（上接B58版）

118)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 |

119)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 |

120)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 | 陈歌 |
| 电话 | （021）32229888 | 传真 | 021-68728782 |
| 网址 | www.ajzq.com | 客服电话 | （021）63340678 |

121)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 |

122)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 |

123)财达证券有限责任公司

| | | | |
|---|---|---|---|
| 办公地址 | 河北省石家庄市自强路35号 | | |
| 注册地址 | 河北省石家庄市自强路35号 | | |
| 法定代表人 | 翟建强 | 联系人 | 马辉 |
| 电话 | 0311—66006342 | 传真 | 0311—66006201 |
| 网址 | www.s10000.com | 客服电话 | 4006128888 |

124)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 |

125)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 | 上海源泰律师事务所 | | |
| 住所,办公地址 | 中国上海浦东南路256号华夏银行大厦14层 | | |
| 负责人 | 廖海 | 联系人 | 张兰 |
| 电话 | （021）51150298 | 传真 | （021）51150398 |
| 经办律师 | 刘佳,张兰 | | |

（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 | 李丹 | 联系人 | 张勇 |
| 电话 | （021）23238888 | 传真 | （021）23238800 |
| 经办注册会计师 | 许丽萍,张勇 | | |

**四、基金的名称**

本基金名称:嘉实泰和混合型证券投资基金

**五、基金的类型**

本基金类型:混合型证券投资基金,契约型开放式

**六、基金的投资目标**

分享中国改革与发展成果,密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会,谋求基金资产的长期稳定增值。

**七、基金的投资范围**

本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板股票及其他经中国证监会核准发行的股票）,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）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,股指期货,权证,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。

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。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为30%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的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%;股指期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

**八、基金的投资策略**

1、资产配置策略

本基金主要参考公司股票投资决策委员会形成的大类资产配置建议,综合考虑宏观经济因素、资本市场因素、主要大类资产的相对估值等因素,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。

2、股票投资策略

本基金股票投资将重点关注中观因素带来的投资线索并防范组合风险,精选具有可持续增长潜力的优势个股。基于中观因素与个股因素相结合的个股精选是本基金的主要投资策略。本基金将从持续性、有效性和市场认知程度三个方面综合分析判断中观因素转化为投资机会的可能性,并在此基础上深入挖掘个股投资价值。

（1）中观因素主要可以归纳为以下四个方面的线索:

a、宏观经济结果:宏观经济变化会对中观层面产生深远影响,在不同的宏观环境下,各个行业的生命特征和表现不同。本基金将结合宏观经济数据（如通胀水平、经济增长速度等）,政策导向和市场投资情绪对宏观经济周期进行前瞻性判断,进而根据不同经济周期阶段的特征在配置与调整。

b、产业变迁:产业转移和技术发展是导致产业变迁的两大动力,本基金通过深入研究国际国内产业转移路径以及技术发展升级带来的行业和区域性投资机会,优选处于上升周期的产业。

c、行业格局:长期来看,行业的系统性周期变化将会对行业格局变化产生系统性影响,而短期来看,行业格局利益的重新分配将会对行业产生结构性影响和机会,本基金通过紧密跟踪影响行业格局利益分配调整的驱动因素和事件,提前捕捉行业格局变化带来的投资机会。

d、主题驱动:本基金同时关注影响行业/区域的主题性投资机会,通过综合考量主题驱动的上中下游行业机会,以及行业/区域与主题的相关程度和应速度,提前布局主题受益行业/区域。

（2）个股因素主要可以归纳为以下几个方面的指标:

a、盈利模式:通过综合考量企业利润来源、核心竞争力、渠道影响力、客户忠诚度、创新能力等分析判断企业是否具备稳健或领先的盈利模式。

b、管理层能力:通过综合考量企业管理团队的稳定性、专业程度以及所倡导的企业文化等分析判断企业管理层是否具备带领企业积极健康发展的能力。

c、公司战略:通过综合考量企业战略定位、发展规划、经营策略和执行力等分析判断企业是否具备清晰的发展目标和明确的实现手段。

d、财务报表健康程度:通过综合考量企业资产负债情况、利润结构分解和现金流情况等分析判断企业财务状况是否与其战略发展相匹配。

e、体外或有资产:通过综合考量企业的行业地位、兼并收购能力等分析判断企业扩大产能实现跳跃式发展的可能性。

（3）中观因素与个股因素相结合

本基金遵循“宏观指导中观,中观指导微观”的动态投资逻辑,通过结合中观因素与个股因素确定优势个股,并根据组合风险特征、资产配置策略的变化等进行股票投资组合的构建与调整。

