（上接 B38 版）

(118)湘财证券股份有限公司

住所	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼		
办公地址	湖南省长沙湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼		
注册地址	湖南省长沙湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼		
法定代表人	林俊波	联系人	李欣
电话	(021)38784580	传真	(021)68865680
网址	http://www.xcsc.com	客服电话	95351

(119)万联证券股份有限公司

住所	广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层		
办公地址	广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 F 座 18、19 楼		
注册地址	广州市天河区珠江东路 11 号 18、19 楼全层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	(020)37865070	传真	020-22373718-1013
网址	http://www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

(120)民生证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层		
注册地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16 层--18 层		
法定代表人	冯鹤年	联系人	赵明
电话	(010)85127766	传真	(010)85127917
网址	http://www.mszq.com/	客服电话	400-619-8888

(121)国元证券股份有限公司

住所	安徽省合肥市寿春路 179 号		
办公地址	安徽省合肥市梅山路 18 号		
注册地址	安徽省合肥市梅山路 18 号		
法定代表人	蔡咏	联系人	陈玲玲
电话	(0551)2246273	传真	(0551)2272100
网址	http://www.gyzq.com.cn	客服电话	95578

(122)渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
办公地址	天津市南开区宾水西道 8 号		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
法定代表人	王春峰	联系人	蔡霆
电话	(022)28451991	传真	(022)28451892
网址	http://www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(123)山西证券股份有限公司

住所	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
办公地址	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心西塔楼 21 层		
注册地址	山西省太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	(0351)8686659	传真	(0351)8686619
网址	http://www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

(124)东兴证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层		
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)6、10、12、15、16 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)12、15 层		
法定代表人	魏庆华	联系人	汤漫川
电话	(010)66555316	传真	(010)66555246
网址	http://www.dxzq.net	客服电话	400-8888-993

(125)东吴证券股份有限公司

住所	苏州工业园区星阳街 5 号		
办公地址	江苏省苏州工业园区星阳街 5 号		
注册地址	江苏省苏州工业园区星阳街 5 号		
法定代表人	范力	联系人	方晓丹
电话	(0512)65581136	传真	(0512)65588021
网址	http://www.dwzq.com.cn	客服电话	95330

(126)信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
注册地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
法定代表人	张志刚	联系人	尹旭航
电话	(010)63081493	传真	(010)63081344
网址	http://www.cindasc.com	客服电话	95321

(127)南京证券股份有限公司

住所	南京市江东中路 389 号		
办公地址	江苏省南京市江东中路 389 号		
注册地址	江苏省南京市江东中路 389 号		
法定代表人	步国旬	联系人	王万君
电话	(025)58519523	传真	(025)83369725
网址	http://www.njzq.com.cn	客服电话	95386

(128)上海证券有限责任公司

住所	上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼		
办公地址	上海市西藏中路 336 号华旭国际大厦 6 楼		
注册地址	上海市西藏中路 336 号		
法定代表人	李俊杰	联系人	邵珍珍
电话	(021)53686888	传真	(021)53686100-7008
网址	http://www.shzq.com	客服电话	(021)962518、4008918918

(129)新时代证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501		
注册地址	北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501		
法定代表人	叶顺德	联系人	田芳芳
电话	(010)83561146		
网址	http://www.xsdzq.cn	客服电话	95399

(130)大同证券有限责任公司

住所	大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层		
办公地址	山西省太原市小店区长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层		
注册地址	大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351)4130322	传真	(0351)4130322
网址	http://dtsbc.com.cn/	客服电话	4007121212

(131)国联证券股份有限公司

办公地址	无锡市金融一街 8 号		
注册地址	江苏省无锡市金融一街 8 号		
法定代表人	姚志勇	联系人	祁昊
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	http://www.glsc.com.cn	客服电话	95570

(132)浙商证券股份有限公司

住所	浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6-7 楼		
办公地址	浙江省杭州市五星路 201 号		
注册地址	浙江省杭州市五星路 201 号		
法定代表人	吴承根	联系人	许嘉行
电话	(0571)87901912	传真	(0571)87901913
网址	http://www.stocke.com.cn	客服电话	(0571)967777

(133)平安证券股份有限公司

住所	深圳市福田中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层		
办公地址	深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层		
注册地址	深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层		
法定代表人	刘世安	联系人	周一涵
电话	021-38637436	传真	021-58991896
网址	http://www.stock.pingan.com	客服电话	95511一 8

(134)国海证券股份有限公司

住所	广西桂林市辅星路 13 号		
办公地址	广西壮族自治区南宁市滨湖路 46 号国海大厦		
注册地址	广西壮族自治区桂林市辅星路 13 号		
法定代表人	何春梅	联系人	牛孟宇
电话	0755-83709350	传真	0771-5530903
网址	http://www.ghzq.com.cn	客服电话	95563(全国)

(135)东莞证券股份有限公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼		
注册地址	广东东莞市莞城区可园南路 1 号		
法定代表人	张运勇	联系人	李荣
电话	(0769)22115712	传真	(0769)22115712
网址	http://www.dgzq.com.cn	客服电话	95328

