（上接B22版）

名称	上海市源泰律师事务所		
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼		
负责人	廖海	联系人	范佳斐
电话	（021）51150298-827	传真	（021）51150398
经办律师	刘佳、范佳斐		

（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号领展企业广场二座普华永道中心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	薛竞、张勇		

四、基金的名称

本基金名称：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：股票型证券投资基金，契约型开放式

六、基金的投资目标

立足于中国特定的投资环境，将自上而下的宏观及行业投资决策模式与自下而上的微观投资决策模式统一于事件分析的投资决策框架之内，在深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资，力争实现投资者的长期稳定增值。

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（包含中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票），股指期货、权证，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）、可交换公司债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等），资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产以及现金，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）。

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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为80%-95%；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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；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

事件性投资是主题性投资在标的股票上的具体表现形式。而相对于主题性投资相对宽泛的投资概念而言，事件性投资更加具体，与标的股票的联系更加紧密。在事件分析的投资决策框架内，事件性投资可以更加科学、有效地捕获事件冲击所带来的超额收益，以更加直观、明确的模式刻画超额收益的持续性，从而使事件性投资的操作和执行也更具针对性和纪律性，确保了超额收益的渐进式稳定增长。

1、大类资产配置

本基金重点配置股票资产，同时从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个纬度进行综合分析。在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

2、股票投资策略

一般来说，对行业或标的资产的当前或者未来价值产生重大影响的事件性信息，会在当前或者未来对标的资产的自身价值产生冲击，而事件冲击的效果最终都通过标的资产的市场价值体现出来。因此，利用数量化的分析模式，深入、细致分析受益于事件冲击或市场价值未能充分体现事件影响的标的股票，在量化评价风险和收益特征的情况下获取稳定的超额收益。

在全面分析、刻画中国A股特征的基础上，本基金形成了四维度的多事件性投资策略体系，从而系统性把握经营与业绩、行为与新闻、投资与融资以及激励与持股四个维度所带来的事件性超额收益。随着资本市场的不断发展和影响上市公司相关事件的不断演变，本基金将动态调整事件库，勤勉谨慎分析各事件信息所带来的投资机会，以期实现基金资产的长期稳定增值。

（1）经营与业绩，关注公司层面的事件性信息冲击

上市公司通过定期和不定期的公司公告，证券分析师通过事件点评、行业分析报告以及深度分析报告，向资本市场传递标的公司在生产、经营、管理、发展战略等多个方面的重要信息，从而对上市公司的资产价格产生的影响。本基金依托嘉实量化投资分析系统，深入挖掘公司经营模式以及公司经营业绩变动带来的事件性投资机会，在事件分析的框架内，考虑超额收益的持续性和稳定性，精选优势事件机会包括但不限于：

①上市公司的业绩预告：以上市公司的业绩预告为事件分析的切入点，关注上市公司的业绩预告超预期对资产价格的冲击和影响。

-② 分析机构对上市公司的调研：基本面分析往往采用市场调研的模式研究分析上市公司的投资价值，以分析机构对上市公司的调研报告发出日为事件分析基点，关注分析机构调研对资产价格的影响模式。

（2）行为与新闻，关注信息优势者的投资节奏

资本市场中，信息优势者的投资行为会在很大程度上影响资产的价格。在牛市行情中，具有信息优势的高级管理层投资介入的股票会具有想象空间，资产价格上涨的空间也更大；而在熊市行情中，由于高级管理层的信息优势，其增持的股票，使股价的支撑作用更加显著。而通过互联网的信息传递功能，投资者可以迅速获得信息优势者的投资行为，从而分享信息优势者的信息优势。本基金将信息优势者的信息优势和市场新闻模式纳入分析，充分利用嘉实量化投资分析系统的大数据挖掘功能，发挥事件分析的分析优势，精选优势事件机会包括但不限于：

① 股票关注度：投资分析师通过对上市公司的行业研究和个股研究，能对上市公司的发展前景以及资产价值，有个清晰明确的认识。依赖于分析师的研究视角，关注分析师大力推进的股票。

② 指数调整：市场主流指数的调入、调出，会对标的股票产生冲击。

③ 调研报告：投资分析师通过对上市公司进行市场调研，会对上市公司的发展前景形成一个比较客观的基本性观点。以分析市场调研报告形成分析样本，以包含对上市公司利好的关键词为切入点，关注资产价格的盈利机会。

（3）投资与融资，关注上市公司的战略发展

上市公司的持续发展，需要明确的发展战略，而体现其发展战略意图的最关键之处就在于上市公司的投资行为和融资行为。上市公司的投资和融资行为可以对上市公司的资产和负债产生深远影响，提升上市公司的市场占有度、降低生产和流通成本，从而对上市公司的资产价格发生。本基金在嘉实量化投资分析系统内，对上市公司的投资及融资行为进行量化分析，采用事件分析的研究模式，精选优势事件机会包括但不限于：

