(上接 C81 版) 公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大 注定代表人:陈耀庭 联系人:王一彦 电话:(021)20333333 传真:(021)50498825 客服电话:95531;400-8888-588 网址:http://www.longone.com.cn 45 东海证券股份有限公司 公地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼 电话:(0755)83025022 传真:(0755)83025625 客服电话:400-8888-228 46 金元证券股份有限公司 N公地址,陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 b 至 法定代表人:徐朝晖 联系人:梁承华 电话:(029)87416168 传真:(029)87406710 客服电话:95582 47 西部证券股份有限公司 网址:http://www.west95582.com 公地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财 法定代表人:李晓安 联系人:范坤 48 华龙证券股份有限公司 电话:(0931)4890208 传真:(0931)4890628 客服电话:95368 网址:http://www.hlzq.com 公地址:深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 、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 客服电话:021-3210 49 华鑫证券有限责任公司 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, 刘靖漪 贾鹏 电话: 0.28-86690057, 0.28-86690058 传真, 0.28-86690126 客服电话: 95310 岡址; http://www.gizq.com.cn 50 国金证券股份有限公司 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 法定代表人:陈林 联系人:夏万 电话:(021)68777222 传真:(021)68777822 客服电话:4008209898 网址:http://www.cnhbstock.com 51 华宝证券有限责任公司 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, 高新 联系人, 杨琳 电话:010-61952702 传真:010-61951007 客服电话:95055 网址:htm://www.baivinefund.com 52 北京百度百盈基金销售有限公司 网址:http://www.baiyingfund.com 、地址:浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代 53 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 公地址:北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108 法定代表人:王伟刚 联系人:丁向坤 电话:010-56282140 54 北京汇成基金销售有限公司 传真:010-62680827 客服电话:400-619-9059 网址:http://www.hcjijin.com/ 公地址:北京市海淀区北四环西路 58 号理想国际大 906室 联系人:李唯 55 北京新浪仓石基金销售有限公司 电话:010-62676405 传真:010-62676582 客服电话:010-62675369

(二) 登	记机构	
名称		嘉实基金管理有限公司
		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		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐 部 C 座写字楼 12A 层
法定代表人		经雷
联系人		彭鑫
电话		(010)65215588
传真		(010)65185678
(三) 出	具法律意见书的律师	5事务所
夕称	上海市源泰律师:	事各所

网址:http://www.xincai.com

网址:HGCCPB.COM

公地址,郑州市郑东新区东风东路康宁街北 6 号楼 6 602,603 房间 法定代表人,李淑慧 联系人,表小老 电话:0371-85518395 4000-555-671 传真,0371-85518397 阅址,HGCCPB COM

名称	上海巾源零律师争务所	上两巾源黎律师争务所				
住所、办公地址	上海市浦东新区浦东南	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	刘佳、范佳斐				
(四) 审计基	金财产的会计师事务	折				
名称	普华永道中天会计师事	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)				
住所	中国(上海)自由贸易设室	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	中国上海市黄浦区湖滨	中国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	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					
http://doi.o/ 64.47/						

本基金名称: 嘉实稳宏债券型证券投资基金 五、基金的类型 本基金类型: 债券型证券投资基金、契约型开放式

56 和耕传承基金销售有限公司

六、基金的投资目标

へい告選申27×以口470 本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。 上 其人的现象共享

产的长期稳健增值。 七、基金的投资范围 本基金投资于依法发行、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)、国债期货、权证、债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债 地方政府债、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、同 业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)等,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, 可以数学协划、投资证明

可以将其纳入投资范围。 基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%:在扣除国债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;国债期货、权证及其他金融工具的投资比例符合法律法

观代温音机构即观定。 八、基金的投资策略 A、大类资产配置策略 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。 本基金投资计债券资产的比例不低于基金资产的 80%。 本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下 的定性分析和定量分析、综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水 平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对 投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权 益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。 B、债券投资策略 B、债券投资策略