(136)中原证券股份有限公司

住所	郑州市郑东新区商务外环路 10 号		
办公地址	河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号		
注册地址	河南省郑州市郑东新区商务外环路 10 号		
法定代表人	菅明军	联系人	程月艳、李盼盼
电话	0371--69099882	传真	0371--65585899
网址	http://www.ccnew.com	客服电话	95377

(137)国都证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层		
注册地址	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层		
法定代表人	翁振杰	联系人	黄静
电话	(010)84183389	传真	(010)84183311
网址	http://www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(138)东海证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层		
注册地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层		
法定代表人	赵俊	联系人	王一彦
电话	(021)20333333	传真	(021)50498825
网址	http://www.longone.com.cn	客服电话	95531;400-888-8588

(139)中银国际证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层		
办公地址	中国上海市浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层		
注册地址	上海市中山南路 318 号 2 号楼 31 层		
法定代表人	林景臻	联系人	王炜哲
传真	(021)50372474		
网址	http://www.bocifunds.com	客服电话	4006208888

(140)恒泰证券股份有限公司

住所、办公地址	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼		
注册地址	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼		
法定代表人	庞介民	联系人	熊丽
电话	(0471)4972675		
网址	http://www.cnht.com.cn	客服电话	4001966188

(141)国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路 88		
办公地址	江西省南昌市北京西路 88 号		
注册地址	江西省南昌市西湖区北京西路 88 号(江信国际金融大厦)		
法定代表人	徐丽峰	联系人	周欣玲
电话	(0791)86281305	传真	(0791)86281305
网址	http://www.gsstock.com	客服电话	4008222111

(142)金元证券股份有限公司

住所	海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层		
办公地址	海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼		
注册地址	海口市南宝路 36 号证券大厦 4 楼		
法定代表人	王作义	联系人	马贤清
电话	(0755)83025022	传真	(0755)83025625
网址	http://www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(143)德邦证券股份有限公司

住所	上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼		
办公地址	上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 29 楼		
注册地址	上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼		
法定代表人	武晓春	联系人	罗芳
电话	(021)68761616	传真	(021)68767981
网址	http://www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

(144)西部证券股份有限公司

住所	陕西省西安市东新街 232 号信托大厦 16-17 楼		
办公地址	陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室		
注册地址	陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室		
法定代表人	徐朝晖	联系人	梁承华
电话	(029)87416168	传真	(029)87406710
网址	http://www.west95582.com	客服电话	95582

(145)华龙证券股份有限公司

住所	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心		
办公地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼		
注册地址	甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	(0931)4890208	传真	(0931)4890628
网址	http://www.hlzq.com	客服电话	(0931)96668、4006898888

(146)财通证券股份有限公司

住所	杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心		
办公地址	浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716 室		
注册地址	浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心 201,501,502,1103,1601-1615,1701-1716 室		
法定代表人	陆建强	联系人	陶志华
电话	0571 - 87789160	传真	0571-87818329
网址	http://www.ctsec.com	客服电话	(0571)96336、962336(上海地区)

(147)上海华信证券有限责任公司

办公地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼		
法定代表人	陈灿辉	联系人	倪丹
电话	021-38784818?	传真	021-68775878
网址	http://www.shhxzq.com/	客服电话	68777877

(148)华鑫证券有限责任公司

住所	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b)单元		
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		
注册地址	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	俞洋	联系人	杨莉娟
电话	021-54967552	传真	021-54967032
网址	http://www.cfsc.com.cn	客服电话	021-32109999;029-68918888;4001099918

(149)瑞银证券有限责任公司

住所	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
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、15 层		
注册地址	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	钱于军	联系人	牟冲
电话	(010)58328112	传真	(010)58328748
网址	http://www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

(150)中山证券有限责任公司

办公地址	广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 座 15 层		
注册地址	深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层		
法定代表人	黄扬录	联系人	罗艺琳
电话	0755-82570586	传真	0755-82960582
网址	http://www.zszq.com.cn	客服电话	95329

(151)国融证券股份有限公司

住所	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		
办公地址	呼和浩特市新城区锡林南路 18 路		
注册地址	内蒙古自治区呼和浩特市武川县腾飞大道 1 号 4 楼		
法定代表人	张智河	联系人	董晶姗
电话	(010)83991737	传真	(010)66412537
网址	http://www.grzq.com	客服电话	4006609839

(152)江海证券有限公司

办公地址	哈尔滨市松北区创新三路 833 号		
注册地址	哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	周俊
电话	0451-85863726	传真	0451-82337279
网址	http://www.jhzq.com.cn/	客服电话	400-666-2288

(153)国金证券股份有限公司

办公地址	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号成证大厦 16 楼		
注册地址	四川省成都市青羊区东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	刘婧漪、贾鹏
电话	028-86690057、028-86690058	传真	028-86690126
网址	http://www.gjzq.com.cn	客服电话	95310

(154)中国民族证券有限责任公司

住所	北京市朝阳区北四环中路盘古大观 A 座 40 层		
办公地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 40 层-43 层		
注册地址	北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼		
法定代表人	何亚刚	联系人	齐冬妮
电话	(010)59355807	传真	(010)56437013
网址	http://www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

