关于嘉实对冲套利定期混合第三十个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告

公告送出日期:2021 年 11 月 10 日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实对冲套利定期混合	
基金主代码	000585	
基金运作方式	契约型、以定期开放方式运作	
基金合同生效日	2014 年 5 月 16 日	
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人名称	招商银行股份有限公司	
基金注册登记机构名称	嘉实基金管理有限公司	
公告依据	《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》等法律法规以及《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》	
申购起始日	2021 年 11 月 12 日	
赎回起始日	2021 年 11 月 12 日	
转换转入起始日	2021 年 11 月 12 日	
转换转出起始日	2021 年 11 月 12 日	
下属分级基金的基金简称	嘉实对冲套利定期混合 A	嘉实对冲套利定期混合 C
下属分级基金的交易代码	000585	014112
该分级基金是否开放申购、赎回、转换	是	是

注:投资者范围:符合法律法规规定的可投资于证券投资基金的个人投资者、机构投资者和合格境外机构

投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人。

2 申购、赎回、转换业务的办理时间

(1)开放日及开放时间

投资人在开放日办理基金份额的申购、赎回和转换,开放日为开放期内的每个工作日。2021 年 11 月 12 日(含该日)至 2021 年 11 月 18 日(含该日)为本基金第三十个开放期,具体办理时间为上海证券交易所、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本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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称"《信息披露办法》")的有关规定在指定媒介上公告。

(2)申购、赎回、转换开始日及业务办理时间

基金管理人应最迟在开放期前 2 日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告开放期的开始与结束时间。

基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购或者赎回或者转换。开放期以及开放期办理申购与赎回业务的具体事宜见基金管理人届时发布的相关公告。

3 申购业务

3.1 申购金额限制

投资者通过代销机构或嘉实基金管理有限公司网上直销首次申购单笔最低限额为人民币 1 元,追加申购单笔最低限额为人民币 1 元;投资者通过直销中心柜台首次申购单笔最低限额为人民币 20,000 元,但已持有本基金份额的投资者可以适用首次单笔最低限额人民币 1 元,追加申购单笔最低限额为人民币 1 元。但若有代销机构特别约定首次申购单笔及追加单笔最低限额并已经发布临时公告,则以该等公告为准。

投资者可多次申购,对单个投资者累计持有份额不设上限限制。法律法规、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<1000 万元	1.3%
M≥1000 万元	按笔收取,单笔 1000 元

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。

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(包括直销中心柜台及网上直销)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,适用的申购费率为对应申购金额所适用的原申购费率的 10%;申购费率为固定金额的,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、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划、基本养老保险基金、符合人社部规定的养老金产品、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金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围。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 2014 年 9 月 5 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、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。

3.3 其他与申购相关的事项

(1)本基金 A 类份额的申购费在投资者申购 A 类基金份额时收取。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。

(2)本基金 A 类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。

(3)基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额的数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(4)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购费率或收费方式,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介上公告。

4 赎回业务

4.1 赎回份额限制

投资者通过销售机构赎回本基金份额时,可申请将其持有的部分或全部基金份额赎回;单笔赎回不得少于 1 份,每个基金交易账户最低持有基金份额余额为 1 份,若某笔赎回导致某一销售机构的某一基金交易账户的基金份额余额少于 1 份时,基金管理人有权将投资者在该销售机构的某一基金交易账户剩余基金份额一次性全部赎回。投资者通过代销机构赎回本基金的具体单笔赎回最低份额以各销售机构规定为准。

4.2 赎回费率

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(H)	赎回费率
H<30 天	1.50%
30 天≤H<365 天	0.50%
365 天≤H<730 天	0.25%
H≥730 天	0.00%

本基金 C 类基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限(H)	赎回费率
H<7 天	1.50%
7 天≤H<30 天	0.50%
H≥30 天	0.00%

4.3 其他与赎回相关的事项

(1)本基金 A 类基金份额的赎回费用由 A 类基金份额持有人承担。对持续持有期少于 30 日的投资人收取 1.5%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 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担,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。

(2)基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定赎回份额的数量限制,基金管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告并报中国证监会备案。

(3)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整赎回费率或收费方式,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介上公告。

