(上接B58版)

(129) 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	罗杰	联系人	殷玮
电话	021-38784818?	传真	021-68775878
网址	www.shhxzq.com	客服电话	68777877

(130) 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

(131) 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	车冲
电话	(010)58328112	传真	(010)58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

(132) 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

(133) 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	吴水良	联系人	李玲
电话	(0755)82570586	传真	(0755)82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

(134) 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

(135) 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

(136) 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

(137) 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

(138) 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

(139) 长城证券有限责任公司

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

(140) 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

(141) 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

(142) 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

(143) 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

(144) 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(回上)

(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:嘉实价值优势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

运用价值投资方法,精选在基本面上具备核心竞争力、且市场估值水平具备相对优势的企业投资,并持续优化投资组合中风险与收益的匹配程度,力争获取中长期、持续、稳定的超额收益。

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、衍生工具(权证等)、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)、资产支持证券、央行票据、短期融资券等)、债券回购、银行存款等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。

本基金资产配置范围:股票资产占基金资产的比例为60-95%;债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为0-40%,其中现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。

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

本基金以价值投资理念为核心,根据中国股票市场的投资特点进行改良应用。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判,决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策;其次在个股选择上,通过深入研究寻找优质企业,运用估值方法估算其内在投资价值,并根据国内市场的特殊性及波动性,综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素,发现具备投资价值的个股。

1、资产配置策略

在大类资产配置上,本基金通过公司投资决策委员会所开发使用的大类资产配置模型,大类资产配置模型将综合考虑宏观因素、市场因素,以及估值因素的指标:

(1)宏观因素:宏观因关注基本面的重要经济数据以及货币和财政政策的变化。经济基本面我们特别关注GDP增长、工业增加值、投资增速等各种国民生产统计指标,从而分析对股票市场的影响;而货币和财政政策主要分析利率、CPI、信贷规模指标等的影响。

(2)市场因素:市场方面我们关注货币供给指标以及流动性的变化对资本市场的影响,同时通过反映投资者情绪和信息的技术指标和统计指标来预测未来的市场变化趋势。

(3)估值因素:估值方面我们不仅关注股票市场的估值因素,同时也比较不同市场之间的相对估值变化,在大类资产间寻找相对的估值洼地。

通过该模型,本基金可以对主要大类资产如股票、债券、现金等投资标的的价值进行比较,合理分配大类资产的投资比例。

2、行业配置策略

利用大类资产配置模型,前瞻性地判断市场趋势及趋势,进行行业配置策略的选择,实现超额收益的最大化。在适当的市场环境下,基金经理将比较各行业相对于全市场估值水平的折溢价程度,以及该折溢价程度与历史平均折溢价程度的偏离,同时结合对该行业的周期性分析、基本面研究、可能的政策影响、市场认同度等因素,综合判断该行业估值标准的合理性,相对于比较基准形成较大的行业偏离配置。

3、股票选择策略

长期来看股票价格反映投资价值,但在中短期内,企业可能因为技术革新、公司治理制度改善等基本面因素,或是资讯不对称、投资者情绪等市场性因素,导致股票价格低于投资价值的情况。

本基金认为,价值投资就是发现投资标的真正价值的过程。在股票选择策略上,本基金将采用积极管理的方式,充分运用价值投资方法,并结合风险管理手段来实现投资目标。主要步骤说明如下:

1) 初步筛选形成备选投资标的;

a) 去除公司制度禁止投资的股票;

b) 扣除流动性相对不足、总市值小于10亿的股票;

c) 对于动态市盈率超过全市场平均市盈率150%的个股、或连续两个年度没有盈利的企业(基本面出现重大改善的个股除外),本基金不予考虑;

d) 根据企业所在的行业发展周期、商业模式、管理能力、财务状况、创新能力、产品的生命周期等因素,筛选出具备核心竞争力的个股。

2) 估算投资标的内在投资价值:

本基金将比较备选投资标的的市场价格与投资价值,挑选市场价价格对于投资价值相对低估的投资标的。

依据国内A股市场波动性较大的特点,本基金在决定投资价值时以相对价值为主、绝对价值为辅,主要估值方法包含相对估值法以及现金流折现法。相对估值法主要根据股票的市场估价比率与全市场、同行业/板块其他公司、该股票的历史估值比率对比来衡量个股估值的相对高低,其中估值比率包括每股收益与价格比率、每股净资产与价格比率、股息收益率、或每股净现金流与价格比率等;现金流折现法则根据企业的营收成长、净利润增长率、自由现金流等基本面因素,采用适当的折现率进行估算。

3) 挖掘企业因基本面改善但尚未被市场发现的因素;

随着中国宏观经济快速发展,市场化程度不断提高,国内企业出现许多因技术革新、引入战略投资者、购并重组、公司治理改善、股权激励等因素,从而改善经营方向、扭亏为盈,最终提高企业的核心竞争力的事件。这些改变公司基本面竞争优势的重大事件,往往因为深入研究的投资者较少,导致短期内市场价格未能充分反映未来价值。本基金将通过前瞻、深入的研究分析,来捕捉市场上所忽略的投资机会。

4) 挖掘市场变动及市场预期所带来的机会:

短期来看,由于A股具备新兴市场特性,行业个股轮动较快,往往因为短期特殊性事件,导致特定个股价格出现超涨或超跌的情况,因此本基金也关注因个股短期超跌,导致市场价格低于投资价值的投资机会。

长期来看,市场会充分预期所有影响企业内在价值的因素,并将所有信息反映在股价中。在短期内,市场将对影响投资标的的信息形成市场预期,并随实际情况反复修正市场预期,而市场预期改变的过程,可能在一定程度上推动或抑制公司的股价,因此本基金也将通过了解及预测市场各参与主体之间的预期以及预期可能产生的变化,提前掌握因市场预期改变所带来的投资机会。

5) 精选风险调整后收益较高的个股构建股票投资组合;

本基金将综合考虑经上述4个步骤精选出来的投资标的,比较个别机会的投资收益及潜在风险,精选风险与收益匹配的投资标的构建投资组合。

4、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。

5、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。

6、风险管理策略

本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等,并结合公司现有的风险管理流程,在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。

具体而言,在大类资产配置策略的风险控制上,由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控;在行业配置策略的风险控制上,投资流程与风险管理部对行业的偏离风险进行监控并及时预警。同时投资流程与风险管理部也将严控本基金的投资风格偏离风险。在个股选择策略的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部规章制度,控制单一个股投资风险。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数*95%+上证国债指数*5%。

如果中证指数有限公司变更或停止沪深300指数或上证国债指数的编制及发布、或沪深300指数或上证国债指数由其他指数替代、或由于指数编制方法发生重大变更等原因导致沪深300指数或上证国债指数不宜继续作为基准指数,或市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,变更本基金的业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属较高风险、较高收益的品种。

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	547,690,227.46	75.28
	其中:股票	547,690,227.46	75.28
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,335,000.00	6.92
	其中:债券	50,335,000.00	6.92
	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	120,679,030.95	16.59
8	其他资产	8,840,254.84	1.22
	合计	727,544,513.25	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	14,142,032.00	1.97
B	采矿业	-	-
C	制造业	336,414,624.91	46.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,431,169.05	1.87
E	建筑业	12,943,196.00	1.80
F	批发和零售业	87,061,975.40	12.13
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	1,467.40	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	48,349,101.90	6.74
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	35,346,002.00	4.92
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	658.80	0.00
S	综合	-	-
	合计	547,690,227.46	76.30