(155)华宝证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号 57 层		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	(021)68777222	传真	(021)68777822
网址	http://www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

(156)长城国瑞证券有限公司

住所	厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼		
办公地址	厦门市思明区深田路 46 号深田国际大厦 20 楼		
注册地址	厦门市思明区莲前西路 2 号莲富大厦 17 楼		
法定代表人	王勇	联系人	林丹
电话	(0592)2079259	传真	(0592)2079602
网址	https://www.gwgsc.com/	客服电话	400-0099-886

(157)爱建证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼(陆家嘴商务广场)		
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 1600 号 1 幢 32 楼		
法定代表人	祝健	联系人	陈敏
电话	(021)32229888	传真	021- 68728782
网址	http://www.ajzq.com	客服电话	(021)63340678

(158)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	北京朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 18 层		
注册地址	北京市西城区金融大街 8 号		
法定代表人	祝献忠	联系人	李慧灵
电话	010-85556100	传真	010-85556088
网址	http://www.hrsec.com.cn	客服电话	400-898-4999

(159)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	岑妹妹
电话	027-87617017	传真	027-87618863
网址	http://www.tfzq.com	客服电话	4008005000

(160)中国邮政储蓄银行股份有限公司

办公地址	北京市西城区金融大街 3 号 A 座		
注册地址	北京市西城区金融大街 3 号		
法定代表人	李国华	联系人	王硕
传真	(010)68858057		
网址	http://www.psbc.com	客服电话	95580

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金和嘉实债券基金

(161)上海银行股份有限公司

住所、办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号		
注册地址	上海市自由贸易试验区银城中路 168 号		
法定代表人	金煜	联系人	汤征程
电话	021-68475888	传真	021-68476111
网址	http://www.bosc.cn	客服电话	95594

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金和嘉实债券基金

(162)广发银行股份有限公司

住所	广东省广州市农林下路 83 号		
办公地址	广州市越秀区东风东路 713 号		
注册地址	广州市越秀区东风东路 713 号		
法定代表人	杨明生	联系人	詹全鑫、张扬眉
电话	(020)38322256	传真	(020)87310955
网址	http://www.cgbchina.com.cn	客服电话	800 -830 -8003、400 -830 -8003

注:此代销机构仅代销嘉实债券基金

(163)重庆农村商业银行股份有限公司

办公地址	重庆市江北区金沙门路 36 号		
注册地址	重庆市江北区金沙门路 36 号		
法定代表人	刘建忠	联系人	范亮
电话	023-67637962	传真	023-67637709
网址	http://www.cqrcb.com	客服电话	966866

注:此代销机构仅代销嘉实债券基金

(164)成都农村商业银行股份有限公司

办公地址	四川省成都市武侯区科华中路 88 号		
注册地址	四川省成都市武侯区科华中路 88 号		
法定代表人	陈萍	联系人	杨琪
电话	028-85315412	传真	028-85190961
网址	http://www.cdrcb.com/	客服电话	95392

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金

(165)吉林银行股份有限公司

办公地址	长春市经济开发区东南湖大跌 1817 号		
注册地址	经济开发区东南湖大路 1817 号		
法定代表人	张宝祥	联系人	孟明
电话	0431-84992680	传真	0431-84992649
网址	http://www.jlbank.com.cn/publish/portal0/	客服电话	4008896666

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金和嘉实债券基金

(166)威海市商业银行股份有限公司

办公地址	山东省威海市宝泉路 9 号		
注册地址	山东省威海市宝泉路 9 号		
法定代表人	谭先国	联系人	刘文静
电话	0631-5211651	传真	0631-5215726
网址	whshls@163.com	客服电话	4000096636

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金

(167)浙江温州龙湾农村商业银行股份有限公司

办公地址	温州市龙湾区永中街道永宁西路 555 号		
注册地址	温州市龙湾区永中街道永宁西路 555 号		
法定代表人	刘少云	联系人	胡俊杰
电话	0577-86923223	传真	0577-86982650
网址	http://www.lwrcb.com/	客服电话	4008296596

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金和嘉实债券基金

(168)华融湘江银行股份有限公司

办公地址	湖南省长沙市湘府东路二段 208 号万镜财智中心南栋华融湘江银行		
注册地址	湖南省长沙市天心区芙蓉南路 828 号鑫远杰座大厦		
法定代表人	张永宏	联系人	杨舟
电话	0731-89828900		
网址	www.hrxjbank.com.cn	客服电话	0731-96599

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金

(169)贵阳银行股份有限公司

办公地址	贵州省贵阳市云岩区中华北路 77 号		
注册地址	贵州省贵阳市云岩区中华北路 77 号		
法定代表人	陈宗权	联系人	黎荣荣
电话	18092299120	传真	0851-86851953
网址	http://www.bankgy.cn	客服电话	4001196033

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金

(170)青岛农村商业银行股份有限公司

办公地址	山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 1 号楼		
注册地址	山东省青岛市崂山区秦岭路 6 号 1 号楼		
法定代表人	刘仲生	联系人	李洪姣
电话	0532-66957228	传真	0532-85933730
网址	http://www.qrcb.com.cn	客服电话	400-11-96668