5 转换业务

5.1 可转换基金

本基金开通与嘉实旗下其它开放式基金(由同一注册登记机构办理注册登记的、且已公告开通基金转换业务)之间的转换业务,各基金转换业务的开放状态、交易限制及转换名单可从各基金相关公告或嘉实官网基金详情页面进行查询。

5.2 基金转换费用

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。

4、基金转换份额的计算

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 × 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 × 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)× 转出基金申购费率 ÷(1+ 转出基金申购费率)

转入基金申购费用 =(转出基金金额 − 转出基金赎回费用)× 转入基金申购费率 ÷(1+ 转入基金申购费率)

申购补差费用 =MAX(0,转入基金申购费用 − 转出基金申购费用)

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,收取的赎回费归入基金财产的比例不得低于法律法规、中国证监会规定的比例下限以及该基金基金合同的相关约定。

注:嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实超短债债券、嘉实新趋势混合、嘉实快线货币 A、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、嘉实稳祥纯债债券、嘉实纯债债券、嘉实致盈债券、嘉实新消费股票、嘉实中短债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实价值优势混合、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实成长增强混合、嘉实安益混合、嘉实新起点混合、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实策略优选混合、嘉实价值精选股票、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实稳骏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(含转入)业务;嘉实瑞和两年持有期混合暂停申购(含转入、定投)业务;定期开放基金,在封闭期内无法转换。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

5.3 其他与转换相关的事项

(1)基金转换的时间:投资者需在转出基金和转入基金均有交易的当日,方可办理基金转换业务。

(2)基金转换的原则:

①采用份额转换原则,即基金转换以份额申请;

②当日的转换申请可以在当日交易结束时间前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销;

③基金转换价格以申请转换当日各基金份额净值为基础计算;

④投资者可在任一同时销售拟转出基金及转入基金的销售机构处办理基金转换。基金转换只能在同一销售机构进行。转换的两只基金必须都是该销售机构代理的同一基金管理人管理的、在同一基金注册登记机构处注册的基金;

⑤基金管理人可在不损害基金份额持有人权益的情况下更改上述原则,但应在新的原则实施前在至少一种中国证监会指定媒介公告。

(3)基金转换的程序

①基金转换的申请方式

基金投资者必须根据基金管理人和基金代销机构规定的手续,在开放日的业务办理时间提出转换的申请。

投资者提交基金转换申请时,账户中必须有足够可用的转出基金份额余额。

②基金转换申请的确认

基金管理人应以在规定的基金业务办理时间段内收到基金转换申请的当天作为基金转换的申请日(T 日),并在 T+1 日对该交易的有效性进行确认。投资者可在 T+2 日及之后查询成交情况。

(4)基金转换的数额限制

基金转换时,由本基金转换到基金管理人管理的其他开放式基金时,最低转出份额为 1 份基金份额。但若有代销机构特别约定单笔转换份额最低限额并已经发布临时公告,则以该等公告为准。

基金管理人可根据市场情况制定或调整上述基金转换的有关限制并及时公告。

(5)基金转换的注册登记

投资者申请基金转换成功后,基金注册登记机构在 T+1 日为投资者办理减少转出基金份额、增加转入基金份额的权益登记手续。一般情况下,投资者自 T+2 日起有权赎回转入部分的基金份额。

基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并于开始实施前在至少一种中国证监会指定媒介公告。

(6)基金转换与巨额赎回

当发生巨额赎回时,本基金转出与基金赎回具有相同的优先级,基金管理人可根据基金资产组合情况,决定全额转出或部分转出,并且对于本基金转出和基金赎回,将采取相同的比例确认;但基金管理人在当日接受部分转出申请的情况下,对未确认的转换申请将不予顺延。

(7)拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式

①在开放期发生下列情形时,基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的转入申请:

(a)因不可抗力导致基金无法正常运作。

(b)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况。

(c)证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(d)基金管理人认为接受某笔或某些转入申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益时。

(e)基金资产规模过大,使基金管理人无法找到合适的投资品种,或其他可能对基金业绩产生负面影响,从而损害现有基金份额持有人利益的情形。

(f)基金管理人接受某笔或者某些转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%,或者变相规避 50%集中度的情形。

