关于嘉实沪深300指数研究增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告

公告送出日期：2015年2月16日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实沪深300指数研究增强型证券投资基金
基金简称	嘉实沪深300指数研究增强
基金主代码	000176
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2014年12月 26日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司
基金注册登记机构名称	嘉实基金管理有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及 《嘉实沪深300指数研究增强型证券投资基金基金合同》、《嘉实沪深300指数研究增强型证券投资基金招募说明书》
申购起始日	2015年2月26日
赎回起始日	2015年2月26日
转换转入起始日	2015年2月26日
转换转出起始日	2015年2月26日
定期定额投资起始日	2015年2月26日

注：投资者范围：符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构

投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

2日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的办理时间

本基金自2015年2月26日开始办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的，视为下一开放日的申购、赎回或转换申请。

3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币5,000元，投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币20,000元；追加申购单笔最低限额为人民币1,000元。

投资者将当期分配的基金收益转购基金份额或采用定期定额投资计划时，不受最低申购金额的限制。

投资者可多次申购，对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。

3.2 申购费率

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<100万元	1.0%
100万元≤M<200万元	0.6%
200万元≤M<500万元	0.2%
M≥500万元	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、中国农业银行借记卡持卡人，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%，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。

3.3 其他与申购相关的事项

（1）本基金份额的申购费在投资者申购基金份额时收取。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。

（2）本基金份额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。

（3）基金管理人可以根据市场情况，调整对申购金额的数量限制，基金管理人必须于调整前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

（4）基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人必须于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

注：2013年4月9日，本公司发布了《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31只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。现根据业务发展，自2015年2月26日起，增加开通本基金的后端收费模式。投资者选择后端收费模式的基金，其申购、赎回、转换等费率及费率优惠和业务规则，执行2013年4月9日本公司发布的《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》。

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≤T<1年	0.20%
1年≤T<3年	0.10%
T≥3年	0.00%

4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

单笔赎回不得少于1,000份（如该帐户在该销售机构托管的基金余额不足1,000份，则必须一次性赎回基金全部份额）；若某笔赎回将导致投资者在销售机构托管的基金余额不足1,000份时，基金管理人有权将投资者在该销售机构托管的剩余基金份额一次性全部赎回。

4.2 赎回费率

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。

持有期限（H）	赎回费率
H<7天	1.5%
7天≤H<30天	0.75%
30天≤H<365天	0.5%
365天≤H<730天	0.25%
H≥730天	0

4.3 其他与赎回相关的事项

（1）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7日的投资人收取1.5%的赎回费，对持续持有期大于等于7天少于30日的投资人收取0.75%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。

（2）基金管理人可以根据市场情况，调整对赎回份额的数量限制，基金管理人必须于调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。

（3）基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人必须于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在中国证监会指定的媒体上刊登公告。

5 转换业务

5.1 转换费率

（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）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转换为嘉实沪深300指数研究增强时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

净转入金额=（B×C）/（1+F）+M

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；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F为转入基金适用的申购费率；

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）嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券转换为嘉实沪深300指数研究增强时，采用“赎回费+申购费率”算法：

净转入金额＝ B×C×(1－D)/（1+F）

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；

F为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

3）嘉实沪深300指数研究增强与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选、嘉实优化红利、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合互转时，以及转入嘉实货币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、嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实稳固收益债券、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实中创400联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接时，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。

4）嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接转入嘉实沪深300指数研究增强时，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。

5）嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实信用债券A、嘉实纯债债券A转入嘉实沪深300指数研究增强时，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（“前端转前端”的模式）

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转换为嘉实沪深300指数研究增强时，收取转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

净转入金额=（B×C）/（1+F）+M

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；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值；

F为转入基金适用的申购费率；

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）嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券转换为嘉实沪深300指数研究增强时，采用“赎回费+申购费率”算法：