B.债券投资策略 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和 信用风险变化等因素,并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、 预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,决定组合的 久期水平,期限结构和类属配置,并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理。 以表现效应的抗态度。 以获取较高的投资收益。

1、利率策略 本基金将通过对宏观经济变量和宏观经济政策进行分析,积极主动的预测未来的利率趋势。组合久期是反映利率风险最重要的指标、本基金管理人将根据相关 因素的研判调整组合久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,以较多 地获得债券价格上升带来的收益;反之,如果预期利率上升,本基金将缩短组合的 久期,以减小债券价格下降带来的风险。

2.信用债券投资策略 本基金通过承担适度的信用风险来获取信用溢价,主要关注个别债券的选择 和行业配置两方面。在定性与定量分析结合的基础上,通过自下而上的策略,在信 用类固定收益金融工具中进行个债的精选,结合适度分散的行业配置策略,构造和

优化组合。通过采用"嘉实信用分析系统"的信用评级和信用分析,包括宏观信用环境分析、行业趋势分析、管理层素质与公司治理分析、运营与财务状况分析、债务契约分析、特殊事项风险分析等、依靠嘉实信用分析团队及嘉实中央研究平台的其他资源,深入分析挖掘投债主体的经营状况、现金流、发展趋势等情况,严格遵守嘉实信用分析流程,执行嘉实信用投资纪律。

(1)个别债券选择

(1)个别债券选择 首先,本基金依据"嘉实信用分析系统"的研究成果,执行"嘉实投资备选库流程",生成或更新买入信用债券备选库,强化投资纪律,保护组合质量。 其次,本基金主要从信用债券备选库中选择或调整个债。本基金根据个债的类属、信用评级,收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式,利息税务处理)、剩余期限、久期、凸性、流动性(发行总量、流通量、上市时间)等指标,结合组合管理层面的要求,决定是否将个债纳入组合及其投资数量。 再有,因信用改善而支持本基金投资的个债信用指标可以包括但不限于;更稳定或增强的现金流、通过自由现金流增强去杠杆的财务能力、资产估值更利于支持债务、更强大的公司管理、更稳定或更高的市场占有率,更易于获得资金等;个债因信用恶化而支持本基金卖出的指标可以包括但不限于;发债企业出现坏于分析师预期的情况、发债企业没有去杠杆的财务能力、发债企业进现坏于分析师预期的情况、发债企业没有去杠杆的财务能力、发债企业遗产减少、发债企业货户企业,发行企业获得资金的途径减少、发债企业发生管理层的重大变化、个债已达到本基金对其设定的目标价格、本基金对该个债评估的价格上行空间有限等。

(2)行业配置 宏观信用环境变化,影响同一发债人的违约概率,影响不同发债人间的违约相关度,影响既定信用等级发债人在信用周期不同阶段的违约损失率,影响不同信用等级发债人的违约概率。同时,不同行业对宏观经济的相关性差异显著,不同行业 的潜在违约率差异显著。本基金借助"嘉实信用分析系统"及嘉实中央研究平台,基于深入的宏观信用环境。行业发展趋势等基本面研究,运用定性定量模型,在自下而上的个债精选策略基础上,采取适度分散的行业配置策略,从组合层面动态优化

风险收益。 (3)信用风险控制措施 本基金实施谨慎的信用评估和市场分析、个债和行业层面的分散化投资策略, 当发债企业的基本面情况出现恶化时,运用"尽早出售(first sale, best sale)"策略,

控制投资风险。 本基金使用各信用级别持仓量、行业分散度、组合持仓分布、各项重要偿债指标范围等描述性统计指标,还运用 VaR、Credit Metrics、Credit Portfolio Views等模型,估计组合在给定置信水平和事件期限内可能遭受的最大损失,以便有效评估和控制组合信用风险暴露。 3.期限结构配置策略

3.期限结构配直束略 本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动进行分析,在给定组合久 期以及其他组合约束条件的情形下,通过嘉实债券组合优化数量模型,确定最优的 期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略。 4、骑乘策略