(g)当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取暂停接受基金转入申请的措施。

(h)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

②在开放期间发生下列情形时,基金管理人可暂停接受投资人的转出申请或者延缓支付转出款项:

(a)因不可抗力导致基金管理人不能支付转出款项。

(b)发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的转出申请或延缓支付转出款项。

(c)证券交易所交易时间非正常停市,导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。

(d)开放期内连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回。

(e)当前一估值日基金资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时,经与基金托管人协商确认后,基金管理人应当采取延缓支付赎回款项或暂停接受基金转出申请的措施。

(f)法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

③基金转换业务的解释权归基金管理人,基金管理人可以根据市场情况在不违背有关法律法规和《基金合同》的规定之前提下调整上述转换的收费方式、费率水平、业务规则及有关限制,但应在调整生效前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

投资者到本基金代销机构的销售网点办理本基金转换业务时,其相关具体办理规定以各代销机构的规定为准。

6 基金销售机构

6.1 直销机构

(1)嘉实基金管理有限公司直销中心

办公地址	北京市东城区建国门南大街 7 号北京万豪中心 D 座 12 层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65215577
联系人	黄娜		

(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元		
电话	(021)38789658	传真	(021)68880023
联系人	邵琦		

(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市高新区交子大道 177 号中海国际中心 A 座 2 单元 21 层 04-05 单元		
电话	(028)86202100	传真	(028)86202100
联系人	罗毅		

(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 16 层		
电话	(0755)84362222	传真	(0755)84362284
联系人	陈寒梦		

(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区山东路 6 号华润大厦 B 座 3101 室		
电话	(0532)66777997	传真	(0532)66777676
联系人	胡洪峰		

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市江干区四季青街道钱江路 1366 号万象城华润大厦 B 座 2 幢 1001A 室		
电话	(0571)88061392	传真	(0571)88021391
联系人	邵琦		

(7)嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 137 号信和广场 1802 单元		
电话	(0591)88013670	传真	(0591)88013670
联系人	陈寒梦		

(8)嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市新街口汉中路 2 号亚太商务楼 23 层 B 区
电话	(025)66671118
联系人	潘曙晖

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广东省广州市天河区冼村路 5 号凯华国际金融中心 36 层 05-06 单元		
电话	(020)29141918	传真	(020)29141914
联系人	陈寒梦		

(10)嘉实基金直销网上交易

投资者可登录本基金管理人网站,通过直销网上交易办理认购 / 申购、赎回、转换、定期定额申购、定期定额赎回、定期定额转换、查询等业务具体参见相关公告。

6.2 场外非直销机构

中国工商银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、北京农村商业银行股份有限公司、青岛银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、乌鲁木齐银行股份有限公司、烟台银行股份有限公司、天津银行股份有限公司、河北银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司、江苏江南农村商业银行股份有限公司、江苏昆山农村商业银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、四川天府银行股份有限公司、福建海峡银行股份有限公司、泉州银行股份有限公司、锦州银行股份有限公司、浙江乐清农村商业银行股份有限公司、桂林银行股份有限公司、浙江杭州余杭农村商业银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、诺亚正行基金销售有限公司、深圳众禄基金销售股份有限公司、上海好买基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、北京展恒基金销售股份有限公司、上海利得基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、北京创金启富基金销售有限公司、宜信普泽(北京)基金销售有限公司、浦领基金销售有限公司、深圳腾元基金销售有限公司、通华财富(上海)基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司、北京广源达信基金销售有限公司、北京加和基金销售有限公司、济安财富(北京)基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、上海中正达广基金销售有限公司、北京虹点基金销售有限公司、奕丰基金销售有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司、大连网金基金销售有限公司、中民财富基金销售(上海)有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、万家财富基金销售(天津)有限公司、上海华夏财富投资管理有限公司、阳光人寿保险股份有限公司、中国人寿保险股份有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、上海挖财基金销售有限公司、腾安基金销售(深圳)有限公司、北京百度百盈基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、上海大智慧基金销售有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海陆金所基金销售有限公司、珠海盈米基金销售有限公司、和耕传承基金销售有限公司、京东肯特瑞基金销售有限公司、北京雪球基金销售有限公司、华瑞保险销售有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、长江证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、长城证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司、浙商证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中泰证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、瑞银证券有限责任公司、中国中金财富证券有限公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司、万联证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、大同证券有限责任公司、财信证券有限责任公司、中原证券股份有限公司、金元证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、长城国瑞证券有限公司、华金证券股份有限公司、中信期货有限公司、东海期货有限责任公司、上海证券有限责任公司、新时代证券股份有限公司、国都证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、江海证券有限公司、华融证券股份有限公司

