

嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金 基金更新招募说明书摘要

(2020年1月15日更新)

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2012 年 12 月 28 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2012]1763 号）和 2013 年 2 月 1 日《关于嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]66 号）的核准公开发售，本基金基金合同于 2013 年 3 月 8 日正式生效，自该日起本基金管理人开始管理本基金。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。

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、赎回”、“基金的收益分配”、“基金的会计与审计”、“基金资产的估值”、“基金的信息披露”、“基金合同内容摘要”、“基金托管协议的内容摘要”等章节，并对基金管理人、基金托管人等信息一并更新。

一、基金管理人

（一）基金管理人基本情况

1、基本信息

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	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
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，DWS Investments Singapore Limited 30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65215588
传真	（010）65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务

工作部(融资性担保业务监管部际联席会议办公室)主任;中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长,兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生,董事长,党委书记,经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理,2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士,董事,硕士研究生,中共党员。曾任保监会财会部资金运用处主任科员;国都证券有限责任公司研究部高级经理;中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官;现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理;兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

韩家乐先生,董事,1990年毕业于清华大学经济管理学院,硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理;1994年至今,任北京德恒有限责任公司总经理;2001年11月至今,任立信投资有限责任公司董事长。

Mark H. Cullen 先生,董事,澳大利亚籍,澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(Darlington Commodities)商品交易主管,贝恩(Bain&Company)期货与商品部负责人,德意志银行(纽约)全球股票投资部首席运营官、MD,德意志资产管理(纽约)全球首席运营官、MD,德意志银行(伦敦)首席运营官,德意志银行全球审计主管。现任 DWS Management GmbH 执行董事、全球首席运营官。

高峰先生,董事,美国籍,美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁,美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来,曾任德意志银行(纽约、香港、新加坡)董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长,2008年至今任德意志银行(中国)有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

王巍先生,独立董事,美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员,美国化学银行分析师,美国世界银行顾问,中国南方证券有限公司副总裁,万盟投资管理有限公司董事长。2004年至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生,独立董事,中共党员,法学博士,清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编,汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员,现兼任上海证券交易

所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼MBA教育中心主任。

雷霆先生，董事、总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

罗丽丽女士，监事，经济学硕士。2000年7月至2004年8月任北京兆维科技股份有限公司证券事务代表，2004年9月至2006年1月任平泰人寿保险股份有限公司（筹）法律事务主管，2006年2月至2007年10月任上海浦东发展银行北京分行法务经理，2007年10月至2010年12月任工银瑞信基金管理有限公司法律合规经理。2010年12月加入嘉实基金管理有限公司，曾任稽核部执行总监，现任基金运营总监。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

2、基金经理

（1）现任基金经理

刘宁女士，经济学硕士，15年证券从业经历，具有基金从业资格。2004年5月加入嘉实基金管理有限公司，在公司多个业务部门工作，2005年开始从事投资相关工作，先后担任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。2013年7月30日至2014年9月19日任嘉实丰益策略定期开放债券型证券投资基金基金经理、2013年8月21日至2019年4月26日任嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金基金经理、2015年12月15日至2017年12月26日任嘉实新起点灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2016年4月8日至2019年12月5日任嘉实新优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017年1月7日至2019年7月23日任嘉实新添瑞灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017年3月1日至2018年10月8日任嘉实新添程灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2016年12月2日至2019年12月5日任嘉实稳荣债券型证券投资基金基金经理、2017年7月20日至2019年12月10日任嘉实合润双债两年期定期开放债券型证券投资基金基金经理。2013年3月8日至今任嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金基金经理、2013年6月4日至今任嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金基金经理、2016年4月8日至今任嘉实新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2017年3月17日至今任嘉实新添华定期开放混合型证券投资基金基金经理、2017年7月14日至今任嘉实新添泽定期开放混合型证券投资基金基金经理、2017年8月24日至今任嘉实新添丰定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年1月20日至今任嘉实润泽量化一年定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年3月27日至今任嘉实润和量化6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理、2018年4月26日至今任嘉实新添荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2018年7月5日至今任嘉实3年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金经理、2018年9月27日至今任嘉实新添康定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金经理、2018年11月2日至今任嘉实致盈债券型证券投资基金基金经理、2019年4月3日至今任嘉实新添元定期开放混合型证券投资基金基金经理、2019年8月9日至今任嘉实新添益定期开放混合型证券投资基金基金经理、2019年12月4日至今任嘉实民企精选一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

