(上接B86版)

021 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	乔毅
电话	0571-87925129	传真	0571-87818329
网址	www.ctsec.com	客服电话	0571-96336、962336(上海地区)

022 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

023 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

024 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号英监国际金融中心12层、15层		
法定代表人	程宜荪	联系人	牟冲
电话	010-83328112	传真	010-83328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

025 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

026 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

027 中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

028 万和证券有限公司

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

029 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

030 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	李薇
电话	010-59355941	传真	010-66553791
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

031)　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

032 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

033 longzhe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

034 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

035 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

036 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(向上)
(三)律师事务所经办律师

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:嘉实周期优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

六、基金的投资目标

本基金优选周期行业股票,在严格控制投资风险的条件下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报收益。

七、基金的投资范围

本基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(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(分离交易可转债)、央行票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等固定收益类资产,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%;权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金将80%以上的股票资产投资于周期行业股票。

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

本基金将考考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围,在对宏观经济及产业景气周期的研判基础上,优选周期行业股票,寻找具备基本面健康、估值有优势、竞争优势强、管理水平高的合理投资标的,在严格控制投资风险的条件下,力争获取超越业绩比较基准的投资回报收益。

(1)大类资产配置策略

在大类资产配置上,本基金首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围,投资决策委员会将重点评估以下几个因素:宏观因素——包含重要经济数据以及货币和财政政策的变化;市场因素——包含货币供给指标以及波动性的变化对资本市场的影响;估值因素——包含不同市场之间的相对估值变化;同时,本基金作为主动管理的股票基金,也将考考宏观策略部门提供的研究分析建议,并结合投资组合的长期收益获取能力综合考虑作出大类资产配置决策。

在控制风险的前提下,本基金将在对宏观经济及产业景气周期的研判基础上,把握经济运行周期波动中的轮动规律,优先配置股票资产,本基金股票资产占基金资产的比例为60-95%,本基金将80%以上的股票资产投资于周期行业股票。

(2)行业配置策略

1)周期行业的界定

周期行业是指和国内或国际经济波动相关性较强的行业,其行业走势与整体经济走势较为相关,行业及个股的基本面和估值面随宏观经济景气周期变化而变化。本基金根据其行业周期特性,将石油金融保险、采掘、房地产、交通运输仓储、建筑、电力煤气及水的生产和供应等行业以及石油、化工、金属非金属、机械、设备、造纸、印刷、电子等制造业的股票归为周期行业。

2)周期行业配置策略

本基金将综合考虑以下周期行业配置影响因素,并结合周期行业轮动策略进行股票资产在周期行业之间的配置。

A.宏观经济因素:周期行业受宏观经济形势影响较大,在经济周期各个阶段的表现不同,预期收益率存在较大差异。本基金将重点配置经济周期各个阶段预期收益率较高的行业。

B.政策因素:政策因素包括政府产业政策、行业管理政策等。社会因素和政策因素对周期行业的影响程度不同。本基金将动态关注政府政策变化趋势,适配受惠于政府政策变化的行业。

C.通胀因素:包括大宗商品、农产品以及劳动力成本上升等引致的通货膨胀及通胀预期作为影响周期行业发展的重要因素,本基金将根据对未来通胀水平及通胀预期的判断积极配置于受益通胀变化的行业。

D.技术升级因素:周期行业一方面作为传统经济产业中的重要组成部分,另一方面随着应用创新技术的领先性、独创性以及稳定性、安全性等方面的发展程度以及纵横而来的整体产业转型升级,会对行业未来的成长性起到关键性影响。本基金将对具有政热或存在轮高门槛技术以及具有明确产业升级趋势的行业进行重点关注。

E.市场需求趋势:周期行业市场需求的变化趋势不同,有的表现为刚性需求,有的呈现较大弹性,导致不同行业成长性出现差异。本基金将重点投资市场需求稳定或保持较高增长的行业。

F.产业周期及竞争格局:周期行业的产业发展周期以及内部竞争格局不同,行业利润率存在较大差异。本基金将重点投资处于进入壁垒较高、利润率稳定或保持增长的行业。

3)周期行业轮动策略

周期行业轮动来源于宏观经济运行周期的波动,经济景气度的轮动循环通过周期行业轮动进行体现,本基金将根据对宏观经济环境以及经济景气度分析,基于各个周期行业在宏观经济和产业景气周期的不同阶段的敏感度和业绩弹性,结合考察货币政策、财政政策、产业政策等的当前和预期影响,对各周期行业之间进行行业轮动配置,寻找预期能够获得超额收益的景气行业进行配置。

