嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

（2010年第2号）

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

重要提示

(一)嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金或基金”)经中国证券监督管理委员会于2005年6月20日《关于同意嘉实沪深300指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2005]103号)和《关于同意嘉实沪深300指数证券投资基金募集时间安排的函》(基金部函[2005]171号)的批准公开募集。本基金基金合同于2005年8月29日起正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

(二)本招募说明书是对原《嘉实沪深300指数证券投资基金招募说明书》的定期更新，原招募说明书与本招募说明书不一致的，以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

(三)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。

(四)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。

(五)基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(六)本招募说明书所载内容截止日为2010年8月29日(特别事项注明除外)，有关财务数据和净值表现截止日为2010年6月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室
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	王忠民
总经理	赵学军
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%，立信投资有限责任公司30%，德意志资产管理(亚洲)有限公司30%。
存续期间	持续经营
电话	(010)65215588
传真	(010)65185678
联系人	胡勇钦

(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

王忠民先生，董事长。大学专科。曾任北京矿务局财务处会计，煤炭部财务司会计、副处长，中国统配煤矿总公司财务局处长，煤炭部财务公司筹备组负责人，中煤信托有限责任公司董事长兼总经理，2002年3月至今任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长。

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所任信息处长、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月至今任嘉实基金管理有限公司董事、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年至今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。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996年9月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

Ingo Gefeke先生，董事，德国籍，康斯坦斯(Constance)大学国际经济学硕士研究生。曾任德意志银行(纽约)全球交易银行首席运营官及国际投资银行首席运营官。现任德意志资产管理公司(法兰克福)董事会成员，德意志资产管理公司(纽约)董事总经理兼首席行政管理官、全球交易总监。

Mark 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。现任德意志资产管理(纽约)全球首席运营官、MD。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士。1998年9月至2000年6月在北京大学法学学科从事博士后研究工作，2000年7月至今历任清华大学法学院讲师、副教授。现任清华大学法学院副教授。

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至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

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责任公司财务总监。

朱成刚先生，监事，法学博士。1998年7月至2002年1月，就职于中国建设银行资产保全部、法律事务部；2002年1月至今，就职于嘉实基金管理有限公司监察稽核部、法律部。

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，历任督察长和公司副总经理。

李道滨先生，副总经理，中共党员，法学博士，经济师。1988年7月至1990年9月任职于厦门华侨博物馆。1993年7月至1998年9月任职于中国厦门国际经济技术合作公司。2000年10月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任市场部副总监、总监、总经理助理和公司副总经理。

张峰先生，副总经理，中共党员、硕士。曾就职于国家计委，曾任嘉实基金管理有限公司研究部副总监、市场部总监、公司督察长。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司任公司总经理助理。

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

杨宇先生，经济学硕士，毕业于南开大学数学系和金融学系，具有12年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理，2003年3月15日至2004年7月7日任万家(原天同)180指数证券投资基金基金经理。2004年7月加入嘉实基金管理有限公司，2005年8月29日至今任本基金基金经理。

杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具备丰富的投资管理经验。

本基金无历任基金经理。

3、投资决策委员会

本基金采取集体投资决策制度，投资决策委员会的成员包括：公司总经理赵学军先生、公司副总经理戴京焦女士，总经理助理詹凌蔚先生，公司总经理助理邵健先生、总经理助理李凯先生、总经理助理陶荣辉先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)，基本情况如下：

名称：中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册登记日期：1983年10月31日
变更注册登记日期：2004年8月26日
注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
法定代表人：肖 钢
基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
托管及投资者服务部总经理：董杰
托管部门联系人：唐州徽
电话：(010)66594855
传真：(010)66594942

中国银行于1998年设立基金托管部，为进一步树立以投资者为中心的服务理念；根据不断丰富和发展的托管对象和托管服务种类，中国银行于2005年3月23日正式将基金托管部更名为托管及投资者服务部，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工110余人。另外，中国银行在北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行等重点分行已开展托管业务。