（2）历任基金经理

本基金无历任基金经理。

3、债券投资决策委员会

债券投资决策委员会的成员包括：公司总经理兼固定收益业务首席投资官经雷先生、固定收益体系策略组组长王茜女士、胡永青先生、王怀震先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话：010-66105799

联系人：郭明

（二）主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 人，平均年龄 33 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 68 项最佳托管银行大奖；是

获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

（四）基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014、2015、2016、2017 共十一次顺利通过评估组织内部控制和安全措施最权威的 ISAE3402 审阅，获得无保留意见的控制及有效性报告。充分表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可，也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。”

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

（1）合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

（2）完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

（3）及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

（4）审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

（5）有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

（6）独立性原则。设立专门履行托管人职责的管理部门；直接操作人员和控制人员必须相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

（1）严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

（2）高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

（3）人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

（4）经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

（5）内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

（6）数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

（7）应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

（1）资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

（2）完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

（3）建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

（4）内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

（五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资范围和投资对象、基金投融资比例、基金投资禁止行为、基金参与银行间债券市场、基金资产净值的计算、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，其中对基金的投资比例的监督和核查自基金合同生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、基金合同、基金托管协议或有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

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	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		
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	王启明		

(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	0755-84362200	传真	(0755) 25870663
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2幢1001A室		
电话	(0571) 88061392	传真	(0571) 88021391
联系人	王振		

(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号信合广场801A单元		
电话	(0591) 88013670	传真	(0591) 88013670

联系人	吴志锋
-----	-----

(8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(025) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	徐莉莉		

(9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区珠江西路 5 号广州国际金融中心裙楼 103、203 单元		
电话	(020) 62305005	传真	(020) 62305005
联系人	周炜		

2、代销机构

序 号	代销机构名称	代销机构信息
1	中国工商银行股份有限公司	办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号 联系人:杨菲 传真:010-66107914 客服电话:95588 网 址: http://www.icbc.com.cn , http://www.icbc-ltd.com
2	中国银行股份有限公司	办公地址：中国北京市复兴门内大街 1 号 法定代表人:陈四清 电话:(010)66596688 传真:(010)66594946 客服电话:95566 网址: http://www.boc.cn
3	中国建设银行股份有限公司	办公地址：北京市西城区金融大街 25 号 法定代表人:田国立 客服电话:95533 网址: http://www.ccb.com
4	交通银行股份有限公司	办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号 法定代表人:彭纯 联系人:王菁 电话:021-58781234 传真:021-58408483 客服电话:95559 网址: http://www.bankcomm.com
5	招商银行股份有限公司	办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号 法定代表人:李建红 联系人:季平伟