净转入金额＝ B×C×(1－D)/（1+F）

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；

F为转入基金适用的申购费率；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

3）嘉实沪深300指数研究增强与嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、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、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实量化阿尔法股票、嘉实多元债券A、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实主题新动力股票、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A、嘉实中证500ETF联接、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合互转，以及转入嘉实货币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、嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券时，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。

（3）通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式），采用以下规则：

1）若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

2）若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

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法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

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。

注：自2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务；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，嘉实安心货币在代销机构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5月23日起，嘉实超短债债券单日单个基金账户累计申购（或转入）不超过500万元；2014年11月13日起，嘉实纯债债券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12月11日起，嘉实研究精选股票单日单个基金账户笔定投不超过200万元；2015年2月10日起，嘉实研究精选股票暂停申购（含转入）业务。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

5.2 其他与转换相关的事项

（1）基金转换的时间：投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日，方可办理基金转换业务。

（2）基金转换的原则：

①采用份额转换原则，即基金转换以份额申请；

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销，在当日的交易时间结束后不得撤销；

③基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算；

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行，转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金；

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则，但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

（3）基金转换的程序

①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续，在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时，帐户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日（T日），并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后查询成交情况。

（4）基金转换的数额限制

基金转换时，由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时，最低转出份额为1000份基金份额。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的有关限制并及时公告。

（5）基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后，基金注册登记机构在T＋1日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下，投资者自T＋2日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内，对上述注册登记办理时间进行调整，并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒体公告。

（6）基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时，本基金转出与基金赎回具有相同的优先级，基金管理人可根据基金资产组合情况，决定全额转出或部分转出，并且对于本基金转出和基金赎回，将采取相同的比例确认；但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下，对未确认的转换申请将不予顺延。

（7）拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①除非出现如下情形，基金管理人不得暂停或拒绝基金投资者的转入申请：

（a）因不可抗力导致基金无法正常运作；

（b）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

（c）发生本基金合同规定的暂停基金资产估值情况；

（d）基金管理人认为接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。。

（e）基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或其他可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人利益的情况；

（f）基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术保障等异常情况导致基金销售系统或基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。

（g）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资人转出申请或者延缓支付转出款项：

（a）因不可抗力的原因导致基金管理人不能支付转出款项；

（b）发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时，基金管理人可暂停接受投资人的转出申请或延缓支付转出款项；

（c）证券交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

（d）连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回；

（f）法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

③如发生基金合同、《招募说明书》或本公告中未予载明的事项，但基金管理人有正当理由认为需要暂停接受基金转换申请的，应当报经中国证监会批准后在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

投资者到本基金代销机构的销售网点办理本基金转换业务时，其相关具体办理规定以各代销机构的规定为准。

6 定期定额投资业务

6.1 定投费率

（1）代销机构定投费率

各家代销机构的具体定期定额申购费率，执行本基金招募说明书及相关公告有关申购费率的规定。其中，下列代销机构开办本基金定投业务实行申购费率优惠，具体费率优惠措施及业务规则执行相应代销机构的规定：中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海天天基金销售有限责任公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、北京展恒基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、华鑫证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司。

（2）嘉实基金直销网上办理本基金定投费率优惠

个人投资者通过嘉实基金直销网上交易办理本基金定投业务，实行费率优惠：

本基金申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但招商银行借记卡、中国银行借记卡持卡人的具体定期定额申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行。