三、相关服务机构

(一)柜台(场外)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	北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层		
电话	(010)65215588	传真	(010)65180615
联系人	赵虹		

(2)嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室		
电话	(021)38789658	传真	(021)68880023
联系人	吴冬梅		

(3)嘉实基金管理有限公司成都分公司

办公地址	成都市人民南路一段86号城市之心30H		
电话	(028)86202100	传真	(028)86202100
联系人	胡清泉		

(4)嘉实基金管理有限公司深圳分公司

办公地址	深圳市深南东路5047号发展银行大厦附楼二楼		
电话	(0755)25870686	传真	(0755)25870663
联系人	周炜		

(5)嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路10号颐和国际大厦A座3502室		
电话	(0532)66777766	传真	(0532)66777676
联系人	曹涌		

(6)嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路15号嘉华国际商务中心313室		
电话	(0571)87759328	传真	(0571)87759331
联系人	沈峥		

(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158号环球广场25层04单元		
电话	(0591)88013673	传真	(0591)88013670
联系人	吴冬梅		

(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	施镜葵		

(9)嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路183号大都会广场2415-2416室		
电话	(020)87555163	传真	(020)81552120
联系人	陈涤		

2.代销机构

(1)中国银行

住所	北京市西城区复兴门内大街1号		
办公地址	北京市西城区复兴门内大街1号中国银行总行办公大楼		
法定代表人	肖钢		
电话	(010)66596688	传真	(010)66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

(2)中国工商银行

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街55号		
法定代表人	姜建清	联系人	田耕
电话	(010)66107900	传真	(010)66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

(3)中国建设银行

住所	北京市西城区金融大街25号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼长安兴融中心		
法定代表人	郭树清		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

(4)中国农业银行

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街69号		
法定代表人	项俊波	联系人	滕涛
电话	(010)85108227	传真	(010)85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

(5)招商银行

住所、办公地址	深圳市深南大道7088号招商银行大厦		
法定代表人	秦晓	联系人	邓炯鹏
电话	(0755)83077278	传真	(0755)83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

(6)交通银行

住所、办公地址	上海市银城中路188号		
法定代表人	胡怀邦	联系人	曹榕
电话	(021)58781234	传真	(021)58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

(7)中国民生银行

住所、办公地址	北京市西城区复兴门内大街2号		
法定代表人	董文标	联系人	董云巍、吴海鹏
电话	(010)58351666	传真	(010)83914283
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

(8)中国光大银行

住所、办公地址	北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦		
法定代表人	唐双宁	联系人	李伟
电话	(010)68098778	传真	(010)68560312
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595(全国)

(9)中信银行

住所、办公地址	北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座		
法定代表人	孔丹	联系人	丰靖
电话	(010)65557083	传真	(010)65550827
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

(10)兴业银行

住所	福州市湖东路154号		
办公地址	上海市江宁路168号		
法定代表人	高建平	联系人	梁曦
电话	(021)52629999	传真	(021)62569070
网址	www.cib.com.cn	客服电话	95561

(11)深圳发展银行

住所、办公地址	深圳深南东路5047号深圳发展银行大厦		
法定代表人	肖遂宁		
联系人	张青		
电话	(0755)82088888	传真	(0755)82080406
网址	www.sdb.com.cn	客服电话	95501

(12)上海浦东发展银行

住所	上海市浦东新区浦东南路500号		
办公地址	上海市北京东路689号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	倪苏云、虞谷云
电话	(021)61618888	传真	(021)63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

(13)北京银行

住所	北京市西城区金融大街甲17号首层		
办公地址	北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦		
法定代表人	闫冰竹	联系人	王曦
电话	(010)66223584	传真	(010)66226073
网址	www.bankofbeijing.com.cn	客服电话	(010)96169

(14)平安银行

住所、办公地址	深圳市深南中路1099号平安银行大厦		
法定代表人	孙建一	联系人	霍兆龙
电话	(0755)25859591	传真	(0755)25879453
网址	http://bank.pingan.com	客服电话	4006699999