各代销机构可办理的基金业务类型及具体业务办理状况遵循其各自规定执行。

6.3 其他与基金销售机构相关的事项

销售机构办理本基金申购、赎回及转换等业务的具体网点、流程、规则、数额限制等遵循销售机构的相关规定,各销售机构可办理的基金业务类型及业务办理状况以其各自规定为准。投资者可登录本公司网站(www.jsfund.cn)查询本基金销售机构信息。

7.基金份额净值公告的披露安排

基金管理人将在开放期前最后一个工作日的次日,披露开放期前最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。在基金开放期不晚于每个开放日的次日,基金管理人将通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值,敬请投资者留意。

8. 运用股指期货进行对冲的投资策略的执行情况

嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")自 2021 年 8 月 20 日进入第三十个封闭期,截至 2021 年 11 月 5 日,本基金持有股票资产 426,565,983.10 元,占基金资产净值的比例为 41.21%;运用股指期货进行对冲的空头合约市值 352,678,740.00 元,占基金资产净值的比例为 34.07%。

本基金最新的股指期货交易情况(包括投资政策、持仓情况、损失情况等)、股指期货投资的特定风险,请投资者关注本基金的基金合同、招募说明书及相关最新公告。

9. 其他需要提示的事项

(1)嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金为契约型、以定期开放方式运作的证券投资基金,基金管理人为嘉实基金管理有限公司,注册登记机构为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

(2)本公告仅对本基金的开放申购、赎回和转换业务事项予以说明。投资者欲了解本基金详细情况,请认真阅读《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新,并可登陆本公司网站(www.jsfund.cn)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)进行查询。

(3)投资者 T 日提交的有效申请,在正常情况下,基金注册登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。投资者应在 T+2 日后(包括该日)到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。否则,如因申请未得到基金管理人或注册登记机构的确认而造成的损失,由投资者自行承担。基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表申请一定成功,而仅代表销售机构确实接收到申请。申购与赎回的确认以注册登记机构的确认结果为准。

(4)风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。敬请投资者留意投资风险。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 11 月 10 日

关于嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议部分条款的公告

根据《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的相关规定,为满足基金投资者的需求、为投资者提供多样化的投资选择,嘉实基金管理有限公司(以下简称"本公司")经与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,决定于 2021 年 11 月 12 日起对嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")增加 C 类基金份额类别,并对《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》、《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》及相关法律文件作相应修改。现将具体事宜公告如下:

一、本基金的基金份额分类情况:

本基金根据申购费、销售服务费等费率收取方式的不同将本基金的基金份额分为 A 类、C 类两类基金份额。在本基金的基金份额分类实施后,各类基金份额分别设置对应的基金代码,合并投资运作,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金新增 C 类基金份额(基金代码:014112),收取销售服务费、不收取申购费;本基金原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额(基金代码:000585),收取申购费,不收取销售服务费,A 类基金份额的申购赎回业务规则以及费率结构均保持不变。

投资者申购时可以自主选择与 A 类基金份额或 C 类基金份额相对应的基金代码进行申购。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。

(一)基金费率及分类规则

1、基金费率

	A 类基金份额	C 类基金份额
基金简称	嘉实对冲套利定期混合 A	嘉实对冲套利定期混合 C
基金代码	000585	014112
管理费率(年费率)	1%	1%
附加管理费	符合基金收益分配条件时,该类基金份额将按"新高法"原则提取超额收益的 10%作为附加管理费,在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提	符合基金收益分配条件时,该类基金份额将按"新高法"原则提取超额收益的 10%作为附加管理费,在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提
托管费率(年费率)	0.25%	0.25%
销售服务费率(年费率)	无	0.4%