(3)股票投资策略

在大类资产配置策略以及周期行业配置及轮动策略的基础上,本基金将深入分析周期行业运行特征,优选周期行业股票,寻找具备基本面健康、估值有优势、竞争优势强、管理水平高的合理投资标的进行投资。本基金将重点挖掘周期行业股票中业绩具有持续成长特性的周期成长股构建投资组合。

1)定量品质筛选

本基金通过量化分析周期行业股票相关财务指标,寻找基本面健康、估值有优势的品质公司股票构建周期行业初选股票库,具体包括:

①偿债能力指标(如资产负债率、周转率、流动比率等);该指标主要用于评估公司资越宏观经济和行业的兼条和衰退期的能力;

②经营周转指标(如存货周转率、应收帐款周转率等);该指标主要用于评估公司的财务安全与经营能力;

③盈利增长指标(如三年营业收入净利润净资产增长率);该指标主要用于评估公司持续发展能力与提升市场份额的能力;

④估值分析指标(如盈率(PE)、市净率(PB)、PEG、EV/EBITDA等);该指标主要用于评估公司相对市场和行业的相对投资价值。

2)定性评价优选

在量化筛选的基础上,本基金通过优选内外部环境有利、竞争优势强、管理水平高的公司股票,构建周期行业备选股票池,本基金将结合研究团队实地调研、定性分析、以及市场情绪等因素,对股票配置策略进行动态调整,进行实际的投资组合构建。

①公司的行业竞争力

本基金对公司的行业竞争力的考察主要分析公司是否建立高效的管理团队、管理能力是否较强,在战略管理、生产管理、质量管理、技术管理、成本管理、营销管理等方面具有竞争对手无法比拟的核心优势,并重点关注公司的中长期持续增长能力及成长性高速增长的能力,内容包括公司的主营产品规模是否具有良好的市场前景,在产品或服务提供方面是否具有成本优势,是否拥有出色的销售机制、体系及团队,是否具备较强的技术创新能力并保持足够的研发投入以推动企业的持续发展等。

②公司的管理能力和治理结构

本基金关注公司是否建立起完善的法人治理结构,经营活动高效、有序,公司管理层稳定,且关心股东利益、诚信、优秀的公司管理层能来领公司不断制定和调整发展战略,把握住正确的发展方向,以保证企业资源的最佳配置和目身优势的充分发挥;同时良好的治理结构能促使公司管理层诚信尽职、融洽稳定,重视股东利益并使得管理水平能充分适应企业规模的不断扩大,本基金关注有良好管理能力的公司,同时也关注和历史表现相比,各方面情况正在得到改善的公司。

③公司面临的外部环境分析

本基金同时也关注从宏观经济周期、人口结构、社会生产能力等长期发展角度分析公司所处行业面临的发展机遇,同时关注政府的经济结构调整及产业升级等产业政策可能给行业带来的发展机遇,分析行业因素对公司的影响时不仅考虑公司所处行业的周期特征、行业景气度和行业集中度因素,也要关注公司主要业务所处的经济区域及产业配套设施对公司长期发展前景的影响。

本基金将根据对周期行业的综合分析,确定各行业的资产配置比例,在周期行业中,基金将选择具有较强竞争优势且估值具有吸引力的公司股票进行投资,重点挖掘其中业绩具有持续成长特性的周期成长股的投资机会。当行业与股票的基本面、股票的估值水平出现较大变化时,基金将对股票组合适时进行调整,进行实际的投资组合构建。

(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,合理利用权证等衍生工具,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

本基金将集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,风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外,也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上,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指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%

如果今后法律法规发生变化,或者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,或者沪深300指数或上证国债指数出其他指数替代,或者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,或者有更合适、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股票指数时,本基金管理人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。

本基金托管人中国工商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	3,638,786,128.96	93.16
	其中:股票	3,638,786,128.96	93.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,989,879.70	0.13
	其中:债券	4,989,879.70	0.13
	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	257,236,401.60	6.59
8	其他资产	5,125,560.63	0.13
	合计	3,906,137,970.89	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	143,172,548.56	3.68
B	采矿业	19,941,000.00	0.51
C	制造业	2,442,368,156.99	62.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	17,255,040.00	0.44
F	批发和零售业	51,030,000.00	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	150,439,942.60	3.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	435,849,378.47	11.20
J	金融业	340,692,592.00	8.75
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	38,037,470.34	0.98
	合计	3,638,786,128.96	93.49