(15)广东发展银行

住所、办公地址	广东省广州市农林下路83号		
法定代表人	董建岳	联系人	李晓鹏
电话	(020)38322256	传真	(020)87310955
网址	www.gdb.com.cn	客服电话	800-830-8003、400-830-8003

(16)宁波银行

住所、办公地址	宁波市江东区中山东路294号		
法定代表人	陆华裕	联系人	胡技勋
电话	(021)63586210	传真	(021)63586215
网址	www.nbcb.com.cn	客服电话	96528、962528上海地区

(17)东莞银行

住所、办公地址	东莞市城区运河东一路193号		
法定代表人	廖玉林	联系人	胡昱
电话	(0769)22119061	传真	(0769)22117730
客服电话	(0769)96228		
网址	www.dongguanbank.cn		

(18)杭州银行

住所、办公地址	杭州市庆春路46号杭州银行大厦		
法定代表人	马时雍	联系人	江波
电话	(0571)85108309	传真	(0571)85108309
客服电话	400-888-8508	网址	www.hzbank.com.cn

(19)浙商银行

住所、办公地址	浙江省杭州市庆春路288号		
法定代表人	张达洋	联系人	吴军阳
电话	(0571)87659084	传真	(0571)87659188
网址	www.czbank.com	客服电话	95105665

(20)江苏银行

住所、办公地址	南京市洪武北路55号		
法定代表人	黄志伟	联系人	田春慧
电话	(025)58588167	传真	(025)58588164
网址	www.jsbchina.cn	客服电话	(025)96098、4008696098

(21)中信证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦第A层		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010)84863893	传真	(010)84865560
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	(010)84588888

(22)广发证券股份有限公司

住所	广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)		
办公地址	广东省广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼		
法定代表人	王志伟	联系人	黄岚
电话	(020)87555888	传真	(020)87555305
网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575或致电各地营业网点

(23)中信建投证券有限责任公司

住所	北京市朝阳区安立路66号4号楼		
办公地址	北京市朝阳门内大街188号		
法定代表人	张佑君	联系人	权唐
清算传真	(010)65183880	业务传真	(010)65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

(24)海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路98号		
办公地址	上海市广东路689号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021)23219000	传真	(021)23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553或拨打各城市营业网点咨询电话

(25)申银万国证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市常熟路171号		
法定代表人	丁国荣	联系人	李清怡
电话	(021)54033888	传真	(021)54030294
网址	www.sw2000.com.cn	客服电话	(021)962505

(26)国泰君安证券股份有限公司

住所	上海市浦东新区商城路618号		
办公地址	上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼		
法定代表人	祝幼一	联系人	芮敏祺
电话	(021)38676666	传真	(021)38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

(27)中国银河证券股份有限公司

住所办公地址	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座		
法定代表人	顾伟国	联系人	田薇
电话	(010)66568430	传真	(010)66568536
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-888-8888

(28)兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路99号标力大厦		
办公地址	上海市浦东新区民生路1199弄证大·五道口广场1号楼21层		
法定代表人	兰荣	联系人	谢高得
电话	(021)38565785	传真	(021)38565955
网址	www.xyzq.com.cn	客服电话	4008888123

(29)招商证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层		
法定代表人	宫少林	联系人	黄健
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

(30)华泰证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦		
法定代表人	吴万善	联系人	程高峰
电话	(025)84457777	传真	(025)84579763
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

(31)华泰联合证券有限责任公司

住所	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层		
办公地址	深圳市福田中心区中心广场香港中旅大厦第5层、17层、18层、24层、25层、26层		
法定代表人	马昭明	联系人	盛宗凌
电话	(0755)82492000	传真	(0755)82492962
网址	www.lhzq.com	客服电话	95513

(32)长城证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层		
法定代表人	黄耀华	联系人	匡婷
电话	(0755)83516289	传真	(0755)83516199
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755)33680000

(33)国都证券有限责任公司

住所、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10层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010)84183333	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