		电话: (0755) 83198888 传真: (0755) 83195050 客服电话: 95555 网址: http://www.cmbchina.com
6	中信银行股份有限公司	办公地址: 北京市东城区朝阳门北大街9号 法定代表人: 李庆萍 联系人: 丰靖 客服电话: 95558 网址: bank.ecitic.com
7	中国民生银行股份有限公司	办公地址: 中国北京市西城区复兴门内大街2号民生银行大厦 法定代表人: 洪崎 联系人: 王志刚 电话: (010) 58560666 客服电话: 95568 网址: http://www.cmbc.com.cn
8	上海农村商业银行股份有限公司	办公地址: 上海市浦东新区银城中路8号16层 法定代表人: 冀光恒 联系人: 施传荣 电话: 021-38523692 传真: 021-50105124 客服电话: (021) 962999 网址: http://www.srcb.com
9	北京农村商业银行股份有限公司	办公地址: 北京市朝阳区朝阳门北大街16号 法定代表人: 王金山 联系人: 王薇娜 电话: (010) 85605006 传真: (010) 85605345 客服电话: 96198 网址: http://www.bjrcb.com
10	徽商银行股份有限公司	办公地址: 安徽省合肥市安庆路79号天徽大厦A座 法定代表人: 吴学民 联系人: 顾伟平 电话: 0551-65898103 传真: 0551-62667684 客服电话: 4008896588 网址: http://www.hsbank.com.cn
11	江苏银行股份有限公司	办公地址: 江苏省南京市中华路26号 法定代表人: 夏平 联系人: 张洪玮 电话: (025) 58587036 传真: (025) 58587820 客服电话: 95319

		网址: http://www.jsbchina.cn
12	渤海银行股份有限公司	办公地址:天津市河东区海河东路218号 法定代表人:李伏安 联系人:王宏 电话:(022)58316666 传真:(022)58316569 客服电话:400-888-8811 网址: http://www.cbhb.com.cn
13	哈尔滨银行股份有限公司	办公地址:黑龙江省哈尔滨市道里区尚志大街160号 法定代表人:郭志文 联系人:王超 电话:0451-86779007 传真:0451-86779218 客服电话:95537 网址: http://www.hrbb.com.cn
14	河北银行股份有限公司	办公地址:河北省石家庄市平安北大街28号 法定代表人:乔志强 联系人:王娟 电话:0311-88627587 传真:0311-88627027 客服电话:4006129999 网址: http://www.hebbank.com
15	江苏昆山农村商业银行股份有限公司	办公地址:江苏省昆山市前进东路828号 法定代表人:张哲清 联系人:黄怡 电话:0512-57379810 传真:0512-57370750 客服电话:0512-96079 网址: http://www.ksrcb.cn
16	苏州银行股份有限公司	办公地址:江苏省苏州工业园区钟园路728号 法定代表人:王兰凤 联系人:熊志强 电话:0512-69868390 传真:0512-69868370 客服电话:0512-96067 网址: http://www.suzhoubank.com
17	杭州联合农村商业银行股份有限公司	办公地址:杭州市上城区建国中路99号 法定代表人:张海林 联系人:胡莹 电话:0571—87923324 传真:0571—87923214 客服电话:96592 网址: http://www.urcb.com

18	福建海峡银行股份有限公司	办公地址：福建省福州市台江区江滨中大道 358 号 海峡银行大厦 法定代表人：俞敏 联系人：吴白玫 电话：0591-87838759 传真：0591-87388016 客服电话：4008939999 网址： http://www.fjhxbank.com
19	浙江绍兴瑞丰农村商业银行股份有限公司	办公地址：浙江省绍兴市柯桥区柯桥笛扬路 1363 号 法定代表人：俞俊海 联系人：孔张海 电话：0575-84788101 传真：0575-84788100 客服电话：4008896596 网址： http://www.borf.cn/
20	泉州银行股份有限公司	办公地址：泉州市丰泽区云鹿路 3 号 法定代表人：傅子能 联系人：董培姗、王燕玲 电话：0595-22551071 传真：0595-22578871 客服电话：4008896312 网址： http://www.qzccb.com/
21	浙江乐清农村商业银行股份有限公司	办公地址：乐清市城南街道伯乐西路 99 号 法定代表人：高剑飞 联系人：金晓娇 电话：0577-61566028 传真：0577-61566063 客服电话：4008896596 网址： http://www.yqbank.com/
22	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 法定代表人：张小军 联系人：游丹 电话：025-88866645 传真：025-88866724 客服电话：96008 网址： http://www.zjrcbank.com/
23	天相投资顾问有限公司	办公地址：西城区新街口外大街 28 号院 C 座 505 法定代表人：林义相 联系人：谭磊 电话：010-66045182 传真：010-66045518 客服电话：010-66045678 网址： txsec.com