① 上市公司股权变动：上市公司的股权变动，不仅会改变公司的资产结构，也会影响公司的发展战略。将公司股权变动进行量化分析，关注上市公司股权变动所带来的事件性投资机会。

② 上市公司再融资：上市公司由于发展需要而进行再融资，导致上市公司的盈利能力、现金流水平发生变动。将上市公司再融资需要为分析标的，关注上市公司再融资所带来的事件性投资机会。

③ 大小非解禁：上市公司的大小非解禁，会对资产价值产生一定程度的冲击压力。在量化的分析框架内，关注大小非解禁所带来的事件性投资机会。

（4）激励与持股，关注上市公司的经营效率

从公司的经营管理实践来说，对员工和管理层的股权等激励模式，能更好的刺激员工和管理层的主人翁意识，能勤勉、尽职、全新全意地为公司长远发展服务。而公司的激励政策能降低代理成本，提升管理效率，增强市场的竞争能力，同时，公司的激励和管理层持股，也体现了股东和管理者对上市公司发展前景的信心，进而影响市场的资产价格运动趋势。本基金以嘉实量化投资分析系统为运作平台，对上市公司的激励以及持股模式进行量化分析研究，遵循量化投资分析的基本原理，精选优势事件机会包括但不限于：

① 上市公司股权激励：以全市场股票为分析样本，关注上市公司的股权激励计划所带来的事件性投资机会。

② 大股东增持：作为上市公司的主要股东，大股东对本公司股本的增持很大程度上体现了大股东对上市公司未来发展的信心。以上市公司大股东增持事件为基本点，关注大股东增持的事件性机会。

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、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过对中小企业私募债券进行信用评级控制，通过对投资单只中小企业私募债券的比例限制，严格控制风险，对投资单只中小企业私募债券而引起组合整体的利率风险敞口和信用风险敞口变化进行风险评估，并充分考虑单只中小企业私募债券对基金资产流动性造成的影响，通过信用研究和流动性管理后，决定投资品种。

基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

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。

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。

7. 投资决策依据和决策程序

（1）投资决策依据

● 法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金的有关规定。

● 宏观经济和上市公司的基本面数据。

● 投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内，选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

（2）投资决策程序

● 本基金采用投资决策委员会领导下的量化投资决策投资流程。

● 投资决策委员会：投资决策委员会根据本基金的投资目标和投资模式，审核并判断基金经理提出的量化投资决策或重大资产配合方案。

● 量化投资总监：量化投资总监在投资决策委员会授权和认可的投资范围内，负责评估审核量化投资策略的可行性、科学性以及有效性，形成有效的量化投资策略，监督量化投资策略的执行，并组织、管理、协调量化投资的研究工作。

● 量化基金经理：量化基金经理根据量化投资策略的分析框架，严格纪律化执行量化投资策略，确保量化投资策略可以高效执行，实现量化投资的既定目标，并根据量化策略的执行效果进行有效评估，持续改进量化投资策略。

风险管理部根据市场变化对本基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。

九、基金的业绩比较基准

沪深300指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%

其中， 沪深300指数是由中证指数有限公司编制，它的样本选自沪深两个证券市场300只股票，具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国A股市场整体状况和发展趋，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。而中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数。能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年4月18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2018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	4,917,982,997.11	82.61
	其中：股票	4,917,982,997.11	82.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	361,097,712.70	6.07
	其中：债券	361,097,712.70	6.07
	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	200,000,000.00	3.36
	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	345,158,962.07	5.80
8	其他资产	128,964,965.53	2.17
9	合计	5,953,204,637.41	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	4,375,285.00	0.07
B	采矿业	159,053,231.18	2.72
C	制造业	3,425,811,482.77	58.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,342,706.00	0.25
E	建筑业	25,868,735.00	0.44
F	批发和零售业	95,575,110.87	1.63
G	交通运输、仓储和邮政业	24,320,798.38	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	650,303,993.63	11.12
J	金融业	509,525,082.28	8.71
K	房地产业	7,838,110.00	0.13
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	676,260.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	292,202.00	0.00
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	4,917,982,997.11	84.06

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	000651	格力电器	4,624,747	216,900,634.30	3.71
2	300274	阳光电源	10,500,835	201,406,015.30	3.44
3	300136	信维通信	4,232,780	157,925,021.80	2.70
4	601318	中国平安	2,410,953	157,459,340.43	2.69
5	000333	美的集团	2,744,201	149,641,280.53	2.56
6	300098	高新兴	10,420,703	149,432,881.02	2.55
7	600585	海螺水泥	4,643,775	149,390,241.75	2.55
8	002415	海康威视	3,559,100	146,990,830.00	2.51
9	002236	大华股份	4,891,400	125,317,668.00	2.14
10	002008	大族激光	2,148,091	117,500,577.70	2.01

