（上接B55版）

153	东海证券股份有限公司	办公地址：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 客服电话：95531;400-888-8588 网址：http://www.longone.com.cn
154	中银国际证券股份有限公司	办公地址：中国上海市浦东银城中路200号中银大厦39层 法定代表人：赵俊 联系人：王炜哲 传真：(021)50372474 客服电话：4006208888 网址：http://www.bocifunds.com
155	恒泰证券股份有限公司	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 法定代表人：庞介民 联系人：熊丽 电话：0471-4972675 客服电话：4001966188 网址：http://www.cnht.com.cn
156	国盛证券有限责任公司	办公地址：江西省南昌市北京西路88号 法定代表人：徐丽峰 联系人：占文驰 电话：(0791)86283372 传真：(0791)86281305 客服电话：4008222111 网址：http://www.gsstock.com
157	金元证券股份有限公司	办公地址：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：马骁清 电话：(0755)83025022 传真：(0755)83025625 客服电话：400-8888-228 网址：http://www.jyzq.cn
158	德邦证券股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心29楼 法定代表人：武晓春 联系人：刘晨 电话：021-68761616 传真：021-68767981 客服电话：4008888128 网址：http://www.tebon.com.cn
159	西部证券股份有限公司	办公地址：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：梁米华 电话：(029)87416168 传真：(029)87406710 客服电话：95582 网址：http://www.west95582.com
160	华龙证券股份有限公司	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 法定代表人：李晓安 联系人：范坤 电话：0931-4890208 传真：0931-4890628 客服电话：95368 网址：http://www.hlzq.com
161	财通证券股份有限公司	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 法定代表人：沈建强 联系人：陶志华 电话：0571-87789160 传真：0571-87818329 客服电话：0571)96336.962336(上海地区) 网址：http://www.ctsec.com
162	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 法定代表人：陈灿辉 联系人：倪丹 电话：021-38784818? 传真：021-68775878 客服电话：68777877 网址：http://www.shhxzq.com/
163	华鑫证券有限责任公司	办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01、B02单元 法定代表人：俞洋 联系人：杨莉娟 电话：021-54967552 传真：021-54967032 客服电话：021-32109999;029-68918888;4001099918 网址：http://www.cfsc.com.cn
164	瑞银证券有限责任公司	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 法定代表人：钱于军 联系人：韦冲 电话：(010)58328112 传真：(010)58328748 客服电话：400-887-8827 网址：http://www.ubssecurities.com
165	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 法定代表人：黄扬录 联系人：罗艺琳 电话：0755-82570586 传真：0755-82960582 客服电话：95329 网址：http://www.zszq.com.cn
166	国融证券股份有限公司	办公地址：呼和浩特市新城区锡林南路18路 法定代表人：张智河 联系人：董晶姗 电话：010)83991737 传真：(010)66412537 客服电话：4006609839 网址：http://www.grzq.com
167	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 法定代表人：赵洪波 联系人：周俊 电话：0451-85863726 传真：0451-82337279 客服电话：400-666-2288 网址：http://www.jhzq.com.cn/
168	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 法定代表人：冉云 联系人：刘清源、贾鹏 电话：028-86690057、028-86690058 传真：028-86690126 客服电话：95310 网址：http://www.gjzq.com.cn
169	中国民族证券有限责任公司	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 法定代表人：姜志军 联系人：余冬妮 电话：(010)59355807 传真：(010)56437013 客服电话：400-889-5618 网址：http://www.e5618.com
170	华宝证券有限责任公司	办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号57层 法定代表人：陈林 联系人：夏天 电话：021-68777222 传真：021-68777822 客服电话：4008209898 网址：http://www.cnhbstock.com
171	长城国瑞证券有限公司	办公地址：厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼 法定代表人：王勇 联系人：林丹 电话：(0592)2079259 传真：(0592)2079602 客服电话：400-0099-886 网址：https://www.gwgsc.com/
172	爱建证券有限责任公司	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） 法定代表人：祝健 联系人：姚晓炼 电话：021-13222888 传真：021-68728703 客服电话：4001962502 网址：http://www.ajzq.com
173	华融证券股份有限公司	办公地址：北京朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦18层 法定代表人：祝顺忠 联系人：李慧灵 电话：010-85556100 传真：010-85556088 客服电话：400-898-4999 网址：http://www.hrsec.com.cn
174	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 法定代表人：余磊 联系人：李妹妹 电话：027-87617017 传真：027-87618863 客服电话：4008005000 网址：http://www.tfzq.com
175	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	办公地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园四栋10层1006 法定代表人：马勇 联系人：文雯 电话：010-83363101 传真：010-83363072 客服电话：400-118-1166 网址：http://www.xinlande.com.cn
176	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101 法定代表人：张旭阳 联系人：杨琳 电话：010-61952702 传真：010-61951007 客服电话：95055
177	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座12楼 法定代表人：祖国明 联系人：韩爱彬 电话：021-60897840 传真：0571-26697013 客服电话：4000-766-123 网址：http://www.fund123.cn
178	北京汇成基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室 法定代表人：王伟刚 联系人：丁向坤 电话：010-56282140 传真：010-62680827 客服电话：400-619-9059 网址：http://www.hcjjin.com/
179	北京新浪仓石基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 联系人：付文红 电话：010-62676405 传真：010-62676582 客服电话：010-62675369 网址：http://www.xincai.com
180	上海万得基金销售有限公司	办公地址：中国（上海）浦东新区福山路33号9楼 法定代表人：王廷富 联系人：姜吉灵 电话：021-68882280 传真：021-68882281 客服电话：400-821-0203 网址：https://www.520fund.com.cn/
181	凤凰金信(银川)基金销售有限公司	办公地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路142号14层办公房 法定代表人：程刚 联系人：张旭 电话：010-58160168 传真：010-58160173 客服电话：400-810-55919 网址：http://www.fengfd.com/
182	和耕传承基金销售有限公司	办公地址：郑州市郑东新区东风东路康宁街北6号楼6楼602、603房间 法定代表人：李淑慧 联系人：裴小龙 电话：0371-85518395 4000-555-671 传真：0371-85518397 网址：HGCCPB.COM
183	北京肯特瑞基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06 法定代表人：江卉 联系人：江卉 电话：4000988511 传真：010-89188000 客服电话：010-89188462 网址：http://fund.jd.com
184	北京蛋卷基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 法定代表人：钟斐斐 联系人：侯芳芳 电话：010-61840688 传真：010-61840699 客服电话：400-159-9288 网址：http://www.ncfjj.com