24	和讯信息科技有限公司	办公地址：北京市朝阳区朝阳门外泛利大厦 10 层 法定代表人：王莉 联系人：刘洋 传真：8610-65884788 客服电话：4009200022 网址： http://www.hexun.com/
25	诺亚正行基金销售有限公司	办公地址：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 C 栋 法定代表人：汪静波 联系人：张裕 电话：021-38509735 传真：021-38509777 客服电话：400-821-5399 网址： http://www.noah-fund.com
26	深圳众禄基金销售股份有限公司	办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦 8 楼 801 法定代表人：薛峰 联系人：童彩平 电话：0755-33227950 传真：0755-33227951 客服电话：4006-788-887 网址： http://www.jjmmw.com ; https://www.zlfund.cn
27	上海天天基金销售有限公司	办公地址：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座 法定代表人：其实 联系人：潘世友 电话：021-54509977 传真：021-64385308 客服电话：95021 网址： http://www.1234567.com.cn
28	上海好买基金销售有限公司	办公地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 法定代表人：杨文斌 联系人：张茹 电话：021-20613999 传真：021-68596916 客服电话：4007009665 网址： https://www.howbuy.com/
29	上海长量基金销售投资顾问有限公司	办公地址：上海市浦东新区东方路 1267 号陆家嘴金融服务广场二期 11 层 法定代表人：张跃伟 联系人：单丙烨 电话：021-20691869 传真：021-20691861 客服电话：400-089-1289 网址： http://www.erichfund.com

30	嘉实财富管理有限公司	办公地址：上海市浦东新区世纪大道八号国金中心二期 53 楼 法定代表人：赵学军 联系人：景琪 电话：021-20289890 传真：021-20280110 客服电话：400-021-8850 网址： http://www.harvestwm.cn
31	北京创金启富基金销售有限公司	办公地址：中国北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A 法定代表人：梁蓉 联系人：魏素清 电话：010-66154828 传真：010-63583991 客服电话：400-6262-818 网址： http://www.5irich.com
32	宜信普泽(北京)基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号楼 15 层 1809 法定代表人：戎兵 联系人：魏晨 电话：010-52413385 传真：010-85894285 客服电话：400-6099-200 网址： http://www.yixinfund.com
33	南京苏宁基金销售有限公司	办公地址：南京市玄武区苏宁大道 1-5 号 法定代表人：刘汉青 联系人：喻明明 电话：025-66996699-884131 传真：025-66008800-884131 客服电话：95177 网址： http://www.snjijin.com/
34	众升财富(北京)基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼 3201 内 3201 单元 法定代表人：李招弟 联系人：高晓芳 电话：010-59393923 传真：010-59393074 客服电话：400-876-9988 网址： http://www.wy-fund.com
35	上海汇付基金销售有限公司	办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼 法定代表人：金佶 联系人：陈云卉 电话：021-33323998 传真：021-33323837

		客服电话:400-820-2819
36	上海中正达广基金销售有限公司	办公地址:上海市徐汇区龙腾大道2815号302室 法定代表人:黄欣 联系人:戴珉微 电话:021-33768132 传真:021-33768132*802 客服电话:400-6767-523 网址: http://www.zzwealth.cn
37	上海陆金所基金销售有限公司	办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 法定代表人:胡学勤 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址: http://www.lufunds.com
38	大泰金石基金销售有限公司	办公地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室 法定代表人:袁顾明 联系人:朱海涛 电话:15921264785 传真:021-20324199 客服电话:400-928-2266 网址: http://www.dtfortune.com/
39	珠海盈米基金销售有限公司	办公地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491 法定代表人:肖雯 联系人:黄敏嫦 电话:020-89629019 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址: http://www.yingmi.cn
40	中证金牛(北京)投资咨询有限公司	办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层 法定代表人:钱昊旻 联系人:仲甜甜 电话:010-59336492 传真:010-59336510 客服电话:010-59336512 网址: http://www.jnlc.com
41	国泰君安证券股份有限公司	办公地址:上海市静安区南京西路768号 法定代表人:杨德红 联系人:芮敏祺 电话:(021)38676666 传真:(021)38670666

