

(上接 C138 版)

Table with columns for company name, address, and contact information for various financial institutions and funds.

Table with columns for name, address, and contact information for legal and accounting firms.

四、基金名称:嘉实新添定期混合基金
五、基金类型:契约型,以定期开放方式运作。
六、基金的投资目标:本基金在严格控制风险的前提下,通过优化资产配置和选择高安全边际的证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资范围:本基金投资于国内依法发行上市股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行上市股票)。

八、基金的投资策略:1. 资产配置策略 (1) 资产配置策略 本基金将从宏观、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析,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 本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合,精选行业和个股的策略。以公司行业研究员的基本分析为基础,同时结合数量化的系统选股方法,精选价值被低估的投资品种。 1) 行业投资策略:本基金将在考虑行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场价格轮动规律的基础上决定行业的配置,同时本基金将根据宏观经济和证券市场环境的变化,及时对行业配置进行动态调整;

(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) 股指期货投资策略 本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则,以套期保值为主要目的。本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。

(5) 资产支持证券投资策略 本基金将通过宏观分析、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的影响,预测资产池未来现金流变化;研究标的证券发行条款,预测提前还款率变化对标的证券久期与收益率的影响。同时密切跟踪流动性对标的证券收益率的影响,综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。 (6) 风险管理策略 本基金将借鉴国外风险管理成功经验如 Bara 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,控制单一投资品种风险。

2. 中期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资者安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。 3. 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、法规和基金的相关规定。 宏观经济和证券发行人的基本面数据。 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 基金管理人将通过内部独立研究,并借鉴其他研究机构的研究成果,形成宏观、政策、投资策略、行业和证券发行人等分析报告,为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。 基金管理人投资决策委员会定期和不定期召开会议,根据本基金投资目标和对市场判断决定本计划的总体投资策略,审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。 在既定的投资目标与原则下,根据分析师基本面研究成果以及定量投资模型,由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。 独立的交易执行:本基金管理人通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。 动态调整组合管理:基金经理跟踪证券市场和证券发行人的发展变化,结合本基金的现金流情况,以及组合风险和流动性的评估结果,对投资组合进行动态的调整,使之不断得到优化。 基金管理人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。基金管理人监察稽核部对本基金投资过程进行日常监督。 九、基金业绩比较基准 本基金业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 x 50% + 中债综合财富指数收益率 x 50%。

沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数,是目前中国证券市场中市值覆盖率最高、代表性最强、流动性好,同时公信力较好的股票指数,适合作为本基金股票投资的比较基准。 中债综合财富指数为中央国债登记结算有限责任公司编制并发布。该指数的样本券包括了商业银行债券、央行票据、证券公司债、证券公司短期融资券、政策性银行债券、地方企业债、中期票据、记账式国债、国际机构债券、非银行金融债券和可转债、短期融资券、中央企业债等债券,综合反映了债券市场整体运行情况。该指数以债券托管量市值为样本券权重因子,每日计算整体市场整体表现,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一,适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。 如果上述业绩比较基准涉及的指数停止发布或变更名称,或者相关法律法规发生变化,或者有更权威、更能作为市场普遍接受的业绩比较基准推出,经基金管理人及基金托管人协商一致,本基金可在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。 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。 十一、基金投资组合报告 基金管理人及董事会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。 于 2020 年 4 月 20 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 2020 年 3 月 31 日(报告期末),本报告所列财务报表数据未经审计。 1. 报告期末基金资产组合情况

Table showing portfolio composition with columns for code, industry, fair value, and percentage of net assets.

Table showing top 10 stocks by fair value with columns for stock code, name, quantity, fair value, and percentage of net assets.

Table showing bond portfolio classification with columns for category, fair value, and percentage of net assets.

Table showing top 5 bonds by fair value with columns for bond code, name, quantity, fair value, and percentage of net assets.

Table showing top 10 assets with columns for asset code, name, quantity, fair value, and percentage of net assets.

2. 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 无。 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五名贵金属投资明细 无。 4. 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 无。 5. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 无。 6. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 无。 7. 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) 2020 年 2 月 3 日,中国证监会深圳监管局发布行政处罚信息公开表(深证监罚字[2020]17 号),平安银行股份有限公司因汽车消费贷款和汽车抵押贷款调查存在缺失、双录、管理审慎性不足,理财销售人员销售话术不当等 11 条违法违规事实,依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第六十六条,于 2020 年 1 月 20 日处以罚款 720 万元。

2020 年 3 月 9 日,根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚决定书(银保监罚决字[2020]3 号),因可回溯制度执行不到位,可回溯基础管理不到位,部分可回溯视频质检结果未反馈给保险公司,可回溯资料不符合监管规定等行,中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 50 万元的行政处罚。 2020 年 1 月 8 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(银保监罚决字[2019]22 号),于 2019 年 12 月 27 日作出行政处罚决定,中国建设银行股份有限公司(一)用于风险解释的保管管理存在漏洞,(二)定期风险评估不完善,违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项的规定和相关内控管理和业务审慎经营规则,罚款合计 80 万元。

本基金投资于“平安银行(000001)”、“农业银行(601288)”、“建设银行(601939)”的决策程序说明:基于对平安银行、农业银行、建设银行基本面研究以及二级市场的判断,本基金投资于“平安银行”、“农业银行”、“建设银行”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,其他七名证券发行主体未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

Table showing other assets with columns for code, name, and amount.