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	000786	北新建材	4,083,040	54,059,449.60	7.53
2	002400	省广股份	2,647,815	48,349,101.90	6.74
3	000028	国药一致	800,000	45,136,000.00	6.29
4	002020	京新药业	1,350,068	35,776,802.00	4.98
5	600835	上海机电	1,457,815	33,937,933.20	4.73
6	600525	长园集团	2,019,800	30,297,000.00	4.22
7	000826	桑德环境	838,100	28,243,970.00	3.93
8	601992	金隅股份	3,536,886	27,021,809.04	3.76
9	300228	富瑞特装	1,061,444	20,167,436.00	2.81
10	002572	索菲亚	491,319	18,827,344.08	2.62

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	50,335,000.00	7.01
	其中:政策性金融债	50,335,000.00	7.01
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	50,335,000.00	7.01

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	150206	15国开06	500,000	50,335,000.00	7.01

注:报告期末本基金仅持有上述1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	1,123,061.91
2	应收证券清算款	6,650,839.47
3	应收股利	-
4	应收利息	977,324.72
5	应收申购款	89,028.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	8,840,254.84

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000786	北新建材	54,059,449.60	7.53	重大事项停牌
2	600525	长园集团	30,297,000.00	4.22	重大事项停牌
3	300228	富瑞特装	20,167,436.00	2.81	重大事项停牌

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. 本基金业绩分期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
自基金合同生效(2010年6月7日)起至2010年12月31日	18.40%	1.12%	13.38%	1.51%	5.02%	-0.39%
2011年	-22.03%	1.15%	-23.70%	1.23%	1.67%	-0.08%
2012年	3.57%	1.12%	7.44%	1.22%	-3.87%	-0.10%
2013年	24.35%	1.27%	-7.05%	1.32%	31.40%	-0.05%
2014年	11.79%	1.17%	48.98%	1.15%	-37.19%	0.02%
2015年上半年	47.13%	2.24%	25.45%	2.15%	21.68%	0.09%
2015年1月1日至2015年9月30日	7.52%	2.85%	-8.44%	2.57%	15.96%	0.28%

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:嘉实价值优势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

(2010年6月7日至2015年9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(十四)投资范围和(七)2.基金投资组合比例限制)的有关约定。

(二)投资范围和(七)2.基金投资组合比例限制)的有关约定。

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。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个工作日内从基金资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。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个工作日内从基金资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

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用、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,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

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,不列入基金资产。

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。

(2)赎回费

本基金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。本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%,随持有期限的增加而递减,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。

(3)转换费

基金转换费由基金份额持有人承担,用于支付有关手续费和注册登记费。本基金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)

i 嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实超短债债券、嘉实多元债券A、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转换为嘉实价值优势混合时,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、嘉实机构快钱货币A、嘉实机构快钱货币B或嘉实机构快钱货币C金部转出时账户当前累计未付收益。

ii 嘉实价值优势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、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、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、嘉实新兴产业股票、嘉实医疗保健股票、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、嘉实环保低碳股票之间互转,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、嘉实短债债券C、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实证监会上证180ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实中证800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A、嘉实如意宝定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增盈收益定期债券A、嘉实机构快钱货币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。

iii 嘉实价值优势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、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、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、嘉实新兴产业股票、嘉实医疗保健股票、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、嘉实环保低碳股票之间互转,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A、嘉实短债债券C、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实证监会上证180ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实中证800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A、嘉实如意宝定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实如意宝定期债券C、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实增盈收益定期债券A、嘉实机构快钱货币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。

iv 嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中证400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接转入嘉实价值优势混合时,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;

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

v 嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中证400联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接转入嘉实价值优势混合时,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;

E为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

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。

vi 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、嘉实增盈收益定期债券A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

i 对于“前端转前端”的模式,采用以下规则:

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转换为嘉实价值优势混合时,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、嘉实机构快钱货币A、嘉实机构快钱货币B或嘉实机构快钱货币C金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。

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、嘉实中证中期企业债指数(LOF)C转换为嘉实价值优势混合时,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)嘉实价值优势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、嘉实研究精选混合、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长