021）38676666	传真	（021）38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

（28）中国银河证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座		
法定代表人	陈有安	联系人	田薇
电话	（010）66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

（29）招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	（0755）82943666	传真	（0755）82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

（30）长城证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
法定代表人	黄耀华	联系人	刘阳
电话	（0755）83516289	传真	（0755）83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、（0755）33680000

（31）国都证券有限责任公司

住所、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		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	（010）84183389	传真	（010）84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

（32）光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	薛峰	联系人	刘晨、李芳芳
电话	（021）22169999	传真	（021）22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788、10108998

（33）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	天津市南开区宾水西道8号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	（022）28451861	传真	（022）28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

（34）平安证券有限责任公司

住所	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼（518048）		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	（0755）82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511—8

（35）财富证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26楼		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	（0731）84403319	传真	（0731）84403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	（0731）84403360

（36）中信证券（山东）有限责任公司

住所、办公地址	青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼		
法定代表人	杨宝林	联系人	吴忠超
电话	（0532）85022326	传真	（0532）85022605
网址	www.citicssd.com	客服电话	95548

（37）中信证券（浙江）有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层		
注册地址	浙江省杭州市解放东路29号迪凯银座22层		
法定代表人	沈强	联系人	王霈霈
电话	0571-85783737	传真	0571-85106383
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	（0571）95548

（38）长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦		
法定代表人	杨泽柱	联系人	李良
电话	（027）65799999	传真	（027）85481900
网址	www.95579.com	客服电话	95579或4008-888-999

（39）山西证券股份有限公司

住所、办公地址	太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	（0351）8686659	传真	（0351）8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

（40）广州证券有限责任公司

住所、办公地址	广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼		
法定代表人	邱三发	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	（020）961303

（41）东吴证券股份有限公司

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路181号		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	（0512）65581136	传真	（0512）65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	4008601555

（42）浙商证券有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼		
法定代表人	吴承根	联系人	许嘉行
电话	（0571）87901912	传真	（0571）87901913
网址	www.stocke.com.cn	客服电话	（0571）967777

（43）东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层		
法定代表人	刘化军	联系人	王一彦
电话	（021）20333910	传真	（021）50498825
网址	www.longone.com.cn	客服电话	95531；400-888-8588

（44）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

（45）新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	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	刘汝军	联系人	孙恺
电话	（010）83561149	传真	（010）83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

（46）上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	郁忠民	联系人	张瑾
电话	（021）53519888	传真	（021）53519888
网址	www.962518.com	客服电话	（021）962518、4008918918

（47）中原证券股份有限公司

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路10号		
法定代表人	菅明军	联系人	程月艳
电话	0371-65585670	传真	0371-65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	0371-967218、4008139666

（48）东莞证券有限责任公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
法定代表人	张运勇	联系人	苏卓仁
电话	（0769）22112062	传真	（0769）22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	（0769）961130

（49）华龙证券有限责任公司

住所、办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路638号财富中心		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	（0931）4890208	传真	（0931）4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	（0931）96668、4006898888

（50）国金证券股份有限公司

住所、办公地址	成都市东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	（028）86690126	传真	（028）86690126
网址	www.gjzq.com.cn	客服电话	4006600109

（51）齐鲁证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市市中区经七路86号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	（0531）68889155	传真	（0531）68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

（52）大同证券经纪有限责任公司

住所	大同市城区迎宾街15号桐城中央21层		
办公地址	山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	（0351）4130322	传真	（0351）4130322
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

（53）瑞银证券有限责任公司

住所、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层、15层		
法定代表人	程宜荪	联系人	牟冲
电话	（010）58328112	传真	（010）58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

（54）中山证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	（0755）82570586	传真	（0755）82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

（55）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	廉赵峰
电话	（010）65051166	传真	（010）85679535
网址	www.cicc.com.cn	客服电话	（010）85679238；（010）85679169

（56）天相投资顾问有限公司

办公地址	北京市西城区新街口外大街28号C座5层　邮编：100088		
注册地址	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701　邮编：100032		
法定代表人	林义相	联系人	尹伶
电话	010-66045529	传真	010-66045518
网址	http://www.jjm.com.cn　http://www.txsec.com	客服电话	010-66045678

（57）江海证券有限公司

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
注册地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	刘爽
电话	0451-85863719	传真	0451-82287211
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

（58）中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层		
法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	（010）59355941	传真	（010）66553791
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

（59）厦门证券有限公司

住所、办公地址	厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼		
法定代表人	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	（0592）5161642	传真	（0592）5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	（0592）5163588