4. 過乘策略 本基金将采用骑乘策略增强组合的持有期收益。当债券收益率曲线比较陡峭 时,也即相邻期限利差较大时,可以买人期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即 收益率水平处于相对高位的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩 短,债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,对应的将是债券价格的走高,而 期间债券的涨幅将会高于其他期间,这样就可以获得丰厚的价差收益即资本

这一期间债券的涨幅将会高于其他期间,这样就可以获得丰厚的价差收益即资本利得收入。 5.息差策略 本基金将利用回购利率低于债券收益率的情形,通过正回购将所获得的资金投资于债券,利用杠杆放大债券投资的收益。 6.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敝口和信用风险敝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。

风险等各种风险。 C、股票投资策略 在严格控制风险、保持资产流动性的前提下,本基金将适度参与股票、权证等 权益类资产的投资,以增加基金收益。 本基金将依据自上而下的动态研究,发挥时机选择能力,通过流动性较高的分 散化组合投资,控制流动性风险和非系统性风险。 本基金运用嘉实研究平台,配置行业和个股,优化组合,精选流动性高、安全边 际高、具有上涨潜力的个股,力求增强组合的当期收益。 D、国债期货投资策略

际高、具有上涨潜力的个股、力求增强组合的当期收益。
D、国债期货投资策略
1、有效控制投资策略
1、有效控制投资策略
1、有效控制投资组合杠杆水平,做多利率债品种本基金将在深入研究宏观经济形势和影响利率水平各项指标的基础上,预判利率债品种的后期表现。在有效控制组合杠杆水平的基础上,充分利用国债期货保证金交易特点,灵活调整组合国债期货多头仓位。
2、国债期货的套期保值本基本面、资金面和政策面的基础上,结合组合内各利率债持仓结构的基础上,按照"利率风险评估——套期保值比例计算——保证金、期现价格变化等风险控制"的流程,构建并实时调整利率债的套期保值组合。3、信用利差交易利率风险是信用债的重要风险组成。本基金将在基于经济形势和信用风险预期的基础上,利用国债期货,对于信用债的利率风险部分进行一定程度的套期保值、实现信用利差变易,即在预期信用利差缩窄的情况下,做空国债期货,做多信用债,在预期信用利差变宽的情况下,做多国债期货,做它冒用债。
E、资产支持证券投资策略本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,通过宏观经济、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研究,对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。
F、权证投资策略

F、权证投资策略 下,权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,本基金可以主动投资于权证,其投资原则为有 利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。本基金将利用权证达到控制下跌风 险、增加收益的目的;同时,充分发掘权证与标的证券之间可能的套利机会,实现基 金资产的增值。在权证投资中,本基金将对权证标的证券的基本面进行研究,综合 考虑权证定价模型,市场供求关系、交易制度等多种因素,对权证进行定价。 G、投资决策依据和决策程序 (1)投资决策依据和决策程序

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

决策依据。 ·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的判

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

日常监督。 九、基金的业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为: 中债总全价指数收益率 *00%+沪深 300 指数收益率 *10% 中债总全价指数收益率 *90%+沪深 300 指数收益率 *10% 上海证券交易所债券市场、深圳证券交易所债券市场和柜台债券市场的跨市场债 券指数。该指数样本券涵盖央票、国债和政策性金融债,能较好地反映债券市场的 整体收益结据

近けれる無限が、 采用该比较基准主要基于如下考虑: 1、中债总全价指数由中央国债登记结算公司编制并公开发布,具有较强的权 威性和市场影响力;

2、在中债指数体系中,中债总全价指数所代表的债券市场的风险收益特征与 2、在甲價指数体系中,甲價总全价指数所代表的價券市场的风险收益特征与本基金较为贴近。因此,中價总全价指数比较适合作为本基金的比較基准。
3、沪深 300 指数选取了 A 股市场上规模最大、流动性最好的 300 只股票作为其成份股、较好地反映了 A 股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。适合作为本基金的权益投资部分业绩基准。如果相关法律法规发生变化,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,经基金管理人与基金托管人协商,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,而无须召开基金份额持有人大会。 十、基金的风险收益特征 本基金为债券型证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基