注:此代销机构仅代销嘉实增长基金和嘉实债券基金

(171)江苏紫金农村商业银行股份有限公司

办公地址	南京市建邺区江东中路 381 号		
注册地址	江苏省南京市建邺区江东中路 381 号		
法定代表人	张小军	联系人	游丹
电话	025-88866645	传真	025-88866724
网址	http://www.zjrcbank.com/	客服电话	96008

注:此代销机构仅代销嘉实稳健基金

注:基金管理人于 2005 年 1 月 27 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的基金申购业务的公告》,从即日起暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的嘉实理财通系列证券投资基金(暨嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券)的申购业务。对于此前通过闽发证券、汉唐证券认购、申购的嘉实理财通系列证券投资基金(暨嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券)基金份额,基金份额持有人仍可在闽发证券、汉唐证券正常办理赎回或转托管业务。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本系列基金,并及时公告。

(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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)		
住所	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层		
法定代表人	葛明	联系人	李慧民
电话	(010)65246688	传真	(010)85188298
经办注册会计师	李慧民、王珊珊		

四、基金的名称

本系列基金名称:嘉实理财通系列开放式证券投资基金

五、基金的类型

本系列基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

1. 嘉实增长混合:投资于具有高速成长潜力的中小企业上市公司,以获取未来资本增值的机会,并谋求基金资产的中长期稳定增值,同时通过分散投资提高基金资产的流动性。

2. 嘉实稳健混合:在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下,以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。

3. 嘉实债券:以本金安全为前提,追求较高的组合回报。

七、基金的投资方向

1. 嘉实增长混合:本基金限于投资具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的中、小市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资重点是在流通市值占市场后 50%的上市公司中寻找具有高速成长潜力的中、小市值上市公司,投资于中、小市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。

2. 嘉实稳健混合:本基金限于投资具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中,投资重点是在流通市值占市场前 50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司,投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。

3. 嘉实债券:主要投资于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、企业(公司)债(包括可转债)、回购,以及中国证监会允许基金投资的其它固定收益类金融工具。本基金还可择机参与新股申购,但新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

1. 嘉实增长混合

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制订大类资产配置比例的基础上,本基金重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,从公司基本面分析入手挑选具有成长潜力的股票。

a. 资产配置

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。在正常市场状况下,股票投资比例浮动范围:40%–75%;债券投资比例浮动范围:20%–55%,现金留存比例:5%左右。

b. 股票选择

本基金重点投资于预期利润或收入具有良好增长潜力的成长型上市公司的股票,从公司基本面的分析入手,挑选具有成长潜力的股票。本基金将重点在流通市值占市场后 50%的上市公司中选择具有如下特征的公司:

(i) 股本规模相对较小的中小型上市公司,主营业务突出,过去两年主营业务收入占总收入 80%以上,预期未来具有较强的股本扩张能力。

(ii) 公司所处的行业发展前景良好,公司在本行业内具有独特的竞争优势,能充分把握行业发展的机遇,主营业务收入的增长率高于 GDP 增长率,预期净利润增长率大于 10%。

(iii) 公司的经营模式和技术创新能力与同行相比保持相对优势,能够不断推出符合市场需求的新产品,满足市场需要。

(iv) 公司管理层具有良好的应变能力,能够对外部环境变化迅速作出反应。

基金管理人建立了一套基于成长性的上市公司综合评价指标体系,通过对上市公司所处行业的持续增长潜力及其在行业中的竞争地位、包括盈利能力和偿债能力在内的财务状况、企业的经营管理能力及研发能力等多方面的因素进行评估,综合考察上市公司的成长性以及这种成长性的可靠性和持续性,结合其股价所对应的市盈率水平与其成长性相比是否合理,作出具体的投资决策。

c. 债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和 GDP 增长等因素。本基金可投资于国债、金融债和企业(公司)债(包括可转债),以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求,国债投资比例不低于基金资产的 20%。

2. 嘉实稳健混合

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制订大类资产配置比例的基础上,本基金重点投资于具有竞争优势的行业龙头、优势企业的上市公司的股票,通过基本面分析挖掘行业优势企业,获取稳定的长期回报。

a. 资产配置

在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。在正常市场状况下,投资组合中股票投资比例浮动范围:40%–75%;债券投资比例浮动范围:20%–55%,现金留存比例:5%左右。

b. 股票选择

主要投资于那些具有竞争优势的行业龙头、优势企业。

本基金将重点在流通市值占市场前 50%的上市公司中选择具有如下特征的公司:

(i) 行业发展状况良好,企业已经经历了一段快速成长期,步入稳定发展阶段,企业具备较强的抗风险能力,已经或即将成为行业的龙头、优势企业,企业经营在相对稳健的同时能够保持一定的持续成长能力;

(ii)企业市场竞争能力强,盈利能力稳定,主营业务利润率大于当年行业平均水平,预期主营业务收入增长率超过行业平均水平;

(iii)良好的财务状况,财务管理能力较强,现金收支安排有序,资产盈利水平较高,剔除资产负债率大于 85%的公司(金融行业上市公司除外),具备潜在的良好的分红能力;

