（上接B86版）

（126）西部证券股份有限公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼 | | |
| 法定代表人 | 刘建武 | 联系人 | 刘莹 |
| 电话 | （029）87416787 | 传真 | （029）87417012 |
| 网址 | www.westsecu.com | 客服电话 | 95582 |

（127）华福证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所 | 福州市五四路157号新天地大厦7、8层 | | |
| 办公地址 | 福州市五四路157号新天地大厦7至10层 | | |
| 法定代表人 | 黄金琳 | 联系人 | 张腾 |
| 电话 | （0591）87383623 | 传真 | （0591）87383610 |
| 网址 | www.hfzq.com.cn | 客服电话 | （0591）96326 |

（128）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、40068988888 |

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

（130）财通证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心 | | |
| 法定代表人 | 沈继宁 | 联系人 | 乔骏 |
| 电话 | （0571）87925129 | 传真 | 0571-87818329 |
| 网址 | www.ctsec.com | 客服电话 | （0571）96336、962336（上海地区） |

（131）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 |

（132）华鑫证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 住所、办公地址 | 深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元 | | |
| 法定代表人 | 洪家新? | 联系人 | 孔泉 |
| 电话 | （0755）82083788 | 传真 | （0755）82083408 |
| 网址 | www.cfsc.com.cn | 客服电话 | （021）32109999、（029）68918888 |

（133）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 | 牟坤 |
| 电话 | （010）58328112 | 传真 | （010）58328748 |
| 网址 | www.ubssecurities.com | 客服电话 | 400-887-8827 |

（134）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 | 龙增荣 | 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 |

（135）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 | 李玲 |
| 电话 | （0755）82570586 | 传真 | （0755）82960582 |
| 网址 | www.zszq.com | 客服电话 | 4001022011 |

（136）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 |

（137）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 |

（138）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 |

（139）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 |

（140）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 |

（141）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 |

（142）爱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 |

（143）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 |

（144）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 |

（145）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 | 翟成 |
| 电话 | 027-87610052 | 传真 | 027-87618863 |
| 网址 | www.tfzq.com | 客服电话 | 4008005000 |

（146）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）注册登记机构

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 | 国浩律师集团（北京）事务所 | | |
| 住所、办公地址 | 北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层 | | |
| 负责人 | 王卫东 | 联系人 | 黄伟民 |
| 电话 | （010）65890661 | 传真 | （010）65176801 |
| 经办律师 | 黄伟民 | | |

（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）23238800 |
| 经办注册会计师 | 许康玮、洪磊 | | |

**四、基金的名称**

本基金名称：混类研究精选混合型证券投资基金

**五、基金的类型**

本基金类型：契约型开放式，混合型基金

**六、基金的投资目标**

通过比较、选择、深入的基本面研究，挖掘企业内在价值，寻找具备长期增长潜力的上市公司，以获取基金资产长期稳定增值。

**七、基金的投资方向**

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票资产60%～95%，债券0～40%，权证0～3%现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

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。

**八、基金的投资策略**

本基金将优先考虑股票类资产的配置，通过精选策略构造股票组合，剩余资产将配置于固定收益类和现金类等大类资产上。

1、股票投资策略

股票组合的构建完全采用“自下而上”的精选策略，基金管理人依托本公司研究平台，组建由基金经理组成的基金管理小组，基于对企业基本面的研究独立决策、长期投资。

投资模式的特点在于为：

1）研究驱动，通过系统、细致、前瞻性的上市公司基本面研究，发掘具备成长性、能够创造价值的上市公司；

2）长期持有，在上述研究基础上，主要采取买入并长期持有的策略，降低换手率，以提高长期回报；

3）多组合经理模式，本基金由多个基金经理共同管理，各基金经理独立决策，对各自管理的资产部分负责，通过这一模式以保持基金业绩的稳定性与长期一致性。

基于企业内在价值进行长期投资，是国际资产管理领域内较为成熟的做法。过去几年中，证券市场逐渐成熟，公司基本面与股价的关系得到了加强。实践证明通过基本面研究，不仅能发现一批高质量的上市公司，而且能坚定持有信心，获取长期投资所带来的超额收益。

随着中国经济进一步发展，公司治理结构的不断完善，中国经济还将涌现一大批可供投资的优质上市公司。基于企业内在价值的长期投资模式成为可能。

在上述目标下，我们将坚持“自下而上”的精选策略，采用定量分析与定性分析相结合的方法，精选个股，构建投资组合。

1）定性分析

●准确、清晰的公司战略，并在此基础上形成了一套可持续发展的、良好的商业模式；

●独特、可验证的企业核心竞争力，体现在管理、技术、品牌、营销、资源、渠道网络等一个或多个方面；

●良好的公司治理结构，重点从公司股权结构、激励制度、组织框架、董事会与管理层的独立性、信息透明度等方面定性分析；

2）定量分析

财务分析：从EPS、EVA等指标来来的增长情况分析企业未来的成长性，持配合盈利能力、运营效率、偿债能力等方面的系统分析，比较企业在行业中的相对地位，甄别其真实性，选择盈利能力强、主营业务成长快、财务结构稳健的上市公司；