(34)广发华福证券有限责任公司

住所	福州市五四路157号新天地大厦7、8层		
办公地址	福州市五四路157号新天地大厦7至10层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	(0591)87841160	传真	(0591)87841150
客服电话	(0591)96326	网址	www.gfhfzq.com.cn

(35)光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	徐浩明	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021)22169999	传真	(021)22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788、10108998

(36)渤海证券股份有限公司

住所、办公地址	天津市南开区宾水西道8号		
办公地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
法定代表人	王春峰	联系人	王兆权
电话	(022)28451861	传真	(022)28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

(37)国信证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	齐晓燕
电话	(0755)82130833	传真	(0755)82133302
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

(38)安信证券股份有限公司

住所	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元		
办公地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元 深圳市福田区深南大道凤凰大厦1栋9层		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	(0755)82825551	传真	(0755)82558355
网址	www.essences.com.cn	客服电话	4008001001

(39)东北证券股份有限公司

住所、办公地址	长春市自由大路1138号		
法定代表人	矫正中	联系人	潘锴
电话	(0431)85096709	传真	(0431)85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431)85096733

(40)平安证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼		
法定代表人	杨宇翔	联系人	周璐
电话	4008866338	传真	(0755)82400862
网址	www.PINGAN.com	客服电话	4008816168

(41)国元证券股份有限公司

住所、办公地址	安徽省合肥市寿春路179号		
法定代表人	凤良志	联系人	陈玲玲
电话	(0551)2246273	传真	(0551)2272100
网址	www.gyzq.com.cn		
客服电话	95578		

(42)中国建银投资证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层		
法定代表人	杨明辉	联系人	杨瑞芳
电话	(0755)82026511	传真	(0755)82026539
网址	www.cjis.cn	客服电话	400-600-8008

(43)湘财证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼		
法定代表人	林俊波	联系人	李梦诗
电话	(021)68634518-8631	传真	(021)68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

(44)中银国际证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39层		
办公地址	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层		
法定代表人	唐新宇	联系人	张静
传真	(021)50372474	客服电话	4006208888
网址	www.bocichina.com.cn		

(45)德邦证券有限责任公司

住所	上海市普陀区曹阳路510号南半幢9楼		
办公地址	上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼		
法定代表人	方加春	联系人	罗芳
电话	(021)68761616	传真	(021)68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

(46)财富证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26、27层		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731)4403319	传真	(0731)4403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731)4403319

(47)中信万通证券有限责任公司

住所	青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)		
办公地址	青岛市东海西路28号		
法定代表人	张智河	联系人	吴忠超
电话	(0532)85022326	传真	(0532)85022605
网址	www.zxwt.com.cn	客服电话	(0532)96577

(48)中航证券有限公司

住所、办公地址	江西省南昌市抚河北路291号		
法定代表人	杜航	联系人	余雅娜
电话	(0791)6768763	传真	(0791)6789414
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

(49)中信金通证券有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19层、20层		
法定代表人	刘军	联系人	王莅艺
电话	(0571)85783750	传真	(0571)85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571)96598

(50)长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特8号长江证券大厦		
法定代表人	胡运钊	联系人	李良
电话	(027)65799999	传真	(027)85481900
客服电话	4008-888-999或(027)85808318		
网址	www.95579.com		

(51)金元证券股份有限公司

住所	海南省海口市南宝路36号证券大厦4层		
办公地址	深圳市深南大道4001号时代金融中心17层		
法定代表人	陆涛	联系人	金春
电话	(0755)83025695	传真	(0755)83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

(52)国海证券有限责任公司

住所、办公地址	广西南宁市滨湖路46号		
法定代表人	张雅锋	联系人	覃清芳
电话	(0771)5539262	传真	(0771)5539033
网址	www.ghzq.com.cn	客服电话	4008888100、96100(广西)

(53)国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市永叔路15号		
办公地址	江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦4楼		
法定代表人	裘强	联系人	刘方
电话	(0791)6273972	传真	(0791)6288690
网址	www.gsstock.com	客服电话	(0791)6285337、6283827

(54)山西证券股份有限公司

住所、办公地址	太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	张治国
电话	(0351)8686703	传真	(0351)8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