3、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。

4、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,合理利用股指期货、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。

5、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,由股票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。

未来,根据市场情况,基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中公告。

**九、基金的业绩比较基准**

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数×70%+上证国债指数×30%。

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维护投资者合法权益的原则,变更本基金的业绩比较基准。

**十、风险收益特征**

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金,高于债券型基金及货币市场基金,属于中高收益/风险特征的基金。

**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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年4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2016年3月31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 | 816,110,669.77 | 52.74 |
| | 其中:股票 | 816,110,669.77 | 52.74 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 80,054,000.00 | 5.17 |
| | 其中:债券 | 80,054,000.00 | 5.17 |
| | 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 | 638,835,722.11 | 41.28 |
| 8 | 其他资产 | 12,548,498.33 | 0.81 |
| | 合计 | 1,547,548,890.21 | 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 | 74,067,812.49 | 4.80 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 299,488,969.46 | 19.42 |
| 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 | 206,714,909.32 | 13.40 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 43,023,890.25 | 2.79 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 60,401,031.98 | 3.92 |
| J | 金融业 | 56,147,458.58 | 3.64 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 33,319,835.35 | 2.16 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 39,831,122.34 | 2.58 |
| 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 | 3,115,640.00 | 0.20 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 816,110,669.77 | 52.91 |

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 | 000963 | 华东医药 | 1,938,074 | 135,568,276.30 | 8.79 |
| 2 | 000998 | 隆平高科 | 4,085,373 | 74,067,812.49 | 4.80 |
| 3 | 300054 | 鼎龙股份 | 3,110,271 | 64,382,609.70 | 4.17 |
| 4 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,148,749 | 54,255,415.27 | 3.52 |
| 5 | 000028 | 国药一致 | 832,809 | 53,116,558.02 | 3.44 |
| 6 | 601006 | 大秦铁路 | 6,262,575 | 43,023,890.25 | 2.79 |
| 7 | 300012 | 华测检测 | 1,888,626 | 39,831,122.34 | 2.58 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 2,247,444 | 36,161,373.96 | 2.34 |
| 9 | 300017 | 网宿科技 | 559,938 | 32,705,978.58 | 2.12 |
| 10 | 000786 | 北新建材 | 3,266,100 | 31,125,933.00 | 2.02 |

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 | 80,054,000.00 | 5.19 |
| | 其中:政策性金融债 | 80,054,000.00 | 5.19 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 80,054,000.00 | 5.19 |

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 | 150211 | 15国开11 | 500,000 | 50,040,000.00 | 3.24 |
| 2 | 150311 | 15进出11 | 200,000 | 20,004,000.00 | 1.30 |
| 3 | 150416 | 15农发16 | 100,000 | 10,010,000.00 | 0.65 |

注:报告期末,本基金仅持有上述3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 | 98,565.23 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,999,948.16 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,204,837.90 |
| 5 | 应收申购款 | 245,147.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 12,548,498.33 |

(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.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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2014年4月4日（合同生效日）至2014年12月31日 | 22.73% | 0.96% | 42.84% | 0.85% | -20.11% | 0.11% |
| 2015年 | 55.97% | 1.63% | 7.44% | 1.74% | 48.53% | -0.11% |
| 2016年1月1日至3月31日 | -3.72% | 0.80% | -9.13% | 1.70% | 5.41% | -0.90% |

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

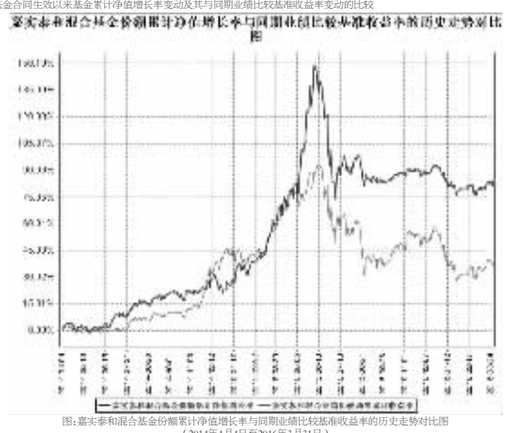


图:嘉实泰和混合基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2014年4月4日至2016年3月31日）

注1:本基金转型日期为2014年4月4日。

注2: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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