(二)基金的申购、赎回费率

1、申购费率

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<1000 万元	1.3%
M≥1000 万元	按笔收取,单笔 1000 元

本基金 C 类基金份额申购费率为 0。

2、赎回费率

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 A 类基金份额的赎回费用由赎回 A 类基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期少于 30 天的投资者收取 1.5%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 C 类基金份额的赎回费用由赎回 C 类基金份额的基金份额持有人承担,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。

本基金 A 类基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限(H)	赎回费率
H<30 天	1.50%
30 天≤H<365 天	0.50%
365 天≤H<730 天	0.25%
H≥730 天	0.00%

本基金 C 类基金份额的赎回费率具体如下:

持有期限(H)	赎回费率
H<7 天	1.50%
7 天≤H<30 天	0.50%
H≥30 天	0.00%

(三)C 类基金份额的申购、赎回与转换

投资者可自 2021 年 11 月 12 日起办理本基金 C 类基金份额的申购、赎回与转换业务,本基金 C 类基金份额首笔申购当日的申购价格为当日本基金 A 类基金份额的基金份额净值。具体业务规则请参考本基金更新的招募说明书。

(四)本基金 C 类基金份额适用的销售机构

本基金 C 类基金份额的销售机构在基金管理人网站公示。

二、基金合同、托管协议的修订

本公司根据与基金托管人协商一致的结果,就本基金增设 C 类基金份额等事项对基金合同、托管协议的相关内容进行了修订,本次修订对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响,根据基金合同约定不需要召开基金份额持有人大会。

本基金基金合同、托管协议的修改详见附件《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同前后文对照表》、《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议前后文对照表》。

本基金的基金合同、托管协议全文于 2021 年 11 月 10 日在本公司网站(www.jsfund.cn)和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)披露,供投资者查阅。基金管理人将对基金招募说明书、基金产品资料概要进行更新并按规定公告。

投资者欲了解基金信息请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概及相关法律文件。投资者可登录本基金管理人网站(www.jsfund.cn)或拨打本基金管理人的客户服务电话(400-600-8800)获取相关信息。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 11 月 10 日