- 、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 2020 年 4 月20日夏栋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

金额(元)

37,419,108.0

财务数据未经审计 1. 报告期末基金资产组合情况 序号

基金投资

3	固定收益投资		212,4	27,178.55	74.02
	其中:债券		212,4	27,178.55	74.02
	资产支持证券			-	-
4	贵金属投资			-	-
5	金融衍生品投资			-	-
6	买人返售金融资产			-	-
	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		33,6	34,004.82	11.72
8	其他资产		3,5	20,707.52	1.23
9	合计		287,0	00,998.91	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		532,950.00		0.21
В	采矿业		-		-
С	制造业		19,578,945.01		7.87
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		-		-
G	交通运输、仓储和邮政业		3,621,225.01		1.46
Н	住宿和餐饮业		-		-
I	信息传输、软件和信息技术服务业		2,393,505.00		0.96
J	金融业		955,488.00		0.38
K	房地产业		10,336,995.00		4.15
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		-		_
О	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		-		-

~							
R	文化、体育和娱	乐业	- 业		-		-
S	综合				_		-
		合计		37,41	9,108.02		15.04
3. 1	设告期末按2	允价值占基	生金资产	争值比例大	: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	量(股)	公允	:价值(元)	占基金资产 净值比例(%)
1	600048	保利地产		360,000		5,353,200.00	2.15
2	000002	万科A	194,300			4,983,795.00	2.00
3	600438	通威股份	285,032			3,309,221.52	1.33
4	002120	韵达股份	82,500			2,541,825.00	1.02
5	002376	新北洋	208,200			2,263,134.00	0.91
6	000810	创维数字	184,400			2,140,884.00	0.86
7	603179	新泉股份	107,840			2,138,467.20	0.86
8	002415	海康威视	75,000			2,092,500.00	0.84
9	002439	启明星辰		56,040		2,073,480.00	0.83
10	601799	星宇股份		22,200		1,859,472.00	0.75
4 j	4 招生期末按债券具种分米的债券投资组合						

6	000810	创维数:	£ 184,400			2,140,884.00	0.86
7	603179	新泉股份	份 107,840			2,138,467.20	0.86
8	002415	海康威祉	9.	75,000		2,092,500.00	0.84
9	002439	启明星周	₹	56,040		2,073,480.00	0.83
10	601799	星宇股份	分	22,200		1,859,472.00	0.75
4. 排	设告期末按债	贵券品种?	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	直比例(%)
1	国家债券				-		-
2	央行票据 –		-				
3	金融债券		33,755,625.30		25.30	13.5	
	其中:政策性金	融债	33,755,625.30		融债 33,755,625.30		13.56
4	企业债券	2.业债券		4,334,440.00			1.74
5	企业短期融资	企业短期融资券		=			-
6	中期票据		10,316,000.00		00.00		4.15
7	可转债(可交换债)		164,021,113.25		13.25		65.91
8	同业存单		=		-		-
9	其他		=				-
10	合计			212,427,1	78.55		85.36

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	113011	光大转债	171,890	20,128,319.00	8.09
2	132018	G 三峡 EB1	150,000	16,450,500.00	6.61
3	113031	博威转债	111,940	13,674,590.40	5.49
4	132015	18 中油 EB	132,890	13,371,391.80	5.37
5	110047	山鹰转债	100,440	11,354,742.00	4.56

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

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

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

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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

(3	/	
序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	37,607.47
2	应收证券清算款	_
3	应收股利	_
4	应收利息	1,205,085.68
5	应收申购款	2,278,014.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	_
8	其他	_
9	合计	3,520,707.52