		客服电话:4008888666 网址:http://www.gtja.com
42	国信证券股份有限公司	办公地址: 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 法定代表人:何如 联系人:周杨 电话:0755-82130833 传真:0755-82133952 客服电话:95536 网址:http://www.guosen.com.cn
43	海通证券股份有限公司	办公地址: 上海市广东路 689 号 法定代表人:周杰 联系人:金芸、李笑鸣 电话:(021)23219000 传真:(021)23219100 客服电话:95553 或拨打各城市营业网点咨询电话 网址:http://www.htsec.com
44	申万宏源证券有限公司	办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 法定代表人:李梅 联系人:陈宇 电话:021-33388214 传真:021-33388224 客服电话:95523 或 4008895523 网址:http://www.swhysc.com
45	华泰证券股份有限公司	办公地址: 江苏省南京市江东中路 228 号 法定代表人:周易 联系人:庞晓芸 电话:0755-82492193 传真:0755-82492962(深圳) 客服电话:95597 网址:http://www.htsc.com.cn
46	长城证券股份有限公司	办公地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层 法定代表人:曹宏 联系人:金夏 电话:(021)62821733 传真:(0755)83515567 客服电话:4006666888、(0755)33680000 网址:http://www.cgws.com
47	东北证券股份有限公司	办公地址: 长春市生态大街 6666 号 法定代表人:李福春 联系人:安岩岩 电话:(0431)85096517 传真:(0431)85096795 客服电话:95360

		网址: http://www.nesc.cn
48	华安证券股份有限公司	办公地址: 安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 法定代表人:章宏韬 联系人:范超 电话:0551-65161821 传真:0551-65161672 客服电话:95318 网址: http://www.hazq.com
49	联讯证券股份有限公司	办公地址: 广东省惠州市惠城区江北东江三路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层 法定代表人:徐刚 联系人:彭莲 电话:0755-83331195 客服电话:95564 网址: http://www.lxsec.com
50	东海期货有限责任公司	办公地址: 江苏省常州市延陵西路23、25、27、29号、上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼 法定代表人:陈太康 联系人:李天雨 电话:021-68757102 传真:021-68757102 客服电话:95531/4008888588 网址: http://www.qh168.com.cn/
51	渤海证券股份有限公司	办公地址: 天津市南开区水上公园东路东侧宁汇大厦A座 法定代表人:王春峰 联系人:蔡霆 电话:(022)28451991 传真:(022)28451892 客服电话:4006515988 网址: http://www.bhzq.com
52	信达证券股份有限公司	办公地址: 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 客服电话:95321 网址: http://www.cindasc.com
53	国都证券股份有限公司	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 法定代表人:王少华 联系人:黄静

		电话:(010)84183389 传真:(010)84183311 客服电话:400-818-8118 网址: http://www.guodu.com
54	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
55	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 (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:021-32109999;029-68918888;4001099918 网址: http://www.cfsc.com.cn
56	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
57	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/
58	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:刘婧漪、贾鹏 电话:028-86690057、028-86690058 传真:028-86690126 客服电话:95310 网址: http://www.gjzq.com.cn

59	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
60	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
61	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
62	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.hcjijin.com/
63	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
64	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/
65	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/
66	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
67	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
68	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） 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	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	吕红、黎明		

（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	电话	(021) 23238888
经办注册会计师	薛竞、周祎		

四、基金名称

本基金名称：嘉实增强信用定期开放债券型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式，债券型基金

六、基金的投资目标

本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争当期总回报最大化，以谋求长期保值增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为国内依法发行及上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）等固定收益类金融工具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相关规定）。