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	360,084,000.00	6.15
	其中：政策性金融债	360,084,000.00	6.15
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）	1,013,712.70	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	361,097,712.70	6.17

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	170410	17农发10	1,400,000	140,056,000.00	2.39
2	150207	15国开07	1,000,000	100,000,000.00	1.71
3	170211	17国开11	800,000	79,992,000.00	1.37
4	170413	17农发13	400,000	40,036,000.00	0.68
5	128017	金禾转债	8,569	1,013,712.70	0.02

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

（1）报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC1804	IC1804	148	179,944,320.00	-2,121,080.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-2,121,080.00
股指期货投资本期收益（元）					16,306,512.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-5,183,880.00

（2）本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资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。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，符合既定的投资政策和投资目标。

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	36,981,928.56
2	应收证券清算款	82,199,136.14
3	应收股利	-
4	应收利息	9,657,866.87
5	应收申购款	126,033.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,964,965.53

（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
2015年6月9日（基金合同生效日）至2015年12月31日	-9.80%	1.71%	-23.67%	2.25%	13.87%	-0.54%
2016年	-8.09%	1.78%	-8.39%	1.12%	0.30%	0.66%
2017年	1.45%	0.82%	17.23%	0.51%	-15.78%	0.31%

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：嘉实事件驱动股票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

（2015年6月9日至2018年3月31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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）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》生效后与基金相关的信息披露费用；

(4)《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

(5)基金份额持有人大会费用；

(6)基金的证券、期货交易费用；

(7)基金的银行汇划费用；

(8)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。

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

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为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（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，经管理人和基金托管人双方核对后，由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

上述“（一）基金费用的种类中第3-8项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

（1）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；

（2）基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

（3）《基金合同》生效前的相关费用；

（4）其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（二）与基金销售有关的费用

1.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（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	按笔收取，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、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。

注：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2015年8月10日起，增加开通本基金在本公司基金网上直销系统的后端收费模式（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，本基金优惠后的费率见下表：

持有期限（T）	基金网上直销后端申购优惠费率
0≤T<1年	0.20%
1年≤T<3年	0.10%
T≥3年	0.00%

本公司直销中心柜台和代销机构暂不开通后端收费模式。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

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天少于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。

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	0.5%
365天≤T<730天	0.25%
T≥730天	0

基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

基金销售机构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，定期或不定期地开展基金促销活动。

3、转换费

本基金转换费用由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成：

（1）通过代销机构办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从低申购费用基金向高申购费用基金转换时，每次收取申购补差费用；从高申购费用基金向低申购费用基金转换时，不收取申购补差费用。申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费用差额进行补差。

（2）通过直销（直销柜台及网上直销）办理基金转换业务（“前端转前端”的模式）

转出基金有赎回费用的，收取该基金的赎回费用。从0申购费用基金向非0申购费用基金转换时，每次按照非0申购费用基金申购费用收取申购补差费；非0申购费用基金互转时，不收取申购补差费用。

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。

（3）通过网上直销系统办理基金转换业务（“后端转后端”模式）

① 若转出基金有赎回费，则仅收取转出基金的赎回费；

② 若转出基金无赎回费，则不收取转换费用。

转出基金有赎回费用的，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。

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：嘉实安心货币、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实信用债券、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实超短债、嘉实多元收益债券、嘉实周期优选混合、嘉实迎向策略股票、嘉实快线货币基金A、嘉实货币、嘉实新兴产业股票、嘉实优化红利混合、嘉实稳华纯债债券、嘉实债券有单日单个基金账户的累计申购（转入）限制，嘉实增长混合、嘉实服务增值行业混合暂停申购和转入业务，具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。定期开放类基金在封闭期内无法转换。

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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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“三、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：更新相关代销机构信息和会计师事务所办公地址。

5.在“九、基金转换”部分：更新了基金转换的相关内容。

6.在“十、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.在“十一、基金的业绩”：基金业绩更新至2018年3月31日。

8.在“二十三、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2017年12月9日至2018年6月9日相关临时公告事项。

9.根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及基金管理人2018年3月22日发布的《关于修改嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同及托管协议的公告》，更新了“基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产的估值、基金的信息披露、风险揭示”等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司
2018年7月21日