2 132015 18 中油 EB 13,371,391.80 5 3 110047 山鷹转债 11,354,742.00 4 4 127013 创维转债 10,878,347.40 4 5 123021 万信转2 10,684,434.06 4 6 113028 环境转债 6,971,636.70 2 7 110053 苏银转债 5,608,500.00 2 8 113515 高能转债 4,290,300.00 1 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文址转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128015 久其转债	序号	债券代码	债券名称	公允价值 (元)	占基金资产净值比 例(%)
3 110047 山鷹转债 11,354,742.00 4 4 127013 创维转债 10,878,347.40 4 5 123021 万信转2 10,684,434.06 4 6 113028 环境转债 6,971,636.70 2 7 110053 苏银转债 5,608,500.00 2 8 113515 高能转债 4,290,300.00 3 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 3 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 6 13 113537 文址转债 2,099,659.20 6 14 113542 好客转债 2,078,736.80 6 15 128046 利尔转债 2,032,379.58 6 16 113509 新泉转债 1,963,361.40 6 17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 6 18 113009 广汽转债 1,540,200.00 6 19 128015	1	113011	光大转债	20,128,319.00	8.09
4 127013 創集转债 10,878,347.40 4 5 123021 万信转2 10,684,434.06 4 6 113028 环境转债 6,971,636.70 2 7 110053 苏银转债 5,608,500.00 2 8 113515 高能转债 4,290,300.00 1 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 6 13 113537 文址转债 2,099,659.20 6 14 113542 好客转债 2,078,736.80 6 15 128046 利尔转债 2,032,379.58 6 16 113509 新泉转债 1,963,361.40 6 17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 6 18 113009 广汽转债 1,540,200.00 6 20 127006 放东转债 434,563.70 6 21 128017	2	132015	18 中油 EB	13,371,391.80	5.37
5 123021 万信转2 10,684,434.06 4 6 113028 环境转债 6,971,636.70 2 7 110053 苏银转债 5,608,500.00 2 8 113515 高能转债 4,290,300.00 1 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 6 13 113537 文址转债 2,099,659.20 6 14 113542 好客转债 2,078,736.80 6 15 128046 利尔转债 2,032,379.58 6 16 113509 新泉转债 1,963,361.40 6 17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 6 18 113009 广汽转债 1,299,363.60 6 19 128015 久其转债 767,348.50 6 20 127006 放东转债 434,563.70 6 21 128029 <t< td=""><td>3</td><td>110047</td><td>山鹰转债</td><td>11,354,742.00</td><td>4.56</td></t<>	3	110047	山鹰转债	11,354,742.00	4.56
6 113028 环境转债 6,971,636.70 2 7 110053 苏银转债 5,608,500.00 2 8 113515 高能转债 4,290,300.00 1 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 6 13 113537 文址转债 2,099,659.20 6 14 113542 好客转债 2,078,736.80 6 15 128046 利尔转债 2,032,379.58 6 16 113509 所泉转债 1,963,361.40 6 17 110045 海澜转债 1,540,200.00 6 18 113009 广汽转债 1,299,363.60 6 19 128015 久其转债 767,348.50 6 20 127006 放东转债 434,563.70 6 21 128017 金禾转债 118,524.42 6 22 128029 太阳转债 51,877.30 6 23 128056 今飞转债 35,569.40 6 24 128074 游族转债 29,239.90 6 25 113021 中信转债 18,445.00 6 26 113025 阴泰转债 16,929.00 6 27 113026 核能转债 15,771.00 6 28 113534 關胜转债 11,329.00 6 29 128062 亚药转债 10,849.00 6 30 128064 司尔转债 10,849.00 6 31 113544 桃李转债 8,805.30 6	4	127013	创维转债	10,878,347.40	4.37
7 110053 苏银转债 5,608,500.00 2 8 113515 高能转债 4,290,300.00 1 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文灿转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 人其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金末转债 518,77.30 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转	5	123021	万信转 2	10,684,434.06	4.29
8 113515 高能转债 4,290,300.00 1 9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文灿转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债	6	113028	环境转债	6,971,636.70	2.80
9 110043 无锡转债 3,734,864.20 1 10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文灿转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 </td <td>7</td> <td>110053</td> <td>苏银转债</td> <td>5,608,500.00</td> <td>2.25</td>	7	110053	苏银转债	5,608,500.00	2.25
10 110051 中天转债 2,584,340.00 1 11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文址转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 人其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021<	8	113515	高能转债	4,290,300.00	1.72
11 123030 九洲转债 2,537,956.95 1 12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文址转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 人其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 <td>9</td> <td>110043</td> <td>无锡转债</td> <td>3,734,864.20</td> <td>1.50</td>	9	110043	无锡转债	3,734,864.20	1.50