本基金不从二级市场买入股票，不参与一级市场股票首次公开发行或增发，但可持有因所持可转换公司债券转股形成的股票、因持有股票被派发的权证、因投资于可分离交易可转债等金融工具而产生的权证。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的6个月内卖出。因上述原因持有的权证，本基金应在其可交易之日起的1个月内卖出。

除每次季度开放期的前十个工作日和后十个工作日、年度开放期前三个月和后三个月以及开放期以外的期间，本基金投资于债券和银行存款等固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，其中对短期融资券及债项信用评级在AA-级以上（含AA-级）的其他信用类固定收益金融工具（包括但不限于金融债券（不含政策性金融债）、企业债券、公司债券、中期票据、次级债券、政府机构债、地方政府债、资产支持证券、可转换债券（含分离交易可转债）、中小企业私募债券）和银行存款的投资比例合计不低于基金固定收益类资产的80%。开放期内，本基金持有现金或到期日在1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。

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，可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

1、资产配置策略

本基金为达到控制基金组合风险，实现良好收益率的目标，优先考虑对短期融资券及债项信用评级在 AA-级以上（含 AA-级）的其他信用类固定收益金融工具的配置。同时密切关注经济运行趋势，深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，结合各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等方面因素，做出最佳的资产配置，在规避基金组合风险的同时进一步增强基金组合收益。

2、信用债券投资策略

本基金采用“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，深入分析挖掘发债主体的经营状况、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。

在定性与定量分析结合的基础上，通过自下而上的策略，在短期融资券及债项信用评级在 AA-级以上（含 AA-级）的其他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。

（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、发债企业覆盖债务的资产减少、发债企业市场竞争地位恶化、发债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的研究，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、杠杆放大策略

杠杆放大操作即通过债券正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，以获得超额收益的操作方式。本基金在采用杠杆效用的同时注意控制杠杆放大的风险。

4、其他债券投资策略

（1）久期配置策略

本基金将通过积极主动地预测市场利率的变动趋势，相应调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。

本基金根据对市场利率变化趋势的预期，可适当调整组合久期，预期市场利率水平将上升时，适当降低组合久期；预期市场利率将下降时，适当提高组合久期。

（2）期限结构配置策略

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。

（3）换券策略

考虑利率期限结构、流动性、税收、信用级别、久期等的差别，同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，以获取更高的收益率差。或在不同的市场中对风险特性相近的同类产品进行换券，以获取收益更高的产品。

5、资产支持证券投资策略

本基金将通过宏观经济、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，预测资产池未来现金流变化；研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响，同时密切关注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，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

6、中小企业私募债券投资策略

本基金将通过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

险敞口和信用风险敞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，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：一年期银行定期存款税后收益率+1.2%

上述“一年期银行定期存款收益率”是指年度开放期结束后的第一个封闭期首日（若为首个封闭期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期“金融机构人民币存款基准利率”，以后每一个年度开放期结束后的第一个封闭期首日进行调整。

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，而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	188,764,050.00	96.46
	其中：债券	188,764,050.00	96.46
	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	3,904,843.78	2.00
8	其他资产	3,014,481.67	1.54
9	合计	195,683,375.45	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	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	21,006,000.00	15.15
	其中：政策性金融债	21,006,000.00	15.15
4	企业债券	86,218,050.00	62.17
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	81,489,000.00	58.76
7	可转债（可交换债）	51,000.00	0.04
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	188,764,050.00	136.11

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	180406	18 农发 06	100,000	10,693,000.00	7.71
2	101800667	18 豫交投 MTN001	100,000	10,561,000.00	7.62
3	101800757	18 泰州城建 MTN001	100,000	10,483,000.00	7.56
4	143354	17 中车 G2	100,000	10,461,000.00	7.54
5	143360	17 川发 01	100,000	10,318,000.00	7.44

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	7,670.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,006,810.91
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,014,481.67