（60）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

（61）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

（62）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

（二）基金登记机构

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	上海源泰律师事务所		
住所、办公地址	中国上海浦东南路256号华夏银行大厦14层		
负责人	廖海	联系人	张兰
电话	（021）51150298	传真	（021）51150398
经办律师	刘佳、张兰		

（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：嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。本基金为混合型发起式证券投资基金。

六、基金的投资目标

在控制基金股票市场系统性风险暴露的前提下，利用各种金融工具力争为投资人实现较高的投资收益。

七、基金的投资范围

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、股指期货、权证、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）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等）、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，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）。

本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中，权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及持有的其他可投资的权益类多头工具价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的95%。封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的100%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。在封闭期内，本基金不受上述5%的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

待基金参与融资融券和转融通业务及投资其他品种（包括但不限于：其他基金份额、期权、收益互换等）的相关规定颁布后，基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务，转融通业务及投资其他品种，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通业务及投资其他品种的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事宜按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

八、基金的投资策略

本基金采用"多空"（long-short）投资策略，在控制基金资产的股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。多头股票部分主要采用基本面分析的方式进行筛选，空头部分以被动对冲（passive hedging）方式构建，首要目标为剥离多头股票部分的系统性风险。根据宏观策略部提供的宏观数据预测及相关研究分析建议并结合公司投资决策委员会有关大类资产配置的安排，本基金可以适时主动调整多头股票系统性风险敞口。

1、股票投资策略

本基金通过系统地分析中国证券市场的特点和运作规律，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，精选具备基本面健康、核心竞争力强、成长潜力好的股票，构建本基金的现货组合。

深入的基本面研究和分析是挖掘优质股票的核心，本基金将通过定量和定性相结合的方法精选个股。主要需要考虑的方面包括上市公司治理结构、核心竞争优势、行业地位、市场占有率、成长性、盈利能力、运营效率、财务结构、现金流情况以及公司基本面变化等，并对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司构建多头组合。

2、对冲策略

现阶段本基金将利用股指期货剥离多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化，现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在各个月份期货合约之间进行动态配置，通过空头部分的优化创造额外收益。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险对冲方式。

3、套利策略

本基金主要采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，捕捉绝对收益机会。同时，本基金根据市场情况的变化，灵活运用其他对冲套利策略（如统计套利策略、定向增发套利策略、大宗交易套利策略、并购套利策略等）策略提高资本的利用率，从而提高绝对收益，达到投资策略的多元化以进一步降低本基金收益的波动。

（1）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

① 期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

② 跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉合约间价差进而获利。

（2）其他套利策略

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他套利策略。

4、其他投资策略

（1）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。

（2）中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

（3）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，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率

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，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，且无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金，通过多空投资策略在控制基金股票系统性风险暴露的前提下，实现基金资产的保值增值。因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于多空策略投资结果的不确定性，因此收益不一定能超过业绩比较基准。

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10月21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2014年9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	1,396,742,552.11	71.89
	其中：股票	1,396,742,552.11	71.89
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
3	贵金属投资	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
5	买入返售金融资产	100,000,000.00	5.15
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	银行存款和结算备付金合计	307,047,228.61	15.80
7	其他资产	139,180,345.91	7.16
	合计	1,942,970,126.63	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	15,480,420.00	0.84
B	采矿业	36,987,751.20	2.00
C	制造业	570,072,985.70	30.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,115,427.86	1.69
E	建筑业	31,054,606.00	1.68
F	批发和零售业	43,963,232.16	2.38
G	交通运输、仓储和邮政业	46,023,659.24	2.49
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,002,516.28	3.20
J	金融业	436,730,801.03	23.67
K	房地产业	87,404,537.16	4.74
L	租赁和商务服务业	14,551,263.48	0.79
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	22,987,725.00	1.25
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	1,367,627.00	0.07
Q	卫生和社会工作	–	–
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,396,742,552.11	75.70

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	000001	平安银行	5,420,980	54,968,737.20	2.98
2	601166	兴业银行	5,234,728	53,498,920.16	2.90
3	601288	农业银行	20,993,593	52,274,046.57	2.83
4	600030	中信证券	3,826,066	50,963,199.12	2.76
5	601318	中国平安	1,190,696	49,223,372.64	2.67
6	601328	交通银行	10,545,726	45,241,164.54	2.45
7	000333	美的集团	1,886,790	37,528,253.10	2.03
8	601998	中信银行	6,390,137	29,011,221.98	1.57
9	601601	中国太保	1,492,065	28,960,981.65	1.57
10	000625	长安汽车	1,945,199	26,649,226.30	1.44

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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债券投资明细