人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告

送出日期：二〇一八年七月二十一日

§1 公告基本信息

基金名称	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	人保转型混合	
基金主代码	005953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月21日	
基金管理人名称	中国人保资产管理有限公司	
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	中国人保资产管理有限公司	
公告依据	《证券投资基金信息披露管理办法》、《人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》等	
申购起始日	2018-7-23	
赎回起始日	2018-7-23	
转换转入起始日	--	
转换转出起始日	--	
定期定额投资起始日	2018-7-23	
下属分级基金的基金简称	人保转型混合A	人保转型混合C
下属分级基金的交易代码	005953	005954
该分级基金是否开放申购、赎回(定期定额投资)	是	是

§2 日常申购、赎回（定期定额投资）业务的办理时间

人保转型混合基金的开放日为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

基金合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒介上公告。

§3 日常申购业务

3.1 申购金额限制

投资者通过本基金管理人的网上交易系统和其他基金销售机构申购本基金时，每个基金账户每次单笔申购金额不得低于 10 元（含申购费）；通过本公司直销机构单笔最低申购金额为人民币1万元（含申购费），已在直销机构有认购本基金记录的投资者不受上述首次申购最低金额的限制，追加申购的单笔最低申购金额为人民币10元；各销售机构对最低申购限额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

投资者可多次申购，对单个投资者的累计持有份额不设上限限制，法律法规或中国证监会另有规定的除外。

3.2 申购费率

本基金A 类基金份额在申购时收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费。A类基金份额申购费用由投资人承担，不列入基金财产。投资人在申购A 类基金份额时支付申购费用。C类基金份额的销售服务费按前一日 C类基金份额的基金资产净值的 0.50%年费率计提。

本基金A 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M，含申购费）	申购费率
M<100 万元	1.50%
100万≤M<300万	1.00%
300 万≤M<500万	0.60%
M≥500 万元	1000 元/笔

3.3 其他与申购相关的事项

基金销售机构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开展基金的费率优惠活动，投资者应以各销售机构执行的申购费率为准。

§4 日常赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资者可将全部或部分基金份额赎回。基金份额持有人在销售机构赎回基金份额时，每次赎回申请不得低于100 份基金份额，同时赎回份额必须是整数份额。投资人全额赎回时不受上述限制。每个工作日基金份额持有人在销售机构单个交易账户保留的本基金基金份额余额不足1份时，若当日该账户同时有份额减少类业务（如赎回、转换转出等）被确认，则基金管理人有权将基金份额持有人在该账户保留的本基金基金份额余额一次性同时全部赎回。

为公平对待不同类别基金份额持有人的合法权益，单个基金份额持有人在单个开放日申请赎回基金份额超过基金总份额10%的，基金管理人可以采取延期办理部分赎回申请或者延缓支付赎回款项的措施。具体可参照《人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》巨额赎回中关于部分延期赎回、延缓支付赎回款项的规则办理。

4.2 赎回费率

赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。本基金的赎回费率随基金份额持有时间的增加而递减。

（1）本基金A 类基金份额的赎回费率如下：

持有时间（T）	赎回费率
T<7 日	1.50%
7 日≤T<30日	0.75%
30 日≤T<1年	0.50%
1年≤T<2年	0.25%
T≥2年	0.00%

注：上表中的“年”指的是365个自然日。

对持续持有期少于30 日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期等于或长于30 日、少于3 个月的投资人收取的赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期等于或长于3 个月但少于6个月的投资人收取的赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期等于或长于6 个月的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。上述“月”指的是30个自然日。

（2）本基金C 类基金份额的赎回费率如下：

持有时间（T）	赎回费率
T<7 日	1.50%
7 日≤T<30 日	0.50%
T≥30 日	0.00%

注:对于C 类基金份额，收取的赎回费应当全额计入基金财产。

4.3 其他与赎回相关的事项

无。

§5 定期定额投资业务

（1）本基金自2018年7月23日起在各基金销售机构开通定期定额投资业务。

（2）投资者可通过有关销售机构提出申请，自行约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，每期最低扣款金额不得低于 10 元（含申购费），如销售机构最低定期定额申购额高于10元，则以销售机构规定的限额为准。

（3）投资者通过各基金销售机构办理本基金定期定额投资业务的，相关流程和业务规则请遵循各基金销售机构的有关规定。

§6 基金销售机构

6.1 场外销售机构

6.1.1 直销机构

直销机构：中国人保资产管理有限公司

直销柜台：北京市西城区西长安街88号8层

电话：010-69009696；021-38571919

传真：021--50765598

联系人：常静怡

中国人保资产公募基金网上直销系统：https://e.piccamc.com

人保资产公募微信公众账号：piccamcfund或微信搜索“人保资产基金”进行账户绑定、交易、查询功能。

客服电话：400-820-7999

客服信箱：service@piccamc.com

6.1.2 场外非直销机构

中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、招商证券股份有