(iv)企业在产品开发、技术进步方面具有相当的竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应。

c. 债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;另一方面考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和 GDP 增长等因素。本基金可投资于国债、金融债和企业(公司)债(包括可转债),以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求,国债投资比例不低于基金资产的 20%。

3. 嘉实债券

在有效管理风险的基础上,采取主动的自上而下的投资策略,通过对投资组合的相对价值分析,充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会;应用久期调整、凸度挖掘、息差比较等策略构建组合,实现基金的保值增值。

a. 资产配置

本基金资产配置的基本原则是:充分比较各类资产的预期风险收益状况,在满足组合流动性要求的条件下,追求尽可能高的组合收益率。本基金投资于国债及信用等级为 BBB 级及以上(或者有高信用等级机构或相当优质资产担保)的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券的比例不低于基金非现金资产的 80%。

(i) 类属配置

整个债券组合中类属债券投资中轴配置比例为:银行间国债 40%,交易所国债 30%,金融债 20%,企业债 10%。

如果流动性改善的趋势持续,将在现有的类属债券投资中轴配置比例的基础上,考虑增持金融债与企业债。增持后,两者比例合计最多可以达到 50%的上限。

(ii) 期限配置

投资组合中债券的剩余期限的配置是债券投资中资产配置的另一个重要方面,与期限结构配置相关的因素主要是市场利率水平的变化方向和幅度的大小,本基金将结合收益率曲线变化的预测,采取两种策略进行期限结构配置:首先是采用主动型的策略,直接进行期限结构配置,通过分析和情景测试,确定短、中、长期三类债券的投资比例;然后与数量化方法相结合,完成投资组合中债券的期限结构配置。

(iii) 浮息债券和固息债券的配置

浮息债券具有规避利率上涨风险的功能,但是浮息债券在规避利率上涨风险的同时,还要承担收益率较低的风险。因此,将从两方面确定固息债券和浮息债券的投资比例,一是利率走势的判断,如果判断利率水平上涨,本基金将增加浮息债券的投资比例。二是比较短期债券和浮息债券的当期收益状况,用浮息债券代替短期债券,提高组合的收益水平。

b. 组合构建策略

在确定每类属资产配置以后,在每一类属债券内部,本产品采取一系列策略构建债券投资组合。本基金产品的组合构建策略主要包括:久期调整、凸度挖掘、波动性交易、品质互换、回购套利等。

c. 债券选择标准

本基金的选券基本标准为:在符合本基金产品资产配置策略和组合构建策略的条件下,选择能够保持策略延续性和稳定性、投资组合流动性及风险控制要求的债券。

(i)符合实施前述的资产配置策略、投资策略的要求;

(ii)保持投资策略的延续性和稳定性;

(iii)符合风险管理指标,包括 VaR 和流动性指标的要求;

(iv)价值严重被低估且符合投资总体理念的要求;

(v)降低积极管理风险的要求;

(vi)银行间市场询价达到三家以上;

(vii)在其他条件相同时,优先选择双边报价商报价债券列表中的债券;

(viii)优先选择央行公开市场操作的品种。

(二)投资管理程序

1、研究部通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告,为投资决策委员会和基金经理小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下,基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金的合同规定,提出下一阶段本系列基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例,并制订基金在其他重要股票资产类别上的具体配置计划。

3、投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据基金投资目标和对市场的判断决定本系列基金的总体投资策略,审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资目标,构建投资组合。

5、基金经理小组将投资指令下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

6、风险控制委员会根据市场变化对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。监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

7、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购、赎回和转换导致的现金流量变化情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态调整。

8、在确保基金份额持有人利益的前提下,基金管理人有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。

九、基金的业绩比较基准

嘉实增长混合:60%*巨潮 500(小盘)指数收益率 +40%*中债总指数收益率

嘉实稳健混合:60%*巨潮 200(大盘)指数收益率 +40%*中债总指数收益率

嘉实债券:中央国债登记结算公司的中国债券指数

十、基金的风险收益特征

1.嘉实增长混合:本基金属于中高风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的 β 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

2.嘉实稳健混合:本基金属于中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的 β 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

3.嘉实债券:本基金属于低风险证券投资基金,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金,高于货币市场基金。

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。

本系列基金托管人中国银行股份有限公司根据本系列基金合同规定,于 2018 年 7 月 16 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 6 月 30 日("报告期末"),本报告所列财务数据未经审计。

1.嘉实增长混合

(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	1,490,037,447.22	72.20
	其中:股票	1,490,037,447.22	72.20
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	484,806,859.00	23.49
	其中:债券	484,806,859.00	23.49
	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	69,474,521.52	3.37
8	其他资产	19,480,539.51	0.94
9	合计	2,063,799,367.25	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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	1,268,307,779.05	61.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	–	–
F	批发和零售业	39,699,946.84	1.93
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	–	–
J	金融业	–	–
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	81,226.14	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	150,950,102.34	7.35
R	文化、体育和娱乐业	30,926,833.00	1.51
S	综合	–	–
	合计	1,490,037,447.22	72.56