(55)西部证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市东新街232号信托大厦16-17楼		
法定代表人	刘建武	联系人	冯萍
电话	(029)87406488	传真	(029)87406387
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

(56)广州证券有限责任公司

住所、办公地址	广州市先烈中路69号东山广场主楼17楼		
法定代表人	吴志明	联系人	林洁茹
电话	(020)87322668	传真	(020)87325036
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020)961303

(57)国联证券股份有限公司

住所、办公地址	江苏省无锡市县前东街168号		
法定代表人	雷建辉	联系人	徐欣
电话	(0510)82831662	传真	(0510)82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	4008885288

(58)东吴证券股份有限公司

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路181号商旅大厦		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	(0512)65581136	传真	(0512)65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	(0512)33396288

(59)南京证券有限责任公司

住所、办公地址	江苏省南京市大钟亭8号		
法定代表人	张华东	联系人	水晨
电话	(025)83367888	传真	(025)83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

(60)浙商证券有限责任公司

住所、办公地址	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼		
法定代表人	吴承根	联系人	吴颖
电话	(0571)87902080	传真	(0571)87901913
网址	www.stocke.com.cn	客服电话	(0571)967777

(61)恒泰证券股份有限公司

住所、办公地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路111号		
法定代表人	鞠瑾	联系人	常向东
电话	(0471)4913998	传真	(0471)4930707
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471)4961259

(62)东海证券有限责任公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路23号投资广场18、19楼		
法定代表人	朱科敏	联系人	李涛
电话	(0519)88157761	传真	(0519)88157761
网址	www.longone.com.cn	客服电话	400-888-8588

(63)东方证券股份有限公司

住所	上海市中山南路318号2号楼22-29层		
办公地址	上海市中山南路318号2号楼21-29层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	吴宇
电话	(021)63325888	传真	(021)63326173
网址	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

(64)第一创业证券有限责任公司

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层		
法定代表人	刘学民	联系人	魏颖
电话	(0755)25832852	传真	(0755)82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

(65)宏源证券股份有限公司

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路233号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街19号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010)88085858	传真	(010)88085240
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

(66)民生证券有限责任公司

住所	北京市朝阳门外大街16号中国人寿大厦1901室		
办公地址	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心16-18层		
法定代表人	岳献春	联系人	赵明
电话	(010)85127622	传真	(010)85127917
网址	www.mszq.com	客服电话	400-619-8888

(67)新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街1号A座8层		
法定代表人	马金声	联系人	戴荻
电话	(010)83561146	传真	(010)83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

(68)北京证券有限责任公司

住所、办公地址	北京海淀区车公庄西路乙19号华通大厦B座10层		
法定代表人	凌新源	联系人	白源
电话	(010)68431166	传真	(010)88018657
网址	www.bjzq.com.cn	客服电话	(010)68431166-8002、8009

(69)上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市西藏中路336号		
法定代表人	郁忠民	联系人	王伟力
电话	(021)53519888	传真	(021)53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518

(70)世纪证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳深南大道7088号招商银行大厦40-42层		
法定代表人	卢长才	联系人	张婷
电话	(0755)83199511	传真	(0755)83199545
网址	www.csco.com.cn	客服电话	(0755)83199509

(71)华西证券有限责任公司

住所	四川省成都市陕西街239号		
办公地址	深圳市深南大道4001号时代金融中心18楼深圳总部		
法定代表人	杨炯洋	联系人	金达勇
电话	(0755)83025723/(028)86150035	传真	(0755)83025991/(028)86155733
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

(72)中原证券股份有限公司

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路10号		
法定代表人	石保上	联系人	程月艳 耿铭
电话	(0371)65585670	传真	(0371)65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	967218、4008139666

(73)东莞证券有限责任公司

住所、办公地址	东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼		
法定代表人	游锦辉	联系人	罗绍辉
电话	(0769)22119351	传真	(0769)22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769)961130