（二）注册登记机构

名称	嘉实基金管理有限公司
住所	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期27楼09-14单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦8层
法定代表人	经雷
联系人	彭鑫
电话	010-65215588
传真	010-65185678

（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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室		
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	周祎
电话	021-23238888	传真	021-23238800
经办注册会计师	薛竞、周祎		

四、基金名称

本基金名称：嘉实量化阿尔法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

追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括：股票资产（A股以及监管机构允许投资的其他市场的股票资产等）、衍生工具（权证等）、债券资产（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、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股票指数期货等金融衍生产品或其它品种，可以根据有关规定且和基金托管人进行协商后将其纳入投资范围，并报证监会备案。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为60～95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5-40%。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%。其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定，适用新的规定。

八、基金的投资策略

1.资产配置

本基金将从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场情况灵活配置大类资产，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，将优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。

2.股票投资策略

本基金以“定量投资”为主（Quantitative Investment Approach），辅以“定性投资”（Traditional Investment Approach），力争实现稳定超额回报。

定量投资方面，本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。其中，核心模型包括嘉实行业选择模型、嘉实Alpha多因素模型以及嘉实组合优化器。数量小组将根据市场变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做相应调整，以不断改善模型的适用性。

（1）嘉实行业选择模型

嘉实行业选择模型，通过定量分析行业赢利能力、分析师的盈利预期、市场认同度等因素，捕捉具有投资吸引力的行业。

根据各行业的投资吸引力，决定各行业相对于业绩比较基准中股票指数的相对偏离度。提高投资吸引力高的行业配置，降低投资吸引力低的行业配置。

（2）嘉实Alpha多因素模型

通过嘉实行业选择模型筛选的行业进入个股筛选程序。本基金在个股选择层面，采用“嘉实Alpha多因素模型”。

嘉实基金根据对中国证券市场运行特征的长期研究，选取估值因子（Valuation）、成长因子（Growth）、盈利趋势（Operating）、分析师情绪（Sentiment）、市场因素（Market）五大类对A股股价波动具有较强解释度的指标，建立“嘉实Alpha多因素模型”，并使该模型成为股票选择的重要依据。

定性投资主要利用基本面研究成果，对模型自动选股的结果进行复核，剔除掉满足某些特殊条件的股票，即在嘉实Alpha多因素模型筛选出的股票名单中，根据分析师定性研究成果，剔除掉限制买入类股票，从而进行定性优选。