(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	000661	长春高新	822,490	187,280,973.00	9.12
2	600763	通策医疗	3,101,502	150,950,102.34	7.35
3	300567	精测电子	1,479,155	117,740,738.00	5.73
4	600062	华润双鹤	4,327,093	106,230,133.15	5.17
5	600271	航天信息	4,174,600	105,492,142.00	5.14
6	600809	山西汾酒	1,581,230	99,443,554.70	4.84
7	600872	中炬高新	3,493,566	97,819,848.00	4.76
8	002032	苏泊尔	1,897,469	97,719,653.50	4.76
9	002236	大华股份	4,191,636	94,521,391.80	4.60
10	002179	中航光电	2,009,930	78,387,270.00	3.82

(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	4,882,094.00	0.24
2	央行票据	–	–
3	金融债券	479,924,765.00	23.37
	其中:政策性金融债	479,924,765.00	23.37
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	–	–
10	合计	484,806,859.00	23.61

(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	180404	18农发 04	1,200,000	120,360,000.00	5.86
2	170311	17进出 11	1,200,000	120,204,000.00	5.85
3	140323	14进出 23	800,000	81,024,000.00	3.95
4	180201	18国开 01	500,000	50,150,000.00	2.44
5	170211	17国开 11	500,000	50,065,000.00	2.44

(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	429,364.20
2	应收证券清算款	8,238,850.75
3	应收股利	–
4	应收利息	10,034,759.48
5	应收申购款	777,565.08
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	19,480,539.51

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。

2.嘉实稳健混合

(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	1,979,089,843.62	66.59
	其中:股票	1,979,089,843.62	66.59
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	812,869,789.10	27.35
	其中:债券	812,869,789.10	27.35
	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	166,101,621.00	5.59
8	其他资产	14,186,421.79	0.48
9	合计	2,972,247,675.51	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	66,410,453.02	2.24
B	采矿业	164,055,697.92	5.53
C	制造业	664,847,166.59	22.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	490.53	0.00
F	批发和零售业	221,383,331.65	7.47
G	交通运输、仓储和邮政业	123,445,967.40	4.16
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,251,074.24	2.10
J	金融业	448,182,567.78	15.12
K	房地产业	115,351,491.28	3.89
L	租赁和商务服务业	112,934,768.82	3.81
M	科学研究和技术服务业	–	–
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	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	74,048.40	0.00
R	文化、体育和娱乐业	–	–
S	综合	–	–
	合计	1,979,089,843.62	66.75

(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	3,272,031	157,875,495.75	5.32
2	600036	招商银行	5,499,945	145,418,545.80	4.90
3	000651	格力电器	2,098,100	98,925,415.00	3.34
4	601088	中国神华	4,499,918	89,728,364.92	3.03
5	600703	三安光电	4,566,691	87,771,801.02	2.96
6	601336	新华保险	1,824,113	78,217,965.44	2.64
7	000063	中兴通讯	5,554,362	72,373,336.86	2.44
8	601888	中国国旅	990,353	63,788,636.73	2.15
9	000001	平安银行	6,497,800	59,065,002.00	1.99
10	601899	紫金矿业	15,953,300	57,591,413.00	1.94

(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	250,225,000.00	8.44
2	央行票据	–	–
3	金融债券	562,564,000.00	18.97
	其中:政策性金融债	562,564,000.00	18.97
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)	80,789.10	0.00
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	812,869,789.10	27.42

(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	120009	12附息国债 09	2,500,000	250,225,000.00	8.44
2	170211	17国开 11	2,400,000	240,312,000.00	8.11
3	110208	11国开 08	1,000,000	101,490,000.00	3.42
4	170308	17进出 08	800,000	80,000,000.00	2.70
5	180404	18农发 04	500,000	50,150,000.00	1.69

(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声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

(1)2018 年 5 月 4 日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银监罚决字〔2018〕1 号),对招商银行股份有限公司内控管理严重违反审慎经营规则,违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款等违规事实,于 2018 年 2 月 12 日作出行政处罚决定,罚款 6570 万元,没收违法所得 3.024 万元,罚没合计 6573.024 万元。

本基金投资于"招商银行(600036)"的决策程序说明:基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于"招商银行"股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。

(2)报告期内本基金投资的前十名证券中,其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	470,567.86
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	13,377,326.28
5	应收申购款	338,527.65
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	14,186,421.79

④报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	80,789.10	0.00

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。

3.嘉实债券

(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	–	–
	其中:股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,373,398,745.80	97.19
	其中:债券	2,373,398,745.80	97.19
	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	11,469,384.95	0.47
8	其他资产	57,080,292.36	2.34
9	合计	2,441,948,423.11	100.00

(2)报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

(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

报告期末,本基金未持有股票。

(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	9,750,748.70	0.48
2	央行票据	–	–
3	金融债券	440,726,454.40	21.62
	其中:政策性金融债	440,726,454.40	21.62
4	企业债券	549,177,254.10	26.94
5	企业短期融资券	30,240,000.00	1.48
6	中期票据	1,312,342,000.00	64.37
7	可转债(可交换债)	31,162,288.60	1.53
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	2,373,398,745.80	116.42