12 123026 中环转债 2,278,800.00 (13 113537 文址转债 2,099,659.20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 人其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 明泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,849.00 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (10	110051	中天转债	2,584,340.00	1.04
13 113537 文地转债 2,099,659,20 (14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 明泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534	11	123030	九洲转债	2,537,956.95	1.02
14 113542 好客转债 2,078,736.80 (15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 明泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,849.00 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (12	123026	中环转债	2,278,800.00	0.92
15 128046 利尔转债 2,032,379.58 (16 113509 新泉转债 1,963,361.40 (17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 開胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,849.00 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (13	113537	文灿转债	2,099,659.20	0.84
16 113509 新泉转债 1,963,361.40 17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (6 18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (6 19 128015 久其转债 767,348.50 (6 20 127006 放东转债 434,563.70 (6 21 128017 金禾转债 118,524.42 (7 22 128029 太阳转债 51,877.30 (6 23 128056 今飞转债 35,569.40 (6 24 128074 游族转债 29,239.90 (6 25 113021 中信转债 18,445.00 (6 26 113025 明泰转债 16,929.00 (6 27 113026 核能转债 15,771.00 (6 28 113534 開胜转债 11,329.00 (6 29 128062 亚药转债 10,81.60 (6 30 128064 司尔转债 10,849.00 (6 31 113544 桃李转债 8,805.30 (6	14	113542	好客转债	2,078,736.80	0.84
17 110045 海瀾转债 1,540,200.00 (18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,81.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (15	128046	利尔转债	2,032,379.58	0.82
18 113009 广汽转债 1,299,363.60 (19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (16	113509	新泉转债	1,963,361.40	0.79
19 128015 久其转债 767,348.50 (20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (17	110045	海澜转债	1,540,200.00	0.62
20 127006 放东转债 434,563.70 (21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 鼎胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (18	113009	广汽转债	1,299,363.60	0.52
21 128017 金禾转债 118,524.42 (22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 開胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (19	128015	久其转债	767,348.50	0.31
22 128029 太阳转债 51,877.30 (23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 開胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (20	127006	敖东转债	434,563.70	0.17
23 128056 今飞转债 35,569.40 (24 128074 游族转债 29,239.90 (25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 阴泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 開胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (21	128017	金禾转债	118,524.42	0.05
24 128074 游族转债 29,239.90 () 25 113021 中信转债 18,445.00 () 26 113025 明泰转债 16,929.00 () 27 113026 核能转债 15,771.00 () 28 113534 開胜转债 11,329.00 () 29 128062 亚药转债 10,851.60 () 30 128064 司尔转债 10,849.00 () 31 113544 桃李转债 8,805.30 ()	22	128029	太阳转债	51,877.30	0.02
25 113021 中信转债 18,445.00 (26 113025 明泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 開胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (23	128056	今飞转债	35,569.40	0.01
26 113025 明泰转债 16,929.00 (27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 開胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (24	128074	游族转债	29,239.90	0.01
27 113026 核能转债 15,771.00 (28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (25	113021	中信转债	18,445.00	0.01
28 113534 關胜转债 11,329.00 (29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (26	113025	明泰转债	16,929.00	0.01
29 128062 亚药转债 10,851.60 (30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (27	113026	核能转债	15,771.00	0.01
30 128064 司尔转债 10,849.00 (31 113544 桃李转债 8,805.30 (28	113534	鼎胜转债	11,329.00	0.00
31 113544 桃李转债 8,805.30 (29	128062	亚药转债	10,851.60	0.00
	30	128064	司尔转债	10,849.00	0.00
32 113022 浙商转债 8,092.00 (31	113544	桃李转债	8,805.30	0.00
	32	113022	浙商转债	8,092.00	0.00
33 110058 永鼎转债 7,934.50 (33	110058	永鼎转债	7,934.50	0.00