附件:《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同前后文对照表》

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
第二部分 释义	55、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数	55、基金份额净值:针对本基金各类基金份额,指计算日某一类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额总数
第二部分 释义	无	56、基金份额类别:指根据申购费、销售服务费等费率收取方式的不同将基金份额分为不同的类别,各基金份额类别可以分别设置代码,合并投资运作,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值 57、A 类基金份额:指在投资人申购基金份额时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 58、C 类基金份额:指从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取申购费用的基金份额 59、销售服务费:指从相应类别基金份额的基金资产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用
第二部分 释义	57、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程	61、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和各类基金份额净值的过程
第三部分 基金的基本情况	无	九、基金份额类别 本基金根据申购费、销售服务费等费率收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购基金份额时收取申购费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费,并不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。相关费率的设置及费率水平在本基金招募说明书、基金产品资料概要或相关公告中列示。 本基金各类基金份额分别设置代码,合并投资运作,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。 投资人在申购基金份额时可自行选择申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得相互转换。 在不违反法律法规规定且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可根据基金发展需要,与基金托管人协商一致后,为本基金增设新的份额类别并设置相应费率、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整,而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
第六部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的原则 1、"未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;	四、申购与赎回的原则 1、"未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类别基金份额的基金份额净值为基准进行计算;
第六部分 基金份额的申购与赎回	七、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金份额净值的计算,保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。在基金封闭期内,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日,披露开放期前最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值。在基金开放期在不晚于每个开放日的次日,基金管理人将通过指定网站、基金销售机构或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按舍去尾数方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按舍去尾数方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 4、申购费用由投资人承担,不列入基金财产。 5、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,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不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。 6、本基金的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书或相关公告中列示。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介上公告。	七、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金各类基金份额的基金份额净值的计算,均保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。在基金封闭期内,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日,披露开放期前最后一个工作日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。在基金开放期在不晚于每个开放日的次日,基金管理人将通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。遇特殊情况,经中国证监会同意,可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金的 A 类基金份额申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日该类基金份额的基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按舍去尾数方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额的基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按舍去尾数方法,保留到小数点后 2 位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 4、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,不列入基金财产。C 类基金份额不收取申购费用。 5、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,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。对于 A 类基金份额,除此之外的赎回费中不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。对 C 类基金份额所收取的赎回费将全额计入基金财产。 6、本基金 A 类基金份额的申购费率、A 类和 C 类基金份额的申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定,并在招募说明书或相关公告中列示。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介上公告。
第六部分 基金份额的申购与赎回	十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 20% 的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。选择延期赎回的,将自动转入下一个工作日、与下一工作日赎回申请一并处理,无优先权并以下一工作日的基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。若下一个工作日进入封闭期,则投资人的赎回申请在开放期最后一个工作日全部受理,赎回价格为该开放期内最后一个工作日的基金份额净值。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额 20%的前提下,如出现单个基金份额持有人超过前一工作日基金总份额 30%的赎回申请("大额赎回申请人")的,基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人("小额赎回申请人")赎回申请的原则,对当日的赎回申请按照以下原则办理;如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认,则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例(单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量)确认,对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理;如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认,则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例,确认其当日受理的赎回申请量,对当日全部未确认的赎回申请(含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请)延期办理。延期办理的具体程序,按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。若下一个开放日不在本开放期内而将跨越下一个封闭期,则小额赎回申请人的赎回申请在本开放期最后一个开放日全部受理;若大额赎回申请人在本开放期最后一个开放日仍有未获受理的赎回申请,则开放期相应延长且延长后不超过 20 个工作日,延长的开放期内不办理申购、亦不接受新的赎回申请,仅为大额赎回申请人办理原开放期内未获受理的赎回申请,并以实际受理日的基金份额净值为基础计算赎回金额。基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。	十、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额的 20% 的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。选择延期赎回的,将自动转入下一个工作日、与下一工作日赎回申请一并处理,无优先权并以下一工作日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。若下一个工作日进入封闭期,则投资人的赎回申请在开放期最后一个工作日全部受理,赎回价格为该开放期内最后一个工作日的该类基金份额净值。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 若基金发生巨额赎回且基金管理人决定部分延期赎回并在当日接受赎回比例不低于上一工作日基金总份额 20%的前提下,如出现单个基金份额持有人超过前一工作日基金总份额 30%的赎回申请("大额赎回申请人")的,基金管理人应当按照优先确认其他赎回申请人("小额赎回申请人")赎回申请的原则,对当日的赎回申请按照以下原则办理;如小额赎回申请人的赎回申请在当日被全部确认,则在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例(单个大额赎回申请人的赎回申请量/当日大额赎回申请总量)确认,对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理;如小额赎回申请人的赎回申请在当日不能被全部确认,则按照单个小额赎回申请人的赎回申请量占当日小额赎回申请总量的比例,确认其当日受理的赎回申请量,对当日全部未确认的赎回申请(含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请)延期办理。延期办理的具体程序,按照本条规定的延期赎回或取消赎回的方式办理。若下一个开放日不在本开放期内而将跨越下一个封闭期,则小额赎回申请人的赎回申请在本开放期最后一个开放日全部受理;若大额赎回申请人在本开放期最后一个开放日仍有未获受理的赎回申请,则开放期相应延长且延长后不超过 20 个工作日,延长的开放期内不办理申购、亦不接受新的赎回申请,仅为大额赎回申请人办理原开放期内未获受理的赎回申请,并以实际受理日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额。基金管理人应当对延期办理的事宜在指定媒介上刊登公告。
第六部分 基金份额的申购与赎回	十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的基金份额净值。	十一、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、如发生暂停的时间为 1 日,基金管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的各类基金份额的基金份额净值。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	三、基金份额持有人 每份基金份额具有同等的合法权益。	三、基金份额持有人 同一类别的每份基金份额具有同等的合法权益。
第八部分 基金份额持有人大会	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会: (5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准;	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会: (5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准或销售服务费率;