(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	180205	18国开 05	800,000	83,896,000.00	4.12
2	122660	12石油 07	800,010	80,473,005.90	3.95
3	180208	18国开 08	700,000	70,105,000.00	3.44
4	101780008	17招商蛇口 MTN002	600,000	60,450,000.00	2.97
5	112546	17万科 01	600,000	59,694,000.00	2.93

(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	14,086.75
2	应收证券清算款	12,595,840.52
3	应收股利	–
4	应收利息	44,393,827.75
5	应收申购款	76,537.34
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	57,080,292.36

④报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	7,136,103.60	0.35
2	128029	太阳转债	3,415,134.20	0.17

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,本基金未持有股票。

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系列基金的招募说明书。

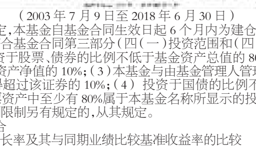
(一)嘉实增长混合

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
2003年 7 月 9 日至 2003 年 12 月 31 日	6.49%	0.41%	–17.35%	1.16%	23.84%	–0.75%
2004年度	15.56%	0.89%	–15.41%	1.52%	30.97%	–0.63%
2005年度	8.85%	0.93%	–13.29%	1.67%	22.14%	–0.74%
2006年度	114.77%	1.16%	92.66%	1.59%	22.11%	–0.43%
2007年度	107.39%	1.60%	197.05%	2.59%	–89.66%	–0.99%
2008年度	–39.36%	1.76%	–58.35%	1.92%	18.99%	–0.16%
2009年度	60.33%	1.37%	134.03%	2.28%	–73.70%	–0.91%
2010年度	24.87%	1.20%	11.30%	1.80%	13.57%	–0.60%
2011年度	–18.72%	0.95%	–32.34%	1.55%	13.62%	–0.60%
2012年度	5.55%	0.95%	0.39%	1.59%	5.16%	–0.64%
2013年度	14.12%	1.12%	18.38%	1.46%	–4.26%	–0.34%
2014年度	14.88%	1.00%	41.15%	1.27%	–26.27%	–0.27%
2015年度	67.43%	2.28%	57.66%	2.38%	9.77%	–0.10%
2016年度	–7.80%	1.41%	–9.54%	1.19%	1.74%	0.22%
2017年度	3.13%	0.79%	–6.32%	0.56%	9.45%	0.23%
2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2.50%	1.19%	–8.88%	0.85%	11.38%	0.34%

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:嘉实增长混合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



(2003 年 7 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日)

注:按基金合同规定,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各项资产配置比例符合基金合同第三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(5)本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

(二)嘉实稳健混合

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
2003年 7 月 9 日至 2003 年 12 月 31 日	6.29%	0.55%	–3.73%	0.94%	10.02%	–0.39%
2004年度	2.23%	0.91%	–15.97%	1.28%	18.20%	–0.37%
2005年度	2.96%	0.87%	–7.37%	1.31%	10.33%	–0.44%
2006年度	101.90%	1.10%	122.43%	1.38%	–20.53%	–0.28%
2007年度	123.76%	1.73%	156.00%	2.26%	–32.24%	–0.53%
2008年度	–51.26%	1.93%	–64.24%	3.01%	12.98%	–1.08%
2009年度	42.07%	1.24%	95.84%	2.03%	–53.77%	–0.79%
2010年度	–5.54%	0.94%	–13.35%	1.56%	7.81%	–0.62%
2011年度	–17.63%	0.89%	–21.72%	1.27%	4.09%	–0.38%
2012年度	0.68%	0.90%	11.27%	1.24%	–10.59%	–0.34%
2013年度	13.74%	1.05%	–7.65%	1.42%	21.39%	–0.37%
2014年度	12.34%	0.98%	52.42%	1.24%	–40.08%	–0.26%
2015年度	30.71%	2.17%	8.57%	2.16%	22.14%	0.01%
2016年度	–11.17%	1.24%	–5.86%	0.83%	–5.31%	0.41%
2017年度	22.00%	0.64%	13.32%	0.39%	8.68%	0.25%
2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	–13.32%	0.94%	–5.75%	0.69%	–7.57%	0.25%

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

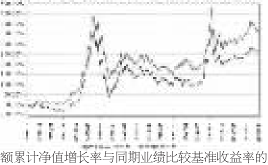


图:嘉实稳健混合份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日)

注:按基金合同规定,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三部分(四(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;(3)本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(5)本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