报告期末，本基金未持有债券。

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

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IF1410	沪深300股指期货IF1410合约	-1,728	-1,272,257,280.00	-9,963,297.82	–
IF1412	沪深300股指期货IF1412合约	-160	-118,425,600.00	-12,916,464.00	–
公允价值变动总额合计（元）					-22,879,761.82
股指期货投资本期收益（元）					-124,444,220.18
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-24,453,939.82

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金主要利用股指期货的套期保值功能来剥离多头股票部分的系统性风险，同时采用股指期货套利的对冲策略寻找和发现市场中资产定价的偏差，如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系进行套利，以获取绝对收益。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

10.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。

11.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	139,068,288.00
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	112,057.91
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
	合计	139,180,345.91

（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，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

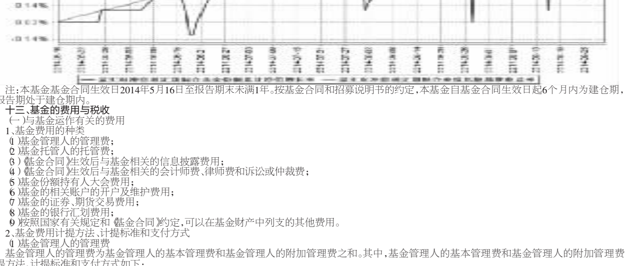
1.本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
2014年5月16日（合同生效日）至2014年9月30日	0.80%	0.21%	1.12%	0.01%	-0.32%	0.20%

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：嘉实对冲套利定期混合基金累计份额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

（2014年5月16日至2014年9月30日）



注：本基金基金合同生效日2014年5月16日至报告期末未满1年。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，本报告期处于建仓期内。

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费、律师费和诉讼或仲裁费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的相关账户的开户及维护费用；

（7）基金的证券、期货交易费用；

（8）基金的银行汇划费用；

（9）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

基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：

1）基金管理人的基本管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1%÷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

基金基本管理费每日计算，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。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。

2）基金管理人的附加管理费

A.基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

①符合基金收益分配条件

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照"新高法原则"提取超额收益的10%作为附加管理费；即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。

提取评价日：每次基金封闭期的最后一个工作日

B.附加管理费的计算方法和提取

在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为

附加管理费=

其中：

P_A为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值

P_A= 提取评价日基金份额净值×

P_B为以往提取评价日的最高基金份额累计净值，以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者，其中首次封闭期的P_B为1

S_A为提取评价日的基金份额=提取评价日基金总份额×提取评价日的折算因子

特定日期的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积

折算系数=基金折算日除权前基金份额净值÷基金折算日除权后基金份额净值

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。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。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。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，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。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。

（3）证券账户开户费用

证券账户开户费经基金管理人与托管人核对无误后，自产品成立一个月内由托管人从基金财产中划付，如资产余额不足支付该开户费用，由管理人于产品成立一个月后的5个工作日内进行垫付，托管人不承担垫付开户费用义务。

上述"1、基金费用的种类中第3－9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。

（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<1000万元	1.3%
M≥1000万元	按笔收取，单笔1000元

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；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统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%，优惠后费率如果低于0.6%，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。

注：2014年9月2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2014年9月5日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统（含电话交易）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，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T）	基金网上直销后端申购优惠费率
0年	0.20%
1年≤T<3年	0.10%
T≥3年	0.00%

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。

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。

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。对持续持有期少于30天的投资者收取1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于30天少于90天的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期大于等于90天少于180天的投资人收取0.5%的赎回费，并将赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期大于等于180天少于365天的投资人收取0.5%的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产；对持续持有期大于等于365天少于730天的投资人收取0.25%的赎回费，将赎回费总额的25%计入基金财产。本基金基金份额的赎回费率具体如下：

持有期限（H）	赎回费率
H<30天	1.50%
30天≤H<365天	0.50%
365天≤H<730天	0.25%
H≥730天	0

基金管理人可以在法律法规和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、基金赎回费率。

3、转换费

投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回和转换，开放日为开放期内的每个工作日。2014年11月14日（含该日）至2014年11月20日（含该日）为本基金第二个开放期。

本次公告的转换业务仅适用于本基金与本公司旗下的嘉实研究精选股票、嘉实主题混合、嘉实泰和混合、嘉实周期优选股票、嘉实中证500ETF联接、嘉实信用债券A之间的转换业务。

（1）通过代销机构办理基金转换业务（仅限"前端转前端"的模式）

1）本基金与嘉实研究精选股票、嘉实主题混合、嘉实泰和混合、嘉实周期优选股票之间互转，以及转入嘉实中证500ETF联接、嘉实信用债券A时，仅收取转出基金的赎回费，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 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

2）嘉实中证500ETF联接转入本基金时，采用"赎回费+固定补差费率"算法：

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 为对应的固定补差费率：1）当转出金额≥500万元时，固定补差费率为零；2）当转出金额<500万元，并且转出基金的持有期≥90天，则固定补差费率为零；3）当转出金额小于500万元，并且转出基金的持有期 < 90天，则固定补差费率为0.2%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

?