Table showing convertible bonds held at the end of the reporting period with columns for code, name, fair value, and percentage of net assets.

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 无。 十二、基金业绩 基金管理人恪尽职守,诚实守信,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。投资者有风险,投资前请仔细阅读基金招募说明书。 (一) 本报告期基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 嘉实新添定期混合 A

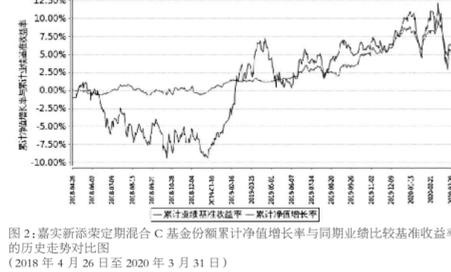
Table comparing performance of 嘉实新添定期混合 A against benchmarks.

Table comparing performance of 嘉实新添定期混合 C against benchmarks.

(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 嘉实新添定期混合 A 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 (2018 年 4 月 26 日至 2020 年 3 月 31 日)



嘉实新添定期混合 C 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 (2018 年 4 月 26 日至 2020 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)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) 基金的销售服务费; (4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用; (5) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所和仲裁机构的费用; (6) 基金份额持有人大会费用; (7) 基金的证券、期货交易费用; (8) 基金的开户费用、账户维护费用; (9) 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 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下: H = E x 0.80% x 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 基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令,基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费 本基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下: H = E x 0.15% x 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。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令,基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(3) 销售服务费 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%, 按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下: H = E x 0.60% x 当年天数 H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值 销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令,基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

上述 1、基金费用的种类中第 4-10 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。 (二) 与基金销售有关的费用 1. 本基金 A 类基金份额收取申购费, C 类基金份额不收取申购费。 A 类基金份额采用前端收费模式收取基金申购费用。投资者在一天之内如有多笔申购,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<=1000 万元 0.8% M>1000 万元 按笔收取,每笔 1000 元

本基金 A 类基金份额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。 本基金 C 类基金份额申购费率为 0。 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后申购费率不低于 0.6%;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的,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模式的公告》,自 2019 年 4 月 26 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如下表: 持有期限(N) 后端申购费率 0<N<=1 0.20% 1年<=N<=3年 0.10% N>=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 A、C 类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 A 类基金份额由基金持有人承担。本基金 A 类基金份额,对持续持有期少于 30 日的投资者,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 天的投资者,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 天的投资者,赎回费总额的 50% 计入基金财产。本基金 C 类基金份额,对持续持有期少于 30 日的投资者收取的赎回费全额计入基金财产。 本基金 A 类基金份额的赎回费率具体如下:

Table showing redemption rates for Class A shares based on holding period.

Table showing redemption rates for Class C shares based on holding period.

基金管理人可以在法律法规和基金合同范围内调整申购费率、赎回费率或收费方式,费率或收费方式如发生变更,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介上刊登公告。 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。 当发生大额申购或赎回时,基金管理人可以采用调整定价机制,以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 3. 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”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(“前端转后端”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。 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) (a) 若转出基金有赎回费,则仅收取转出基金的赎回费; (b) 若转出基金无赎回费,则不收取转换费用。 (3) 基金转换份额的计算方式 基金转换采取未知价法,以申请当日基金份额净值为基础计算。计算公式如下: 转出基金金额 = 转出份额 x 转出基金当日基金份额净值 转出基金赎回费用 = 转出基金金额 x 转出基金赎回费率 转出基金申购费用 = (转出基金金额 - 转出基金赎回费用) x 转出基金申购费率 = (1 + 转出基金申购费率) x (转出基金金额 - 转出基金赎回费用) x 转入基金申购费率 = (1 + 转入基金申购费率) x (转出基金金额 - 转出基金赎回费用) x 转入基金申购费率 转换费用 = 转出基金赎回费用 + 申购补差费用 净转入金额 = 转出基金金额 - 转换费用 转入份额 = 净转入金额 / 转入基金当日基金份额净值 转出基金有赎回费用的,收取的赎回费计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。 基金转换费用由基金持有人承担,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:嘉实泰和混合、嘉实新金货币、嘉实新兴产业股票、嘉实快线货币、嘉实新消费股票、嘉实新趋势混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳祥纯债债券 A、嘉实增益货币、嘉实稳祥纯债债券、嘉实致盈债券、嘉实中短债债券 A、嘉实中短债债券 C、嘉实债券、嘉实货币 A、嘉实超短债债券、嘉实价值优势混合、嘉实信用债券 A、嘉实信用债券 C、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 有转入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。定期开放式基金在封闭期无法转换。 (三) 不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用: 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。 (四) 基金税收 本基金支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格,具体税率适用中国税务主管机关的规定。 本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行,但本基金运作过程中应缴纳的增值税等以基金管理人名义缴纳的税费由基金财产承担。 十四、对招募说明书更新部分的说明 本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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,结合本基金基金合同及基金托管人业务,对原基金合同的投资经营情况,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,更新了基金经理的相关内容。 3. 在“五、相关服务机构”部分,更新了直销机构的相关信息。

嘉实基金管理有限公司 2020 年 06 月 19 日