(上接B51版)

(86)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	李剑阳	联系人	廉越峰
电话	(010)65051166	传真	(010)85679535
网址	www.cicc.com.cn	客服电话	(010)85679238;(010)85679169

(87)中国中投证券有限责任公司

住所	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23单元		
办公地址	深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层		
法定代表人	龙增来	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

(88)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

(89)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.cnhhstock.com	客服电话	4008209898

(90)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

(91)天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

(92)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

(二)基金注册登记机构
嘉实基金管理有限公司(同上)
(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	韩刚	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号金业天地2号楼普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	洪磊
电话	(021)23238888	传真	(021)23238000
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
本基金为契约型开放式,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。
除每次开放期前二个月、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、收益率具好的投资标的时,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
本基金主要采用目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,结合远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。
本基金研究策动,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,遵循固审点性、流动性原则,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:发债企业出现不予分析师预期的情况、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、发债企业生产管理层的重大变化、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,影响同一类个债的违约概率,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,在目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
与高收益债券类似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待分析、行业分散度、组合待分分布、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单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,并依据基金中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	2,629,380.00	0.64
	其中:股票	2,629,380.00	0.64
2	固定收益投资	385,247,046.70	94.47
	其中:债券	385,247,046.70	94.47
	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	5,940,659.06	1.46
7	其他资产	13,989,682.56	3.43
	合计	407,806,768.32	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	2,629,380.00	1.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	2,629,380.00	1.00

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	000729	燕京啤酒	252,825	2,629,380.00	1.00

注:报告期末,本基金仅持有上述1只股票。
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	30,279,000.00	11.57
	其中:政策性金融债	30,279,000.00	11.57
4	企业债券	143,009,514.30	54.64
5	企业短期融资券	20,180,000.00	7.71
6	中期票据	182,674,000.00	69.80
7	可转债	9,104,532.40	3.48
8	其他	-	-
	合计	385,247,046.70	147.20

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	150210	15国开10	300,000	30,279,000.00	11.57
2	124721	14青海创	200,000	21,196,000.00	8.10
3	1182246	11甄桥MTN1	200,000	20,890,000.00	7.98
4	1282535	12正泰MTN1	200,000	20,234,000.00	7.73
5	1282527	12鲁宏桥MTN1	200,000	20,224,000.00	7.73

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
报告期内,本基金未参与股指期货交易。
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	69,514.68
2	应收证券清算款	5,999,705.95
3	应收股利	-
4	应收利息	7,920,461.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	13,989,682.56

(4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113501	洛钼转债	6,481,171.20	2.48
2	113007	吉视转债	2,477,800.00	0.95

(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%
2014年	11.83%	0.15%	11.66%	0.12%	0.17%	0.03%
2015年上半年度	5.73%	0.59%	4.61%	0.09%	1.12%	0.50%

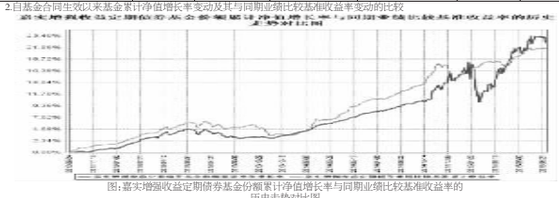
2.自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较


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2015年6月30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(三)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)基金合同生效后的基金信息披露费用;
(4)基金份额持有人大会费用;
(5)基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
(6)基金的证券交易费用;
(7)基金财产按划支付的银行费用;
(8)基金的开户费用、账户维护费用;
(9)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(9)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。
当投资者申购A类基金份额时,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的其他投资者。
通过基金管理人的直销中心申购本基金A类基金份额的养老金客户申购费率见下表:

A类基金份额申购金额(含申购费)	A类基金份额申购费率
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:

A类基金份额申购金额(含申购费)	A类基金份额申购费率
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。
本基金C类基金份额申购费率为0。
个人投资者通过本基金管理人直销网上交易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本基金的申购费率优惠按照其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。个人投资者于本公司网上直销系统通过汇款方式申购本基金的,前端申购费率优惠为0%。
2、赎回费
本基金A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。
本基金基金份额的赎回费率具体如下:

A类基金份额持有期限(H)	A类基金份额赎回费率
H<365天	0.10%
365天≤H<730天	0.05%
H≥730天	0

本基金C类基金份额赎回费为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、销售服务费
本基金A类基金份额不收销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.35%,按前一日C类基金资产净值的0.35%年费率计提。
销售服务费的计算方法如下:
H=E×0.35%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计提,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划出,经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。
4.转换费
2015年9月22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申购、赎回和转换业务的公告》,本基金第三个开放期(即2015年9月24日至2015年10月14日)开通的转换业务安排如下:
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)
(a)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、嘉实机构快钱货币A、嘉实机构快钱货币B、嘉实机构快钱货币C转换为嘉实增强收益定期债券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;
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、嘉实机构快钱货币A、嘉实机构快钱货币B或嘉实机构快钱货币C全部转出时账户当前累计未付收益。
(b)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增强收益定期债券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;
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。
(c)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、嘉实低价策略股票转入嘉实增强收益定期债券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。
(d)嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接转入嘉实增强收益定期债券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。
(e)嘉实增强收益定期债券A与嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实信用债券A、嘉实纯债债券A之间互转,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、嘉实机构快钱货币A、嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C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。
(f)嘉实增强收益定期债券A转入嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接时,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;
E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。
(g)嘉实增强收益定期债券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0.2%。
E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。
(h)嘉实增强收益定期债券A与嘉实债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实机构快钱货币A、嘉实机构快钱货币B或嘉实机构快钱货币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比惠费率执行。
(ii)嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)C转换为嘉实增强收益定期债券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;
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。
(iii)嘉实增强收益定期债券A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、嘉实信用债券A、嘉实领先成长混合、嘉实周期优选混合、嘉实中证500ETF联接、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中创400联接、嘉实优化红利混合、嘉实纯债债券A、嘉实中证500ETF联接、嘉实深证基本面120ETF联接、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、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实低价策略股票、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实中证中期企业债指数(LOF)A、嘉实基本面50指数(LOF)之间互转,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、嘉实机构快钱货币A、嘉实中证中期企业债指数(LOF)C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。
b)对于"后端转后端"的模式,采用以下规则:
(i)若转出基金有赎回费,则仅收取转出基金的赎回费;
(ii)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