注3:2016年3月10日,本基金管理人发布《关于嘉实泰和混合基金经理变更的公告》,王汉博先生不再担任本基金基金经理职务,聘请归凯先生担任本基金基金经理职务。

**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

基金运作过程中,从基金财产中支付的费用包括:

（1）基金管理人的管理费。

（2）基金托管人的托管费。

（3）基金财产拨划支付的银行费用。

（4）基金合同生效后的基金信息披露费用。

（5）基金份额持有人大会费用。

（6）基金合同生效后与基金有关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费。

（7）基金的证券交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、融资融券费及其他类似性质的费用等）。

（8）基金的开户费用、账户维护费用。

（9）基金上市初费及年费（如有）。

（10）法律法规规定或经中国证监会认定可以在基金财产中列支的其他费用。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

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,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提,计算方法如下:

$H=E\times1.5\%\div$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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延至最近可支付日支付,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,应及时联系基金托管人协商解决。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法如下:

$H=E\times0.25\%\div$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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延至最近可支付日支付,费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,应及时联系基金托管人协商解决。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费和赎回费

（1）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。

本基金基金份额前端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。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 | 每笔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%,但申国银行长城借记卡、招商银行借记卡、中国工商银行借记卡持卡人,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,不列入基金财产。

（2）本基金对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,对持续持有期少于7日的投资人收取1.5%的赎回费,对持续持有期大于等于7天小于30日的投资人收取0.75%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产;对持续持有期大于等于30天少于90天的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期大于等于90天少于180天的投资人收取0.5%的赎回费,并将赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期大于等于180天少于365天的投资人收取0.5%的赎回费,将赎回费总额的25%计入基金财产;对持续持有期大于等于365天少于730天的投资人收取0.25%的赎回费,将赎回费总额的25%计入基金财产。

基金份额持有人在基金终止上市前持有的原泰和证券投资基金基金份额,持有期限自《嘉实泰和混合型证券投资基金基金合同》生效之日起计算;基金份额持有人通过集中申购和日常申购所得的基金份额,持有期限自注册登记机构确认登记之日起计算。

本基金基金份额的赎回费率具体如下:

| 持有期限（T） | 赎回费率 |
|---|---|
| T<7天 | 1.5% |
| 7天≤T<30天 | 0.75% |
| 30天≤T<365天 | 0.50% |
| 365天≤T<730天 | 0.25% |
| T≥730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和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入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、基金赎回费率。

2、基金的转换费

（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）

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转换为嘉实泰和混合时,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、嘉实如意宝定期债券C转换为嘉实泰和混合时,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。

③嘉实泰和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、嘉实医疗保健股票、嘉实对冲套利定期混合、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实逆向策略股票、沪深300指数研究增强、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、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实新常态混合A、嘉实新常态混合C、嘉实新趋势混合之同互转,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、嘉实中创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、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实增强收益定期债券A、嘉实丰益信用定期债券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。

④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联接转入嘉实泰和混合时,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。

⑤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、嘉实增强收益定期债券A、嘉实丰益信用定期债券A转入嘉实泰和混合时,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

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转换为嘉实泰和混合时,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。

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转换为嘉实泰和混合时,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。

iii 嘉实泰和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、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实对冲套利定期混合、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实逆向策略股票、沪深300指数研究增强、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实先进制造股票、嘉实如意宝定期债券A、嘉实事件驱动股票、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实中证中期企业债指数（LOF）A、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实增强收益定期债券A、嘉实低价策略股票、嘉实丰益信用定期债券A、嘉实环保低碳股票、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实智能汽车股票、嘉实创新成长混合、嘉实新常态混合A、嘉实新常态混合C、嘉实新趋势混合之同互转、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、嘉实如意宝定期债券C、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。

②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）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注1:2014年5月23日起,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,嘉实债券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;2016年4月5日起,嘉实信用债券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500万元,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。2014年9月2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2014年9月5日起,本基金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。

3、在中国证监会规定允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,不需召开基金份额持有人大会,具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明。

（三）不列入基金费用的项目

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,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,基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

（四）费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。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。

（五）基金税收

基金和基金份额持有人根据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,明确了更新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“二、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;更新了相关代销机构的相关信息。

5.在“十、基金转换”部分;更新了基金转换的相关内容。

6.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。

7.“十二、基金的业绩”;基金业绩更新至2016年3月31日。

8.在“二十四、其他应披露事项”部分;列示了本基金自2015年10月4日至2016年4月4日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2016 年5月18日

---

证券代码:600704 证券简称:物产中大 公告编号:2016-041

# 物产中大集团股份有限公司 2015年年度股