第八部分 基金份额持有人大会	一、召开事由 2、尽管存在前述约定,如属于以下情况之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: (3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率;	一、召开事由 2、尽管存在前述约定,如属于以下情况之一的,可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: (3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、赎回费率、调低销售服务费率或调整本基金的基金份额类别设置;
第十四部分 基金资产估值	四、估值程序 1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日基金份额的余额数量计算,精确到 0.001 元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。 每个估值日计算基金资产净值及基金份额净值,并按规定公告。 2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。	四、估值程序 1、各类基金份额的基金份额净值是按照每个工作日闭市后,各类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,精确到 0.001 元,小数点后第四位四舍五入。国家另有规定的,从其规定。 每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值,并按规定公告。 2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将各类基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。
第十四部分 基金资产估值	五、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当基金份额净值小数点后三位以内(含第三位)发生估值错误时,视为基金份额净值错误。 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下: (2)错误偏差达到基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应报中国证监会备案;错误偏差达到基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。	五、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类别的基金份额净值小数点后三位以内(含第三位)发生估值错误时,视为该类基金份额净值错误。 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下: (2)错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时,基金管理人应报中国证监会备案;错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时,基金管理人应当公告,并报中国证监会备案。
第十四部分 基金资产估值	七、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。	七、基金净值的确认 用于基金信息披露的基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人对基金净值予以公布。
第十五部分 基金费用与税收	一、基金费用的种类 无 二、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 (2)基金管理人的附加管理费 1)基金管理人可在同时满足以下条件的前提下,提取附加管理费: ① 符合基金收益分配条件 ② 附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照"新高法原则"提取超额收益的 10%作为附加管理费;即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者,管理人才能收取附加管理费,附加管理费按照下述公式计算并收取。 提取评价日:每次基金封闭期的最后一个工作日 2)附加管理费的计算方法和提取 在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下,附加管理费的计算方法为 附加管理费= $(P_A - P_H) \times 10\% \times S_A$ 其中: P_A 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值 P_A =提取评价日基金份额净值 ×提取评价日的折算因子 + $\sum_{i=1}^{n}$ 第i次基金份额分红 × 第i次分红日的折算因子 P_H 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者,其中首次封闭期的 P_H 为 1 S_A 为提取评价日的基金份额=提取评价日基金总份额÷提取评价日的折算因子 特定日期.的折算因子为相应日期(包括当日)之前所有折算系数的乘积 折算系数=基金折算日除权前基金份额净值÷基金折算日除权后基金份额净值 附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 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。 上述"一、基金费用的种类中第 3-9 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入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。 四、基金管理费、基金托管费的调整 基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日 2 日前在指定媒介刊登公告。	一、基金费用的种类 3、销售服务费; 二、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 (2)基金管理人的附加管理费 1)各类基金份额的附加管理费分别计算,基金管理人可在同时满足以下条件的前提下,针对满足条件的该类基金份额提取附加管理费: ① 符合基金收益分配条件 ② 附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照"新高法原则"提取超额收益的 10%作为附加管理费;即对每一类基金份额而言,每次提取评价日提取附加管理费前的该类基金份额累计净值必须超过以往提取评价日该类基金份额的最高基金份额累计净值、以往开放期期间该类基金份额的最高基金份额累计净值和 1 的孰高者,管理人才能对该类基金份额收取附加管理费,附加管理费按照下述公式计算并收取。 提取评价日:每次基金封闭期的最后一个工作日 2)附加管理费的计算方法和提取 在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下,每一类基金份额的附加管理费的计算方法为 附加管理费= $(P_A - P_H) \times 10\% \times S_A$ 其中: P_A 为提取评价日提取附加管理费前的该类基金份额累计净值 P_A =提取评价日该类基金份额净值 ×提取评价日的折算因子 + $\sum_{i=1}^{n}$ 第i次基金份额分红 × 第i次分红日的折算因子 P_H 为以往提取评价日该类基金份额的最高基金份额累计净值、以往开放期期间该类基金份额的最高基金份额累计净值和 1 的孰高者,其中首次封闭期的 P_H 为 1 S_A 为提取评价日的该类基金份额=提取评价日该类基金总份额÷提取评价日的折算因子 特定日期的折算因子为相应日期(包括当日)之前所有折算系数的乘积 折算系数=基金折算日除权前该类基金份额净值÷基金折算日除权后该类基金份额净值 各类基金份额的附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日分别计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 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。 4、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按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下: H=E×0.4%÷当年天数 H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值 销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中划出,经基金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 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。 四、基金管理费、基金托管费、销售服务费的调整 基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率、销售服务费,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日 2 日前在指定媒介刊登公告。
第十六部分 基金的收益与分配	三、基金收益分配原则 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资(红利再投资申购不受封闭期限制);若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红; 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、每一基金份额享有同等分配权;	三、基金收益分配原则 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资(红利再投资申购不受封闭期限制);若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红; 3、基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日各类基金份额的基金份额净值减去该类基金份额每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权;
第十六部分 基金的收益与分配	六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。	六、基金收益分配中发生的费用 基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足于支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。
第十八部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (四)基金净值信息 基金合同生效后,在基金封闭期内,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日,披露开放期前最后一个工作日的基金份额净值和基金份额累计净值; 在基金开放期不晚于每个开放日的次日,基金管理人将通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日的基金份额净值和基金份额累计净值。	五、公开披露的基金信息 (四)基金净值信息 基金合同生效后,在基金封闭期内,基金管理人应当至少每周在指定网站披露一次各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应在开放期前最后一个工作日的次日,披露开放期前最后一个工作日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值; 在基金开放期不晚于每个开放日的次日,基金管理人将通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在指定网站披露半年度和年度最后一日各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。
第十八部分 基金的信息披露	五、公开披露的基金信息 (八)临时报告 15、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更; 16、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五;	五、公开披露的基金信息 (八)临时报告 15、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更; 16、某类基金份额的基金份额净值计价错误达该类基金份额的基金份额净值百分之零点五;
第十八部分 基金的信息披露	六、信息披露事务管理 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。	六、信息披露事务管理 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额的基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。
第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	六、基金财产清算剩余资产的分配 依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。	六、基金财产清算剩余资产的分配 依据基金财产清算的分配方案,将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后,按各类基金份额资产净值的比例确定剩余财产在各类基金份额中的分配比例,并在各类基金份额可分配的剩余财产范围内按各类别基金份额的基金份额持有人持有的该类基金份额比例进行分配。同一类别的基金份额持有人对基金财产清算后本类别基金份额的剩余资产具有同等的分配权。