需要考虑的定性因素包括：

A)上市公司治理结构存在问题；

B)存在对股价有负面影响的潜在事件；

C)存在压制股价的其它非基本面因素。

本基金通过量化技术，对上述定量模型和定性因素筛选的结果进行优化，以确定个股权重，实现风险收益的最佳匹配。定量投资方法以科学性和系统性著称，将在严格的纪律化模型制约下，精准跟踪策略，使运作风险最小化，并力争取得较高收益。在现阶段，本基金使用“稳健优化”的方法，在所有可能的期望回报的最坏条件下，计算最优组合。与其他优化方法相比，使用“稳健优化”方法获得的最优组合，更加稳定，更加分散化，交易成本和换手率更低。

3.债券投资策略

本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

4.权证投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

九、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中证800指数*95%+上证国债指数*5%

其中，中证800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800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势。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，具有良好的债券市场代表性。由于本基金优先配置股票资产，债券、现金类资产主要作为流动性管理工具，因此本基金采用上述两个指数组成的复合指数作为业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、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

较高风险、较高收益。

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2019年1月17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12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	159,307,493.20	90.21
	其中：股票	159,307,493.20	90.21
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,063,645.70	6.26
	其中：债券	11,063,645.70	6.26
	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	5,775,051.64	3.27
8	其他资产	453,966.44	0.26
9	合计	176,600,156.98	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	3,269,088.00	1.86
B	采矿业	165,075.00	0.09
C	制造业	81,553,142.52	46.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,426,730.00	1.95
E	建筑业	2,581,665.39	1.47
F	批发和零售业	1,663,670.52	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	3,667,800.00	2.09
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,240,855.00	5.27
J	金融业	40,456,348.95	23.05
K	房地产业	9,891,044.00	5.64
L	租赁和商务服务业	2,068,226.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	556,942.00	0.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,868.82	0.00
R	文化、体育和娱乐业	902.00	0.00
S	综合	761,135.00	0.43
	合计	159,307,493.20	90.77

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	218,600	7,801,834.00	4.45
2	601318	中国平安	138,700	7,781,070.00	4.43
3	600660	福耀玻璃	234,986	5,352,981.08	3.05
4	000620	新华联	1,247,400	4,877,334.00	2.78
5	600426	华鲁恒升	350,000	4,224,500.00	2.41
6	000661	长春高新	23,100	4,042,500.00	2.30
7	601198	东兴证券	419,500	4,010,420.00	2.29
8	000860	顺鑫农业	124,900	3,983,061.00	2.27
9	002456	欧菲科技	429,400	3,946,186.00	2.25
10	601233	桐昆股份	379,200	3,700,992.00	2.11

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	11,042,373.60	6.29
	其中：政策性金融债	11,042,373.60	6.29
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）	21,272.10	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,063,645.70	6.30

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	018005	国开1701	109,940	11,042,373.60	6.29
2	128017	金禾转债	215	21,272.10	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述2支债券。

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	67,023.66
2	应收证券清算款	40,256.94
3	应收股利	-
4	应收利息	308,811.33
5	应收申购款	37,874.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	453,966.44

(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	128017	金禾转债	21,272.10	0.01

(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。

（一）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
2009年3月20日(基金合同生效日)起至2009年12月31日	29.90%	1.86%	36.95%	1.46%	-7.05%	0.40%
2010年	2.41%	1.49%	-8.29%	1.19%	10.70%	0.30%
2011年	-34.27%	1.35%	-18.30%	0.97%	-15.97%	0.38%
2012年	1.10%	1.25%	6.88%	0.96%	-5.78%	0.29%
2013年	5.30%	1.26%	-4.73%	1.04%	10.03%	0.22%
2014年	21.97%	1.14%	38.62%	0.91%	-16.65%	0.23%
2015年	59.57%	2.97%	7.23%	1.86%	52.34%	1.11%
2016年	-2.56%	1.84%	-7.40%	1.05%	4.84%	0.79%
2017年	-2.34%	0.87%	16.22%	0.48%	-18.56%	0.39%
2018年	-28.70%	1.33%	-18.21%	1.00%	-10.49%	0.33%

（二）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：嘉实量化阿尔法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

（2009年3月20日至2018年12月31日）

注：根据本基金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、（二）投资组合限制）的有关约定。

十三、费用概览

（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和律师费；

（5）基金份额持有人大会费用；

（6）基金的证券交易费用；

（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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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，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2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2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×2.5‰÷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2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。