(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

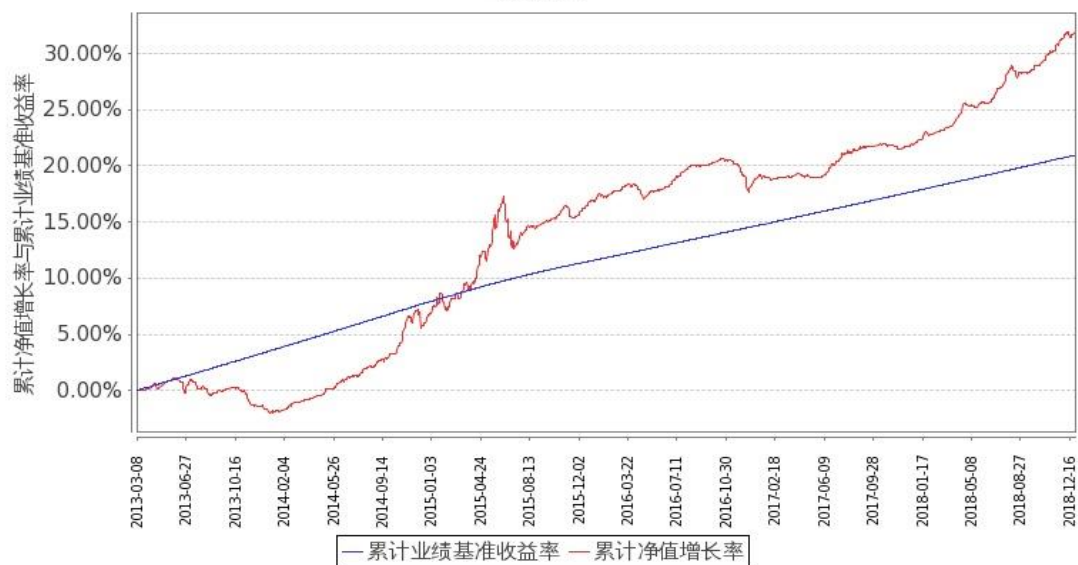
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（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	份额净值 增长率①	份额净值 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
2013年3 月8日至 2013年12 月31日	-1.90%	0.09%	3.50%	0.01%	-5.40%	0.08%
2014年	8.96%	0.13%	4.26%	0.01%	4.70%	0.12%
2015年	9.39%	0.22%	3.37%	0.01%	6.02%	0.21%
2016年	1.42%	0.08%	2.74%	0.01%	-1.32%	0.07%
2017年	2.83%	0.07%	2.74%	0.01%	0.09%	0.06%
2018年	8.26%	0.08%	2.74%	0.01%	5.52%	0.07%

（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

嘉实增强信用定期债券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



图：嘉实增强信用定期债券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

（2013 年 3 月 8 日至 2018 年 12 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“第十三部分（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）与基金运作有关的费用

1、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、律师费和诉讼费；
- （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）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0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.8 \% \div \text{当年天数}$$

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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2 \% \div \text{当年天数}$$

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“1、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或摊入当期费用，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。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，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。如将来出现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，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	申购费率
M < 100 万元	0.32%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.24%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.16%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔

其他投资者申购本基金基金份额申购费率见下表：

申购金额（含申购费）	申购费率
M < 100 万元	0.8%
100 万元 ≤ M < 200 万元	0.6%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	按笔收取，1000 元/笔

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、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。

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，对持续持有期少于7日的投资人，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于等于7日的投资人，赎回费总额的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。

本基金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	1.5%
$7 \leq H \leq 90$ 天	0.3%
$90 \text{ 天} < H \leq 180$ 天	0.2%
$180 \text{ 天} < H \leq 270$ 天	0.1%
$H > 270$ 天	0

3、基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，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体上刊登公告。

4、基金管理人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，针对以特定交易方式（如网上交易等）等进行基金交易的投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率。

（三）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；

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）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费，此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

（五）税收

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。

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》、《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、赎回”、“基金的收益分配”、“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