(74)华龙证券有限责任公司

住所、办公地址	甘肃省兰州市静宁路308号		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
电话	(0931)4890208	传真	(0931)4890628
客服电话	(0931)4890208、(0931)4890619	网址	www.hlzqgs.com

(75)万联证券有限责任公司

住所、办公地址	广州市中山二路18号广东电信广场36-37层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	(020)37865070	传真	(020)22373718-1013
网址	www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

(76)财通证券有限责任公司

住所、办公地址	浙江杭州市解放路111号金钱大厦		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571)87925129	传真	(0571)87828042
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571)96336、962336(上海地区)

(77)齐鲁证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市经十路20518号		
办公地址	山东省济南市经十路17703号华特广场		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531)81283938	传真	(0531)81283900
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

(78)大同证券经纪有限责任公司

住所	山西省大同市大北街13号		
办公地址	山西省太原市青年路8号		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351)4167056	传真	(0351)4192803
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	(0351)4167056

(79)瑞银证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层		
法定代表人	刘弘	联系人	谢亚凡、田文健
电话	(010)58328752、58328725	传真	(010)58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

(80)华鑫证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元		
法定代表人	王文学	联系人	杨小江
电话	(0755)82083788	传真	(0755)82083408
客服电话	(021)32109999，(029)68918888		
网址	www.cfsc.com.cn		

(81)中山证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	刘军
电话	(0755)83734659	传真	(0755)82960582
网址	www.zszq.com.cn	客服电话	(0755)82943750

(82)天相投资顾问有限公司

住所	北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701		
办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层		
法定代表人	林义相	联系人	潘鸿
电话	(010)66045446	传真	(010)66045500
客服电话	(010)66045678		
网址	www.txjijin.com		

(83)江海证券有限公司

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号		
法定代表人	孙名扬	联系人	徐世旺
电话	(0451)82336863	传真	(0451)82287211
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

(84)中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9层		
法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	(010)59355941	传真	(010)66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

(85)厦门证券有限公司

住所、办公地址	厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼		
法定代表人	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	(0592)5161642	传真	(0592)5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	(0592)5163588

(86)爱建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市南京西路758号24楼		
法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	(021)32229888-3121	传真	(021)62878783
客服电话	(021)63340678	网址	www.ajzq.com

(87)华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦37层		
法定代表人	陈林	联系人	楼斯佳
电话	(021)50122222	传真	(021)50122200
客服电话	4008209898	网址	www.cnhbstock.com

(88)方正证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
法定代表人	雷杰	联系人	彭博
电话	(0731)85832343	传真	(0731)85832214
客服电话	95571	网址	www.foundersc.com

(89)英大证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	赵文安	联系人	王睿
电话	(0755)83007069	传真	(0755)83007167
客服电话	(0755)26982993	网址	www.ydsc.com.cn

(90)西南证券股份有限公司

住所、办公地址	重庆市渝中区临江支路2号合景国际大厦A幢		
法定代表人	王珠林	联系人	米兵
电话	(023)63786922	传真	(023)63810422
客服电话	4008096096	网址	www.swsc.com.cn

(91)日信证券有限责任公司

住所	呼和浩特市新城区锡林南路18号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街1号长安兴融中心西楼11层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	陈韦杉
电话	(010)88086830-730	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	(010)88086830		

(92)信达证券股份有限公司

住所	北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层		
办公地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心		
法定代表人	张志刚	联系人	唐静
电话	(010)63081000	传真	(010)63080978
客服电话	400-800-8899	网址	www.cindasc.com

(93)东兴证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层		
法定代表人	崔海涛	联系人	黄英
电话	(010)66555835	传真	(010)66555246
客服电话	400-8888-993	网址	www.dxzq.net

(94)华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区月坛北街26号		
办公地址	北京市西城区金融大街8号中国华融A座3层		
法定代表人	丁之锁	联系人	梁宇
电话	(010)58568007	传真	(010)58568062
客服电话	(010)58568118	网址	www.hrsec.com.cn

