（上接B65版）

（99）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

（100）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

（101）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

（102）华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021)68777222	传真	(021)68777822
网址	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

（103）长城国瑞证券有限公司

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	王勇	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

（104）发建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道1600号32楼		
法定代表人	宫龙云	联系人	陈敏
电话	(021)32229888	传真	(021-68728782
网址	www.ajzq.com	客服电话	(021)63340678

（105）英大证券有限责任公司

住所	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
注册地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	吴骏	联系人	吴尔晖
电话	0755-83007159	传真	0755-83007034
网址	www.ydsc.com.cn	客服电话	4000-188-688

（106）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

（107）大风证券股份有限公司

办公地址	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼		
注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼		
法定代表人	余磊	联系人	崔成
电话	027-87610052	传真	027-87618863
网址	www.tfzq.com	客服电话	4008005000

（108）宏信证券有限责任公司

办公地址	四川成都市人民南路2段18号川信大厦10楼		
注册地址	四川成都市人民南路2段18号川信大厦11楼		
法定代表人	吴玉明	联系人	刘进海
电话	028-86199278	传真	028-86199382
网址	www.hxzq.cn	客服电话	4008366366

（109）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	陶钟伟
传真	010-66107914		
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

（110）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

（111）上海华信证券有限责任公司

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.shhxzq.com	客服电话	68777877

（112）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	孔佑杰	联系人	冯杰
电话	(010)83991743	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn	客服电话	4006609839

（二）注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所、办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	朱立元
电话	(010)59378839	传真	(010)59378907

（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：嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）

五、基金的类型

本基金类型：契约型上市开放式

六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，以实现对沪深300指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

七、基金的投资方向

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。 此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、以及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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后，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在控制风险的前提下，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时本基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、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项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

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

1、资产配置比例

本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、组合构建

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。本基金还将适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，以增强基金收益。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

3、风险收益目标

本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资，在日常管理过程中，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，以实现对标的指数的有效跟踪，分享中国股票市场的长期收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金以沪深300指数为标的指数。业绩衡量基准为95%的沪深300指数增长率加5%的银行活期存款税后利率。

本基金管理人在基金管理期间有权更换标的指数和业绩衡量基准，标的指数和业绩衡量基准的更换将提前3个月在指定媒体上公告。

十、基金的风险收益特征

风险中等，获得证券市场平均收益率。

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原基金合同规定，于2015年7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2015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	692,957,324.93	2.96
	其中：股票	692,957,324.93	2.96
2	基金投资	20,657,631,424.54	88.12
3	固定收益投资	603,211,858.50	2.57
	其中：债券	603,211,858.50	2.57
	资产支持证券	–	–
4	贵金属投资	–	–
5	金融衍生品投资	–	–
6	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	818,520,791.05	3.49
8	其他资产	670,925,322.87	2.86
	合计	23,443,246,721.89	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	1,732,354.00	0.01
B	采矿业	30,291,906.16	0.13
C	制造业	232,961,411.47	1.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,010,437.50	0.12
E	建筑业	32,408,436.18	0.14
F	批发和零售业	13,344,575.29	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	26,101,797.10	0.12
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,933,007.93	0.19
J	金融业	233,554,365.87	1.03
K	房地产业	25,864,429.38	0.11
L	租赁和商务服务业	6,798,463.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	20,290.00	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	5,665,270.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	–	–
P	教育	–	–
Q	卫生和社会工作	729,076.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	10,773,370.25	0.05
S	综合	3,768,134.80	0.02
	合计	692,957,324.93	3.06

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	315,300	25,835,682.00	0.11
2	600036	招商银行	960,200	17,974,944.00	0.08
3	600016	民生银行	1,805,575	17,947,415.50	0.08
4	601398	工商银行	2,587,100	13,659,888.00	0.06
5	600030	中信证券	457,600	12,314,016.00	0.05
6	600000	浦发银行	712,400	12,082,304.00	0.05
7	601166	兴业银行	664,800	11,467,800.00	0.05
8	600837	海通证券	470,600	10,259,080.00	0.05
9	601766	中国中车	523,300	9,607,788.00	0.04
10	601328	交通银行	1,141,700	9,407,608.00	0.04

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	603,161,000.00	2.66
	其中：政策性金融债	603,161,000.00	2.66
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	50,858.50	0.00
8	其他	–	–
	合计	603,211,858.50	2.66

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

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	130202	13国开02	2,000,000	201,180,000.00	0.89
2	120246	12国开46	2,000,000	201,020,000.00	0.89
3	150202	15国开02	1,300,000	130,702,000.00	0.58
4	140357	14进出57	700,000	70,259,000.00	0.31
5	110031	航信转债	350	50,858.50	0.00

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.期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实沪深300ETF	股票型	交易型开放式	嘉实基金管理有限公司	20,657,631,424.54	91.16

10.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
IF1507	沪深300股指期货IF1507合约	116	152,312,640.00	5,090,940.00	–
公允价值变动总额合计(元)					5,090,940.00
股指期货投资本期收益(元)					–
股指期货投资本期公允价值变动(元)					5,090,940.00

(2)本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低ETF及股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

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。

11.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。

12.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	23,366,833.75
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	12,816,032.83
5	应收申购款	628,191,791.80
6	其他应收款	6,550,664.49
7	待摊费用	–
8	其他	–
	合计	670,925,322.87

(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在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不在流通受限情况。