3）嘉实信用债券A转入本基金时，采用"赎回费+固定补差费率"算法：

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 为对应的固定补差费率：1）当转出金额≥500万元时，固定补差费率为零；2）当转出金额 < 500万元，并且转出基金的持有期≥90天，则固定补差费率为零；3）当转出金额小于500万元，并且转出基金的持有期 < 90天，则固定补差费率为0.5%。

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

（2）通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务

1）对于"前端转前端"的模式，采用以下规则：

本基金与嘉实研究精选股票、嘉实主题混合、嘉实泰和混合、嘉实周期优选股票、嘉实中证500ETF联接、嘉实信用债券A之间互转时，仅收取转出基金的赎回费，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 为转出基金的对应赎回费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

2）对于"后端转后端"的模式，采用以下规则：

a）若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

b）若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

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、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转换费率。

注：2014年9月4日起，嘉实研究精选股票单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过200万元，单日单个基金账户单笔定投不超过50万元。嘉实对冲套利定期混合为定期开放，在封闭期内无法转换。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

（三）不列入基金费用的项目

1、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；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）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根据基金规模等因素协商一致，酌情调低基金管理费率、基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日2日前在指定媒体刊登公告。

（五）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：增加了本基金合同生效日，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：将本基金基金份额发售公告中"代销机构"以及发售公告披露日起至2014年12月15日止新增的代销机构，列示在本招募说明书，并更新相关代销机构信息。

5.在"八、基金份额的封闭期、开放期、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；增加了对基金管理人基金网上直销系统（含电话交易）开通旗下部分基金产品的后端收费模式的说明。

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.增加"十三、基金的业绩"：基金业绩更新至2014年9月30日。

9.在"二十六、其他应披露事项"部分：列示了本基金自2014年4月15日首次披露本基金招募说明书至2014年11月16日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2014年12月30日

关于调整农行金穗卡持有人通过嘉实基金网上直销申购费率的公告

本公司决定自2014年12月31日15:00以后，对中国农业银行金穗卡持有人通过嘉实基金网上直销系统申购嘉实旗下开放式基金的费率进行调整。有关事项公告如下：

（一）正常申购（非定期定额投资业务）调整后的费率标准

嘉实基金旗下所有非零申购费率开放式基金的正常申购费率按申购金额分档，优惠为相应基金招募说明书及其临时公告规定的申购费率的70%，优惠后申购费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。基金招募说明书及其临时公告中规定的相应申购费率低于0.6%时，则执行相应公告的申购费率。

（二）提示

本次调整不涉及汇款交易，投资者申请使用嘉实基金网上直销交易业务前，应认真阅读有关网上交易协议、相关规则，了解网上交易的固有风险，慎重选择，并妥善保管好网上交易信息，特别是账号和密码。

投资者可通过嘉实基金管理有限公司客户服务电话：400-600-8800（免长途话费），登录网站www.jsfund.cn或嘉实基金网上交易频道https://trade.jsfund.cn咨询、了解有关详情。

嘉实基金管理有限公司

2014年12月30日

嘉实基金管理有限公司关于元旦期间暂停交易的公告

为了给广大投资者提供更好的体验，嘉实基金直销系统将于2015年1月2日04:00至2015年1月3日02:00进行全面升级，届时嘉实网上交易、理财嘉APP、微信交易、易信交易、电话交易等平台将暂停服务。系统升级期间嘉实客服热线400-600-8800、在线客服以及微信客服也将暂停服务。

在此温馨提示您：

1、如果您在系统升级期间有资金使用的需求：您可以在2015年1月1日21:00前，通过快速取现功能取出资金到您的银行卡上，用于应对不时之需；

2、如果您在系统升级期间有信用卡还款的需求：您可以在2015年1月1日21:00前，通过理财嘉APP提前给您的信用卡还款。

2015年1月3日02:00起，上述各平台（含嘉实客服）将恢复服务。由此给您带来的不便，敬请谅解。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司

2014年12月30日

关于嘉实泰和混合基金经理变更的公告

公告送出日期：2014年12月30日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实泰和混合型证券投资基金
基金简称	嘉实泰和混合
基金主代码	000595
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等
基金经理变更类型	解聘基金经理
共同管理本基金的其他基金经理姓名	王汉博
离任基金经理姓名	张弢

2 离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	张弢
离任原因	公司业务调整
离任日期	2014-12-30
是否转任本公司其他工作岗位	–
是否已按规定在中国基金业协会办理变更手续	是