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

一) 木拐告期其会份额净值增长家及其与同期业绩比较其准收益家的比较

嘉实稳宏债券 A 业绩比较基 准收益率标 净值增长率 净值增长率 标准差② 业绩比较基 准收益率③ 阶段 1)-(3) (2)-(4) 准差(4) 2017年12 2018年 -7.24% 2.72% 0.15% 0.54% -9.96% 0.39% 2019年 25.08% 0.12% 20.75% 2020年1月

1 日至 2020 年 3 月 31 日	-1.39%	1.31%	1.36%	0.16%	-2.75%	1.15%
嘉实稳宏债券C						
阶段	净值增长率	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
2017年6月 2日(基金合 同生效日)至 2017年12月 31日	0.52%	0.24%	0.56%	0.09%	-0.04%	0.15%
2018年	-7.58%	0.54%	2.72%	0.15%	-10.30%	0.39%
2019 年	24.70%	0.75%	4.33%	0.12%	20.37%	0.63%
2020年1月 1日至2020 年3月31日	-1.48%	1.32%	1.36%	0.16%	-2.84%	1.16%
(<u>_</u>) É	1基金合同4		·累计净值5	曾长率变动	及其与同期:	业绩比较基



图 1: 嘉实稳宏债券 A 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

(2017年6月2日至2020年3月31日)

嘉实稳宏债券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 27.50% 25.00% 20.00% 盖 17.50% 到 15.00% -12.50% 10.00% 7.50% 5.00% 2.50% 0.00% 5.00% -7.50% -- 累计业绩基准收益率 -- 累计净值增长率

图 2: 嘉实稳宏债券 C 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 (2017年6月2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(二)投资范围和(四)投资限制,的有关约定。

(一)与基金运作有关的费用 1、基金费用的种类

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费、律师费和诉讼或仲裁费;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金的证券,期贷交易费用;
(8)基金的银行汇划费用;

(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

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 本基金每日应计提的管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理 费的计算方法如下:

H=E×0.8 %÷当年天数

H=bx0.8 %+=1+大数
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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的数据,自动于次月前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

、4/至业几耳八时忙官贺本基金每日应计提的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×0.15%÷当年天数

H=Ex0.15%+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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的数据,自动于次月前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。 3.基金的销售服务费 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0.35%,销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的0.35%年费率计 提。计算方法如下: H=Ex0.55%+当年天数 H为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

H=Ex0.35%+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 基金销售服务费每日计算,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首日起3个工作日内从基金资产中划出. 经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗 为致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。 上述"1、基金费用的种类中第(4)-(9)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人当期费用,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

(二) 一至並用自有大的項用 1、申购费 本基金A类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	0.8%
100 万元≤M<300 万元	0.5%
300 万元≤M<500 万元	0.3%
М≥500 万元	按笔收取,单笔 1000 元
★其全 C 米其全份 ※ 財会 C 米其全份 ※ 財会 C 米其全の ※ 財子 C 米 其全の ※ 日 C 米 其全の ※ 財子 C 米 其本の ※ 財子 C 米 国 C 米 国 C 米 国 と 本 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 本 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 米 国 と 本 国 と 本 国 と 米 国 と 本 国 と	