本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。

通过嘉实基金直销网上交易办理本基金定投业务，每月固定扣款金额起点为500元以上（含500元）。

6.2 通过代销机构办理本基金定投业务

以下代销机构开办本基金的定期定额投资业务，各家代销机构的每月固定扣款金额起点及其金额级差要求如下：

序号	代销名称	定投起点@金额	金额级差要求（超过每月固定扣款金额起点的部分，元）
1	中国银行	100	无
2	中国建设银行	100	无
3	交通银行	100	无
4	招商银行	300	无
5	上海浦东发展银行	300	无
6	平安银行	100	无
7	北京农村商业银行	200	无
8	洛阳银行	100	无
9	乌鲁木齐市商业银行	100	无
10	哈尔滨银行	200	无
11	东莞农村商业银行	100	无
12	苏州银行	100	无
13	锦州银行	100	无
14	重庆农商行	100	无
15	好买基金	200	无
16	万银财富	100	无
17	数米基金	100	无
18	上海天天基金	100	无
19	上海长量	100	无
20	和讯信息科技	200	无
21	展恒基金	100	无
22	众禄基金	100	无
23	国都证券?	100	无
24	光大证券	100	无
25	长城证券	300	无
26	华鑫证券	100	无
27	华宝证券	100	无
28	宏信证券	100	无

7基金销售机构

7.1直销机构

（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单元		
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	陈寒梦		

（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	胡洪峰		

（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	周炜		

（10）嘉实基金直销网上交易和电话交易服务

投资者可登录本基金管理人网站，通过直销网上交易办理认购/申购、赎回、转换、定期定额申购、定期定额赎回、定期定额转换、查询等业务。网上交易投资者开通电话交易后可以通过电话交易赎回、转换所持基金份额，持工行借记卡、建行龙卡储蓄卡、农行金穗卡、广发银行理财通卡、招行借记卡、中国民生银行借记卡、浦发银行东方卡，可以通过电话交易系统购买基金。具体参见相关公告。

7.2 场外非直销机构

中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、乌鲁木齐商业银行股份有限公司、洛阳银行股份有限公司、北京农村商业银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、锦州银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、嘉实财富管理有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海天天基金销售有限责任公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、北京展恒基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、华鑫证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司。

7.3其他与基金销售机构相关的事项

（1）开通本基金转换业务的代销机构包括：中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、乌鲁木齐商业银行股份有限公司、洛阳银行股份有限公司、北京农村商业银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、东莞农村商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、锦州银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、嘉实财富管理有限公司、万银财富（北京）基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海天天基金销售有限责任公司、杭州数米基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、宏信证券有限责任公司、北京展恒基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、长城证券有限责任公司、国都证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华宝证券有限责任公司。

（2）各代销网点的地址、营业时间等信息，请参照各代销机构的规定。

（3）基金管理人可以根据情况增加或者减少代销机构，并另行公告。销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。敬请投资者留意。

8.基金份额净值公告的披露安排

在开始办理基金份额申购或赎回后，基金管理人将在基金每个开放日的次日，通过网站、基金份额发售网点以及其他媒介，披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值，敬请投资者留意。

9. 其他需要提示的事项

（1）嘉实沪深300指数研究增强型证券投资基金为契约型、开放式证券投资基金，基金管理人为嘉实基金管理有限公司，注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

（2）本公告仅对本基金的开放申购、赎回业务及转换、定期定额投资业务事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况，请认真阅读2014年12月1日刊登在《中国证券报》上的“嘉实沪深300指数研究增强型证券投资基金招募说明书”，亦可登陆本公司网站（www.jsfund.cn）进行查询。

（3）投资者T日提交的有效申请，在正常情况下，基金注册登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。投资者应在T+2日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。否则，如因申请未得到基金管理人或注册登记机构的确认而造成的损失，由投资者自行承担。基金销售机构对申购申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购与赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

（4）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。敬请投资者留意投资风险。

嘉实基金管理有限公司

2015年2月16日

（上接A18版）

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	121,814,061.25	90.27
	其中：股票	121,814,061.25	90.27
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	-	-
	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	12,805,029.04	9.49
7	其他资产	331,765.13	0.25
8	合计	134,950,855.42	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,919,413.98	23.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,127,840.10	5.47
E	建筑业	13,189,191.08	10.13
F	批发和零售业	5,124,819.39	3.94
G	交通运输、仓储和邮政业	6,128,173.15	4.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,679,915.82	9.74
J	金融业	18,124,097.00	13.92
K	房地产业	26,267,170.09	20.17
L	租赁和商务服务业	2,253,440.64	1.73
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	121,814,061.25	93.54