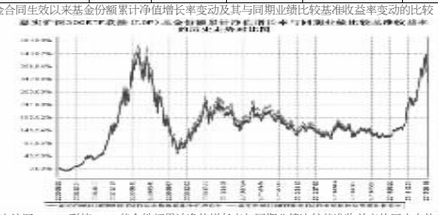
十二、基金的业绩

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。

（一）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
2005年8月29日基金合同生效日至2005年12月31日	-1.90%	0.82%	-0.48%	0.89%	-1.42%	-0.07%
2006年年度	120.19%	1.32%	112.79%	1.33%	7.40%	-0.01%
2007年年度	130.32%	2.18%	150.20%	2.18%	-19.88%	0.00%
2008年年度	-64.36%	2.92%	-63.85%	2.89%	-0.51%	0.03%
2009年年度	91.97%	1.95%	90.72%	1.95%	1.25%	0.00%
2010年年度	-11.45%	1.50%	-11.77%	1.50%	0.32%	0.00%
2011年年度	-22.95%	1.23%	-23.82%	1.23%	0.87%	0.00%
2012年年度	8.81%	1.21%	7.30%	1.22%	1.51%	-0.01%
2013年年度	-5.16%	1.32%	-7.16%	1.32%	2.00%	0.00%
2014年年度	51.12%	1.14%	48.69%	1.15%	2.43%	-0.01%
2015年1月1日至2015年6月30日	25.06%	2.14%	25.29%	2.15%	-0.23%	-0.01%

（二）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：嘉实沪深300ETF联接(LOF)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

（2005年8月29日至2015年6月30日）

注：根据2012年8月21日中国证监会《关于核准嘉实沪深300指数证券投资基金（LOF）基金份额持有人大会决议的批复》（证监许可[2012]1146号），变更了投资范围并更名为嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）。本基金自2012年8月21日起 3个月内为建仓期（原持有的沪深300指数成份股、备选成份股调整为嘉实沪深300ETF），建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条（（二）投资范围和（七）投资禁止行为与限制）的规定；（1）基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；（2）本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内），持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。（3）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

十三、基金的费用与税收

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）证券交易费用；

（4）基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券交易费用；

（7）基金的银行汇划费用；

（8）证券账户开户费用、银行账户维护费用；

（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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×0.7%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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。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3个工作日内从基金资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。

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。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

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。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费率

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、登记等各项费用，不列入基金财产。

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。

养老金客户包括全国社会保障基金、地方社会保障基金（若法规允许）、企业年金单一计划及集合计划、企业年金养老金产品等。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	0.32%
100万元≤M<300万元	0.24%
300万元≤M<1000万元	0.16%
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	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<1000万元	0.40%
M≥1000万元	按笔收取，1000元/笔

2、赎回费率

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，对于所收取的基金份额赎回费，基金管理人将其总额的100%计入基金财产。

本基金基金份额的赎回费率如下：

持有期限(H)	赎回费率
H<30天	0.75%
H≥30天	0

3、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。

4、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。

5、转换费

2015年9月28日（含该日）至2015年10月16日（含该日）为本基金第二个开放期。

（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）及通过直销（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、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C转换为嘉实丰益信用定期债券A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；

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。

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、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B或嘉实机构快线货币C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丰益信用定期债券A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；

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（嘉实中证中期企业债指数（LOF）C除外）；根据嘉实中证中期企业债指数证券投资基金（LOF）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。

（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、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C转换为嘉实沪深300ETF联接(LOF)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；

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；

M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C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丰益信用定期债券A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；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

3）嘉实沪深300ETF联接(LOF)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、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实多元债券A、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券A、嘉实中证500ETF联接、嘉实信用债券A、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、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实新消费股票、嘉实事件驱动股票、嘉实低价策略股票时，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。

7）嘉实丰益信用定期债券A转入嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实优化红利混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实泰和混合、嘉实沪深300指数增强、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实先进制造股票、嘉实新消费股票、嘉实事件驱动股票、嘉实低价策略股票时，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：

i 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、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B、嘉实机构快线货币C转换为嘉实丰益信用定期债券A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；

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；

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、嘉实安心货币B、嘉实机构快线货币A、嘉实机构快线货币B或嘉实机构快线货币C全部转出时账户当前累计未付收益。

通过网上直销办理转换业务的，转入基金适用的申购费率比照该基金网上直销相应优惠费率执行。

注1：嘉实货币A、嘉实货币B、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；2015年7月9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500万元；自2015年7月22日起，嘉实安心货币单日单个基金账户的累计申购（含转入及定投）金额不得超过200万元；嘉实对单笔和定期限定、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益信用定期债券为定期开放，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。

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。2013年9月13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2013年9月17日起，嘉实丰益信用定期债券开通网上直销后端收费模式，并执行上述优惠费率和业务规则。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

（三）其他费用

本基金运作和销售过程中发生的其他费用，以及因故与本基金有关的其他费用，将依照国家法律法规的规定，予以收取和使用。

（四）本基金运作过程中的各类纳税主体，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；更新了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；更新相关直销机构和代销机构信息。

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；基金业绩更新至2015年6月30日。

7.在“二十五、其他应披露事项”部分；列示了本基金自2015年2月21日至2015年8月21日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2015年9月30日

（上接B66版）

八、基金的投资策略

本基金在控制基金组合风险的基础上，追求实现良好收益率的目标。

1、资产配置策略

在资产配置方面，本基金通过密切关注经济运行趋势，深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，结合各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等方面因素，做出最佳的资产配置，