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	000063	中兴通讯	19,999,957	311,999,329.20	8.02
2	600050	中国联通	50,000,100	300,500,601.00	7.72
3	601766	中国中车	19,999,930	259,399,092.10	6.66
4	600498	烽火通信	10,002,720	212,757,854.40	5.47
5	002202	金风科技	14,497,810	195,865,413.10	5.03
6	002594	比亚迪	2,999,836	180,020,158.36	4.63
7	600036	招商银行	10,000,000	177,700,000.00	4.57
8	000039	中集集团	10,001,852	171,731,798.84	4.41
9	600030	中信证券	12,002,400	162,992,592.00	4.19
10	600089	特变电工	14,499,841	152,828,324.14	3.93

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	1,009,100.00	0.03
	其中:政策性金融债	1,009,100.00	0.03
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	3,980,779.70	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	4,989,879.70	0.13

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	110031	航信转债	31,190	3,980,779.70	0.10
2	018001	国开1301	10,000	1,009,100.00	0.03

注:报告期末基金仅持有上述2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开罚通谴、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	3,481,397.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	95,936.30
5	应收申购款	1,548,227.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	5,125,560.63

(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

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.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
2011年12月8日至2011年12月31日	-0.10%	0.05%	-6.85%	1.11%	6.75%	-1.06%
2012年度	8.21%	1.13%	7.44%	1.22%	0.77%	-0.09%
2013年度	14.76%	1.26%	-7.05%	1.32%	21.81%	-0.06%
2014年度	49.32%	1.18%	48.98%	1.15%	0.34%	0.03%
2015年上半年度	40.51%	2.31%	25.45%	2.15%	15.06%	0.16%
2015年1月1日至2015年9月30日	3.03%	3.03%	-8.44%	2.57%	11.47%	0.46%

2.自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准收益率的变动比较

图:嘉实周期优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

2011年12月8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(第十一部分二、投资范围和五、投资限制(二.股票投资限制)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提,管理费的计算方法如下:

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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3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、公休假等,支付日期顺延。

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0.25%的年费率计提,托管费的计算方法如下:

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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取,若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

③与基金运作有关的其他费用

主要包括基金合同生效以后的信息披露费用、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、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,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,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<100万元	1.5%
100万元≤M<200万元	1.0%
200万元≤M<500万元	0.6%
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,前端申购费率按照相关公告规定的优惠费率执行。

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。

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%的部分归入基金资产,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(不限“即端转出端”的模式)

a.嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实短债债券、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转换为嘉实周期优选混合时,收取转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

净转入金额=BxC/(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;

M为嘉实货币A、嘉实货币B、嘉实短债债券、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、嘉实如意宝定期债券C转换为嘉实周期优选混合时,采用“赎回费+申购费率”算法:

净转入金额=BxCx(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。

ii.嘉实周期优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、嘉实纯债债券混合、嘉实领先成长混合、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、嘉实对冲套利定期混合、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400ETF联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接转入嘉实信用债券A、嘉实中证信用证券ETF联接、嘉实增强收益定期债券A、嘉实主益信用证券ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实中创400ETF联接、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实中证500ETF联接、嘉实主益纯债定期债券A、嘉实如意宝定期债券A、嘉实稳固收益定期债券A、嘉实信用证券ETF联接、嘉实增强收益定期债券A、嘉实主益信用证券ETF联接、嘉实信用证券A时,仅收取转出基金的赎回费,计算公式如下:

净转入金额=BxCx(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联接转入嘉实周期优选混合时,采用“赎回费+固定补差费率”算法:

净转入金额=BxCx(1-D)/(1+G)

转换补差费用=BxCx(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。

v.嘉实债券、嘉实多元债券A、嘉实纯债债券A、嘉实纯债定期债券、嘉实如意宝定期债券A、嘉实增强收益定期债券A、嘉实主益信用证券A转入嘉实周期优选混合时,采用“赎回费+固定补差费率”算法:

净转入金额=BxCx(1-D)/(1+G)

转换补差费用=BxCx(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(值销柜台及网上直销)办理基金转换业务

i.对于“即端转前端”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转换为嘉实周期优选混合时,收取转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

净转入金额=BxC/(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;

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

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转换为嘉实周期优选混合时,采用“赎回费+申购费率”算法:

净转入金额=BxCx(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.嘉实周期优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、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券A、嘉实领先成长混合、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、嘉实对冲套利定期混合、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、嘉实事件驱动股票、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