选择具备成长性、能够创造价值的上市公司。通过计算与比较包括ROC、企业加权平均资本成本（WACC）、企业成长(G)等核心指标，选择具备成长性、能够创造价值的上市公司；

价值大小合理。选择价格低于价值的上市公司，或者比较企业动态市盈率、PEG等指标，选择目前估值水平明显较低、或相对合理的上市公司进行重点投资。

2、债券投资策略

本基金可投资的债券品种包括国债、央行票据、金融债和企业（公司）债（包括可转换债）、资产支持证券及有关政府部门批准发行的其他债券。

本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，以风险管理策略为主，辅以收益率曲线策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券投资组合，以实现增值目标。

（1）久期策略

在分析宏观经济指标（主要包括：市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率）和财政货币政策等的基础上，对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测，决定组合的久期，并通过不同债券剩余期限的合理分布，有效地控制利率波动对基金净值波动的影响，并尽可能提高基金收益率。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析，预测收益率曲线的变化趋势，并据此进行投资组合的构建。收益率曲线策略有两方面的内容，一是收益率曲线本身的变化，根据收益率曲线可能向上移动或向下移动，降低或加长整个投资组合的平均剩余期限；二是根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征，通过骑乘策略，投资于最有投资价值的债券。

3、投资决策策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

**九、基金的业绩比较基准**

沪深300指数×95%＋上证国债指数×5%

随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前2日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

**十、基金的风险收益特征**

较高风险，较高收益。

**十一、基金投资组合报告**

基金管理人全体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本基金合同规定，于2015年10月23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 | 3,278,702,325.59 | 63.60 |
| | 其中：股票 | 3,278,702,325.59 | 63.60 |
| 2 | 固定收益投资 | 291,511,000.00 | 5.65 |
| | 其中：债券 | 291,511,000.00 | 5.65 |
| | 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 | 1,569,867,926.89 | 30.45 |
| 7 | 其他资产 | 14,855,379.70 | 0.29 |
| 8 | 合计 | 5,154,936,632.18 | 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 | 548,873,489.06 | 10.70 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 948,592,135.49 | 18.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 19,940,304.95 | 0.39 |
| F | 批发和零售业 | 484,301,885.35 | 9.44 |
| 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 | 329,930,429.76 | 6.43 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 208,199,585.32 | 4.06 |
| L | 租赁和商务服务业 | 283,582,748.46 | 5.53 |
| 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 | 455,281,747.20 | 8.88 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 3,278,702,325.59 | 63.93 |

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 | 300133 | 华策影视 | 18,659,088 | 455,281,747.20 | 8.88 |
| 2 | 000963 | 华东医药 | 5,474,762 | 382,412,125.70 | 7.46 |
| 3 | 002714 | 牧原股份 | 8,051,926 | 358,310,707.00 | 6.99 |
| 4 | 300136 | 信维通信 | 12,355,034 | 343,099,294.18 | 6.69 |
| 5 | 600050 | 中国联通 | 54,868,818 | 329,761,596.18 | 6.43 |
| 6 | 002400 | 省广股份 | 15,530,271 | 283,582,748.46 | 5.53 |
| 7 | 300203 | 聚光科技 | 9,761,365 | 234,760,828.25 | 4.58 |
| 8 | 002285 | 世联行 | 16,817,414 | 208,199,585.32 | 4.06 |
| 9 | 002299 | 圣农发展 | 12,721,147 | 190,562,782.06 | 3.72 |
| 10 | 300274 | 阳光电源 | 5,856,659 | 137,397,220.14 | 2.68 |

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 | 291,511,000.00 | 5.68 |
| | 其中：政策性金融债 | 291,511,000.00 | 5.68 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 291,511,000.00 | 5.68 |

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 | 150307 | 15进出07 | 1,100,000 | 110,572,000.00 | 2.16 |
| 2 | 150206 | 15国开06 | 1,000,000 | 100,670,000.00 | 1.96 |
| 3 | 150211 | 15国开11 | 500,000 | 50,155,000.00 | 0.98 |
| 4 | 150202 | 15国开02 | 300,000 | 30,114,000.00 | 0.59 |

注：报告期末本基金没有有上述4只债券。

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

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 | 5,967,555.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,591,216.99 |
| 5 | 应收申购款 | 3,296,607.39 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 14,855,379.70 |