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	601318	中国平安	160,700	12,005,897.00	9.22
2	600340	华夏幸福	262,802	11,458,167.20	8.80
3	002285	世联行	635,216	9,553,648.64	7.34
4	300043	互动娱乐	586,581	7,701,808.53	5.91
5	000090	天健集团	513,592	7,087,569.60	5.44
6	600674	川投能源	308,370	6,392,510.10	4.91
7	002415	海康威视	279,885	6,261,027.45	4.81
8	601166	兴业银行	370,800	6,118,200.00	4.70
9	002051	中工国际	223,339	6,101,621.48	4.69
10	300020	银江股份	221,236	6,099,476.52	4.68

4、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

9、 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，以套期保值为目的，制定相应的投资策略。

时点选择：基金管理人在交易股指期货时，重点关注当前经济状况、政策倾向、资金流向、和技术指标等因素。

套保比例：基金管理人根据对指数点位区间判断，在符合法律法规的前提下，决定套保比例。再根据基金股票投资组合的贝塔值，具体得出参与股指期货交易的买卖张数。

合约选择：基金管理人根据股指期货当时的成交金额、持仓量和基差等数据，选择和基金组合相关性高的股指期货合约为交易标的。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同约定，本基金投资范围不包括国债期货。

10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.投资组合报告附注

11.1

1、中国平安保险（集团）股份有限公司（下称“中国平安”，股票代码：601318）控股子公司平安证券因其推荐海联讯IPO的过程中，出具的保荐书存在虚假记载以及未审慎审查海联讯公开发行募集文件的真实性和准确性，于2014年12月8日收到《中国证监会行政处罚决定书》。该处罚决定书对平安证券给予警告，没收保荐业务收入400万元，没收承销股票违法所得2867万元，并处以440万元罚款。

本基金投研人员认为：中国平安子公司平安证券受到行政处罚，体现出其原有业务流程存在一定的瑕疵。但是经过内部整改，我们预计其流程管理已经有所完善。而且中国平安作为综合金融的上市公司，其子公司平安证券只是其中一个业务板块，对整个上市公司的经营影响有限，并不影响对中国平安具备投资价值的判断。

本基金经理依据基金合同及公司投资管理制度，在投资授权范围内，经正常投资决策程序对中国平安进行了投资。

2、其余九名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	182,198.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,472.27
5	应收申购款	147,094.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	331,765.13

11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

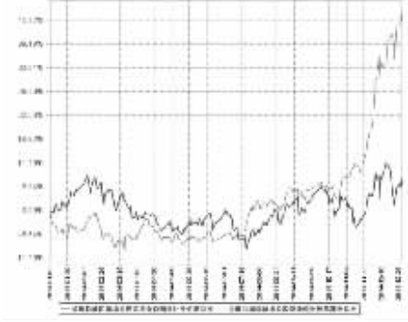
十二、基金的业绩

基金管理人承诺以诚实信用、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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2014年12月31日。

1. 净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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1月2日－2014年6月30日	-0.80%	1.03%	-5.82%	0.93%	5.02%	0.10%
2014年1月2日－2014年12月31日	7.80%	1.22%	47.21%	1.09%	-39.41%	0.13%

2. 自基金合同生效以来基金累计份额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



注：本基金的投资组合比例为：本基金将基金资产的80%-95%投资于股票资产，其中投资于质地优秀、未来预期成长性良好的上市公司股票不低于非现金基金资产的80%，权证投资比例不超过基金资产净值的3%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的建仓期为自2014年1月2日基金合同生效日起6个月。建仓期结束时，本基金投资组合均达到上述投资组合比例的要求。基金合同生效日（2014年1月2日