(三)嘉实债券

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
2003年 7 月 9 日至 2003 年 12 月 31 日	0.70%	0.15%	–1.24%	0.31%	1.94%	–0.16%
2004年度	–7.45%	0.27%	–2.42%	0.35%	–5.03%	–0.08%
2005年度	13.14%	0.19%	10.55%	0.18%	2.59%	0.01%
2006年度	27.17%	0.55%	2.62%	0.09%	24.55%	0.46%
2007年度	30.28%	0.41%	–1.80%	0.08%	32.08%	0.33%
2008年度	0.41%	0.31%	14.89%	0.21%	–14.48%	0.10%
2009年度	4.03%	0.38%	–1.24%	0.10%	5.27%	0.28%
2010年度	7.05%	0.21%	1.92%	0.10%	5.13%	0.11%
2011年度	–0.44%	0.18%	5.72%	0.11%	–6.16%	0.07%
2012年度	6.06%	0.10%	2.51%	0.07%	3.55%	0.03%
2013年度	0.47%	0.10%	–2.10%	0.11%	2.57%	–0.01%
2014年度	9.68%	0.13%	11.23%	0.15%	–1.55%	–0.02%
2015年度	10.06%	0.19%	8.03%	0.11%	2.03%	0.08%
2016年度	1.42%	0.08%	1.30%	0.12%	0.12%	–0.04%
2017年度	2.08%	0.06%	–1.19%	0.09%	3.27%	–0.03%
2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	3.24%	0.08%	4.95%	0.12%	–1.71%	–0.04%

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

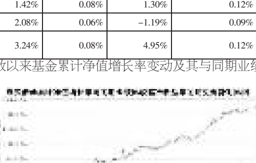


图:嘉实债券份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 7 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日)

注:按基金合同规定,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三部分(四、(一)投资范围和(四)各基金投资组合比例限制)的规定:(1)投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%;(2)投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;(3)投资于国债及信用等级为 BBB 级及以上(或者有高信用等级机构或相当优质资产担保)的金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券的比例不低于基金非现金资产的 80%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级;(4)本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月;(5)新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

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

①以下条款适用于嘉实增长混合和嘉实稳健混合

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。

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:

$H=E\times 1.5\%\div$ 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

②以下条款适用于嘉实债券

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.6%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times 0.6\%\div$ 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。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(2)基金托管人的基金托管费

①以下条款适用于嘉实增长混合和嘉实稳健混合

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。

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:

$H=E\times 0.25\%\div$ 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

②以下条款适用于嘉实债券

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下:

$H=E\times 0.2\%\div$ 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 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(3)与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金成立后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金成立后与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(4)上述系列基金 / 基金费用由基金管理人按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

上述基金费用由相应的基金独立承担,本系列基金费用按各基金份额与各基金份额总和之比分摊。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

1.本系列基金 / 基金的申购费按申购金额采用比例费率,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。费率表如下:

申购金额(含申购费)	申购费率	
	嘉实增长混合/嘉实稳健混合	嘉实债券
100万元以下	1.5%	0.8%
100万元(含)– 500 万元	1.2%	0.6%
500万元(含)以上	每笔 1000 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: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),并对通过本公司网上直销系统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。具体请参见嘉实基金网站刊载的公告。

2.赎回费根据持有时间实行递减收费。费率表如下:

持有期限	赎回费率	
	嘉实增长混合/嘉实稳健混合	嘉实债券
7日之内	1.5%	1.5%
7日(含)–1 年	0.5%	0.3%
1年(含)–2 年	0.25%	0.15%
2年(含)以上	0	0

基金的赎回费用由赎回人承担,其中对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产,除此之外的赎回费在扣除必要的手续费后,赎回费余额不得低于赎回费总额的 25%,并归入基金财产。

(3)转换费

1. 理财通三基金之间办理份额转换,如转出基金份额连续持有少于 7 天,费率为被转出基金份额净值的 1.5%;如转出基金份额已连续持有 7 天(含)以上但少于 90 天,费率为被转出基金份额净值的 0.5%;如转出基金份额已连续持有超过 90 天,基金持有人可以免费转换。转换后的基金份额的持有时间重新开始计算。

转换费用计算公式如下:

转入基金份额数量 = [转出基金份额数量×转换当日转出基金份额资产净值×(1– 转换费率)]/ 转换当日转入基金份额资产净值

2. 理财通基金与其他基金办理基金转换业务,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;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。

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、嘉实逆向策略股票、嘉实快线货币基金 A、嘉实货币、嘉实新兴产业股票、嘉实稳华纯债债券、嘉实债券、嘉实增益宝货币、嘉实纯债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。定期开放基金在封闭期内无法转换。(4)销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费,用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用根据相关法律及中国证监会相关规定列支。

(二)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资产的损失,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。

(三)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低部分或全部基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告;此项调整无须召开基金份额持有人大会。

(四)基金的税收

本系列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。

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》、《公开募集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 2003 年 5 月 29 日刊登的本系列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:更新了托管人的相关信息。

4.在"五、相关服务机构"部分:新增了代销机构,并更新了相关代销机构信息及经办注册会计师。

5.在"八、基金份额的申购与赎回"部分:根据相关公告更新了申购、赎回的相关内容。

6.在"九、基金转换"部分:更新了基金转换的相关内容。

7.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。

8.在"十二、基金的业绩"部分:基金业绩更新到 2018 年 6 月 30 日。

9.在"二十四、其他应披露事项"部分:更新了 2018 年 1 月 9 日至 2018 年 7 月 9 日本系列基金 / 基金的相关临时公告事项列表。

10.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《关于修改嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式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、基金的风险揭示"等章节的相关内容。

嘉实基金管理有限公司

2018 年 8 月 21 日