注:"第二十四部分 基金合同内容摘要"章节涉及上述内容的一并修改。

附件:《嘉实对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议前后文对照表》

章节	原文条款	修改后条款
	内容	内容
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	(九)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。	(九)基金托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定,对基金资产净值计算、各类基金份额的基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载基金业绩表现数据等进行监督和核查。
四、基金管理人对基金托管人的业务核查	(一)基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。	(一)基金管理人对基金托管人履行托管职责情况进行核查,核查事项包括基金托管人安全保管基金财产、开设基金财产的资金账户、证券账户和期货账户等投资所需账户、复核基金管理人计算的基金资产净值和各类基金份额的基金份额净值、根据基金管理人指令办理清算交收、相关信息披露和监督基金投资运作等行为。
八、基金资产净值计算和会计核算	(一)基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序 1.基金资产净值 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。 基金份额净值是指基金资产净值除以基金份额总数,基金份额净值的计算,精确到 0.001 元,小数点后第四位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。 基金管理人每个工作日计算基金资产净值及基金份额净值,经基金托管人复核,按规定公告。 2.复核程序 基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。 (三)基金份额净值错误的处理方式 基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理基金份额净值错误。	(一)基金资产净值的计算、复核与完成的时间及程序 1.基金资产净值 基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的金额。 各类基金份额的基金份额净值是指以计算日各类基金份额的基金资产净值除以计算日该类基金份额总数,各类基金份额净值的计算,精确到 0.001 元,小数点后第四位四舍五入,国家另有规定的,从其规定。 基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额的基金份额净值,经基金托管人复核,按规定公告。 2.复核程序 基金管理人每工作日对基金资产进行估值后,将各类基金份额的基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人对外公布。 (三)基金份额净值错误的处理方式 基金管理人及基金托管人应当按照《基金合同》的约定处理各类基金份额的基金份额净值错误。