上述一、基金费用的种类中第(3)-(7)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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

（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、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率等至本基金合同第十四部分第二款规定的费率水平以上时，须召开基金份额持有人大会审议；在第（一）条规定的费率水平以内，调整基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在指定媒介公告并报中国证监会备案。

（二）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（仓申购费）	申购费率
M<100万元	1.5%
100万元≤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，不列入基金财产。

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、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
M<7天	1.5%
7天≤M<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，其中对持续持有期少于7日的投资者收取不少于1.5%的赎回费并全部计入基金财产，除此之外的赎回费中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

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。从申购费用基金向非申购费用基金转换时，每次按照非申购费用基金申购费用收取申购补差费；非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，收取该基金的赎回费用。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。

注：嘉实新兴产业股票、嘉实快线货币A、嘉实逆向策略股票、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券A、嘉实稳祥纯债债券C、嘉实增益宝货币、嘉实稳华纯债债券、嘉实致盈债券、嘉实债券、嘉实货币A、嘉实超短债债券、嘉实多元债券A、嘉实多元债券B、嘉实信用债券A、嘉实信用债券C、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币A、嘉实安心货币B、嘉实纯债债券A、嘉实纯债债券C、嘉实货币B、嘉实中证中期企业债指数（LOF）A、嘉实中证中期企业债指数（LOF）C有单日单个基金账户账户的累计申购（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，具体请见考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。

（4）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。

（三）基金的税收

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。

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》、《公开募集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；本次更新招募说明书更新的主要内容。

2、在“三、基金管理人”部分；更新了基金管理人的相关内容。

3、在“四、基金托管人”部分；更新了基金托管人的相关内容。

4、在“五、相关服务机构”部分；更新相关直销机构、会计师事务所的信息。

5、根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，本次更新招募说明书更新了与修订基金合同、托管协议相关的内容，包括“重要提示”、“释义”、“基金份额的申购与赎回”、“基金的收益与分配”、“基金的会计与审计”、“基金资产的估值”、“基金的信息披露”、“基金合同的内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节。

嘉实基金管理有限公司

2020年1月15日

证券代码：002933　证券简称：新兴装备　公告编号：2020-005

北京新兴东方航空装备股份有限公司第三届董事会第十二次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

北京新兴东方航空装备股份有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会第十二次会议于2020年1月14日以通讯方式召开。本次会议通知已于2020年1月10日以电话、短信、电子邮件等方式发出，会议应出席董事9名，实际出席董事9名。会议由公司董事长戴岳先生召集和主持。本次会议的召集、召开及表决程序符合《公司法》及《公司章程》的规定。

二、董事会会议审议情况

（一）审议通过《关于使用募集资金向全资子公司实缴注册资本的议案》

公司2019年第三次临时股东大会审议通过了《关于变更部分募集资金用途、新增实施主体及地点并延期的议案》，同意使用募集资金30,000万元用于“南京新兴航空装备研发生产基地一一航空装备生产项目”的建设，并由全资子公司南京新兴东方航空装备有限公司（以下简称“南京新兴装备”）主要负责实施该项目。为保障“南京新兴航空装备研发生产基地一一航空装备生产项目”的顺利实施，同意公司以募集资金20,000万元实缴南京新兴装备的注册资本，并将根据该募集资金投资项目的进展情况和投资计划分批投入募集资金。

具体内容详见公司同日刊登在巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）的《关于使用募集资金向全资子公司实缴注册资本的公告》（公告编号：2020-007）。

公司独立董事已就此议案发表了同意的独立意见，具体内容详见公司同日刊登在巨潮资讯网（http://www.cninfo.com.cn）的《独立董事关于第三届董事会第十二次会议相关事项的独立意见》。

表决结果：同意9票，反对0票，弃权0票。

（二）审议通过《关于向银行申请综合授信额度的议案》

为满足公司经营发展的资金需求，同意公司向中国民生银行股份有限公司北京分行申请综合授信额度人民币10,000万元，授信期限一年，采用信用方式，具体授信品种为短期流动资金贷款、银行承兑汇票、非融资性保函（履约保函、预付款保函、质量保函、投标保函）等。

为提高授信工作办理效率，董事会授权董事长戴岳先生全权代表公司签署上述授信额度内的所有授信相关的合同、协议、凭证等各项法律文件。

具体内容详见公司同日刊登在巨潮资