（4）报告期末持有的处于转股期的可转债投资明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转债投资。

（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**

基金管理人承诺按照公平原则、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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2008年5月27日－2008年12月31日 | 2.90% | 1.14% | -47.06% | 2.90% | 49.96% | -1.76% |
| 2009年 | 72.71% | 1.50% | 90.74% | 1.95% | -18.03% | -0.45% |
| 2010年 | 9.03% | 1.28% | -11.66% | 1.50% | 20.69% | -0.22% |
| 2011年 | -18.84% | 1.07% | -23.70% | 1.23% | 4.86% | -0.16% |
| 2012年 | 16.08% | 1.02% | 7.44% | 1.22% | 8.64% | -0.20% |
| 2013年 | 27.65% | 1.23% | -7.05% | 1.32% | 34.70% | -0.09% |
| 2014年 | 32.80% | 1.14% | 48.98% | 1.15% | -16.18% | -0.01% |
| 2015年上半年 | 55.30% | 2.45% | 25.45% | 2.15% | 29.85% | 0.30% |
| 2015年1月1日至2015年9月30日 | 24.29% | 2.96% | -8.44% | 2.57% | 32.73% | 0.39% |

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

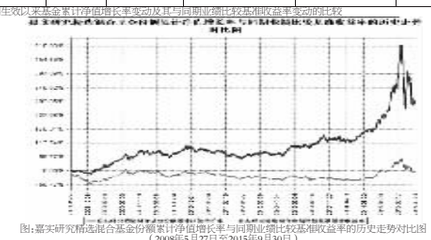

图1：嘉实研究精选混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2008年5月27日至2015年9月30日）

注：按基金合同约定，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投资组合比例符合基金合同“十四、基金的投资（二）投资范围、（七）2.投资组合比例限制”的约定。

**十三、费用概览**

（一）基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提，计算方法如下：

H=E×1.5%÷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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提，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，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的会计师费和律师费等，该等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。

2、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，随申购金额越大，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A类份额申购费率最高不超过申购金额的5%，具体如下：

| 申购金额（含申购费） | 申购费率 |
|---|---|
| M＜50万元 | 1.5% |
| 50万元≤M＜200万元 | 1.2% |
| 200万元≤M＜500万元 | 0.8% |
| 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。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。

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。

本基金H类份额申购费率最高不超过申购金额的3%，由香港销售机构在此范围内自行确定。

（2）赎回费

本基金A类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，赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。本基金A类份额赎回费率最高不超过赎回金额的5%，具体如下：

| 持有期限 | 赎回费率 |
|---|---|
| ＜365天 | 0.50% |
| 365天≤M＜730天 | 0.25% |
| ≥730天 | 0 |

本基金H类份额赎回费率为0.125%。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，对于A类份额持有人收取的基金赎回费中25%计入基金财产，其余部分用于支付注册登记费等相关手续费，对于H类份额持有人收取的基金赎回费100%计入基金财产。

（3）转换费

基金转换费由投资者承担，用于支付有关手续费和注册登记费。

本基金 H 类份额暂不开通基金转换业务，待条件成熟后，基金管理人可以开通 H 类份额的基金转换业务，无需召开持有人大会。

本基金的转换费率按照如下方式收取：

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转换为嘉实研究精选混合时，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。

（b）嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券C转换为嘉实研究精选混合时，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）嘉实研究精选混合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、嘉实优质企业混合、嘉实主题混合、嘉实策略混合、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、嘉实绝对收益策略定期混合、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实低价策略股票之间互转，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、嘉实中证400联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证企融地产ETF联接、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增强收益定期债券A、嘉实机构快线货币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、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证企融地产ETF联接转入嘉实研究精选混合时，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。

（e）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、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增强收益定期债券A转入嘉实研究精选混合时，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

a）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转换为嘉实研究精选混合时，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比赛费率执行。

（ii）嘉实信用债券C、嘉实纯债债券C、嘉实稳固收益债券、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证中期企业债指数（LOF）C转换为嘉实研究精选混合时，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；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

（iii）嘉实研究精选混合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、嘉实中证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、嘉实研究阿尔法股票、嘉实绝对收益策略定期混合、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、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实低价策略股票之间互转，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、嘉实中证400联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证企融地产ETF联接、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增强收益定期债券A、嘉实机构快线货币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。

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转出基金的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。

注1：2014年5月23日起，嘉实短期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，嘉实短期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；自2015年11月16日起，嘉实中证中期企业债指数（LOF）单日单个基金账户累计申购（或转入、定投）不超过2000万元；嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实对冲套利定期混合、嘉实丰益信用定期债券、嘉实增强收益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