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、块齿情记卡持卡人,中败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%执负。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。
2020 年 4 月 2 日,本基金管理人发布了《关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告》,自 2020 年 4 月 3 日起,对通过本公司直销中心(包括直销中心电石及网上直销)申购本基金的养老金客户实施特定申购费率;通过公司直销中心电石及网上直销)申购本基金的养老金客户实施特定申购费率;通过公司直销中心申购本基金的养老金客户实施特定申购费率,通过公司直销中心申购本基金的,直接的申购金额的,则按原费率执行。不再享有费率折扣。其中,养老金客户包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划,企业基金等,可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划,定等基金、可以投资基金的地方社会保障基金、如将来出现可以投资基金的住房公积金、享受税收优惠的个人养老账户,经养老基金监管部门认可的新的养老基金产品,职业年金计划,养老目标基金。如将来出现可以投资基金的住房公积金,享受税收优惠的个人养老账户,经养老基金监管部门认可的新的养老基全产范围。

围。 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2017年7月14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 多),并对通过不过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

持有期限(T)	基金网上直销 后端申购优惠费率
0 <t<1 td="" 年<=""><td>0.10%</td></t<1>	0.10%
1 年≤T<3 年	0.05%
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。 本基金 A 类基金份额的申购费用由申购该类基金份额的投资人承担,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. 赎回费 本基金收取赎回费,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 类基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限(T)	赎回费率
T<7 天	1.50%
7 天≤T<30 天	0.50%
30 天≤T<365 天	0.1%
365 天≤T<730 天	0.05%
T≥730 天	0%
本基金 C 类基金份额赎回费率具体如	1下:
持有期限(T)	赎回费率
T<7 天	1.50%
7 天≤T<30 天	0.5%
T≥30 ₹	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 资者收取的赎回费全额计人基金财产,除此之外的赎回费中 25%计人基金财产。 基金管理人可以在法律法规、基金合同约定的范围内调整费率或收费方式 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》的有关规定在规定媒

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

5. 夜秋饮 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

(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。通过网上直销办不收取申购补差费用。通过网上直销办行。(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 着转出基金有赎回费,则仅收取转出基金的赎回费;② 若转出基金有赎回费,则仅收取转出基金的赎回费;② 若转出基金有赎回费,则不收取转换费用。转出基金有赎回费用的,收取的赎回费归人基金财产的比例不得低于转出基金的基金台同及招募说明书的相关约定。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。基金管理人可以对证的进行发行。基金管理人可以对定销活动范围内的投资者调低基金转换费率。调整后的基金转换费率应及时公告。基金管理人可以对定销活动范围内的投资者调低基金转换费率。嘉实和连转进分方式。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。嘉实申货债债券 C、嘉实来和短价债券。嘉实金工资市通债债券 C、嘉实等价债券 A、嘉实等间债券 A、嘉实等价债券 A、嘉实等价债券 A、嘉实等价债券 A、嘉实等价债券 A、嘉实等价值货券 B、嘉实中短债债券 C、嘉实货币 B、嘉实中证债债券 C、嘉实货币 B、嘉实中证债债券 C、嘉实货币 B、嘉实中证计期企业债指数(LOF)A、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)A、嘉实中证中期企业债指数(LOF)C 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。 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

(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

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人基金费用的项目。

4、具他依据相大法律法规及中国证监会的有大规定个侍列人基金资升的项目。 (四)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。 十四、对招募说明书更新部分的说明 本招募说明书校据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金信息按 盛运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金信息按 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 建计规的理查。经企业基本签理从方本基金公园代处记录社本基金分整的经验经验 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

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:更新了直销机构、代销机构、注册登记机构的相 5.在"八、基金份额的申购与赎回"部分:更新了申购赎回、基金转换的相关内容。

6.在"九、基金的投资"都分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。 7.在"九、基金的投资"都分:补充了本基金最近一期投资组合报告内容。 7.在"十、基金的业绩"部分:更新了基金业绩数据。

十一、对基金份额持有人的服务"部分:更新了对基金份额持有人的服

9.在"二十二、其他应披露事项"部分:更新了相关临时公告事项。 嘉实基金管理有限公司