(二)深圳证券交易所(场内)基金份额发售机构

场内基金份额发售机构为深圳证券交易所会员单位，即具有基金代销业务资格的证券公司：包括国信证券、招商证券、平安证券、长城证券、光大证券、方正证券、华泰证券、广发证券、广州证券、世纪证券、华西证券、国海证券、联讯证券、南京证券、华鑫证券、华林证券、厦门证券、民族证券、申银万国证券、中信万通证券、海通证券、山西证券、民生证券、兴业证券、广发华福、长江证券、东莞证券、国联证券、国金证券、东北证券、恒泰证券、华安证券、东海证券、中信证券、东吴证券、中山证券、第一创业证券、大同证券、宏源证券、西藏证券、湘财证券、中金公司、华泰联合证券、东方证券、国泰君安证券、西南证券、银河证券、西部证券、渤海证券、上海证券、华龙证券、万联证券、齐鲁证券、国元证券、国都证券、中银证券、华宝证券、红塔证券、中信金通、日信证券、浙商证券、江南证券、财富证券、金元证券、国盛证券、中原证券、德邦证券、财通证券、新时代证券、远东证券、江海证券、中投证券、中信建投证券、安信证券、银泰证券、瑞银证券等(排名不分先后)。

(三)注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
注册地址	北京西城区金融大街27号投资广场23层		
法定代表人	金颖	联系人	朱立元
电话	(010)58598839	传真	(010)58598907

(四)律师事务所和经办律师

名称	国浩律师集团(北京)事务所		
住所、办公地址	北京市朝阳区东三环北路38号泰康金融大厦9层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	(010)65171188	传真	(010)65176801
经办律师	黄伟民		

(五)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有限公司		
住所	上海市浦东新区东昌路568号		
办公地址	上海卢湾区湖滨路202号企业天地2号楼普华永道中心11楼		
法定代表人	杨绍信	联系人	陈宇
电话	(021)61238888	传真	(021)61238800
经办注册会计师	曹银华、陈宇		

四、基金的名称

本基金名称：嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)

五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金进行被动式指数化投资，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，以实现对沪深300指数的有效跟踪，谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括沪深300指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)，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5%。

此外，本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，待指数衍生金融产品推出以后，本基金可以运用衍生金融产品进行风险管理。

八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金经理会对投资组合进行适当调整，以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓期为3个月，3个月之后本基金投资组合将达到基金合同的相关规定。

1、资产配置比例

本基金原则上将不低于90%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于15%，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5%。本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票组合构建

(1)股票投资原则

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资，根据沪深300指数成份股的基准权重构造股票指数化投资组合。

(2)股票组合构建方法

本基金原则上采用指数复制法，按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建股票投资组合。如有(a)因受股票停牌的限制，股票流动性等其他市场因素，使基金管理人无法依指数权重购买某成份股，或(b)预期标的指数的成份股即将调整，或(c)其他影响指数复制的因素，基金经理可以根据市场情况，结合经验判断，对本基金资产进行适当调整，以期在规定的风险承受限度之内，获得更接近标的指数的收益率。

(3)风险收益目标

本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资，在日常管理过程中，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于0.3%，以实现对标的指数的有效跟踪，分享中国股票市场的长期收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金以沪深300指数为标的指数，业绩衡量基准为95%的沪深300指数增长率加5%的银行同业存款收益率。

十、基金的风险收益特征

风险中等，获得证券市场平均收益率。

十一、基金的投资组合报告

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年7月19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2010年6月30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	26,619,150,678.95	93.32
	其中：股票	26,619,150,678.95	93.32
2	固定收益投资	1,234,685,000.00	4.33
	其中：债券	1,234,685,000.00	4.33
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	606,273,285.34	2.13
6	其他资产	65,269,823.77	0.23
	合计	28,525,378,788.06	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末指数投资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	105,921,758.38	0.37
B	采掘业	2,770,171,680.39	9.78
C	制造业	7,894,553,743.84	27.87
C0	食品、饮料	1,223,157,760.04	4.32
C1	纺织、服装、皮毛	111,367,098.10	0.39
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	72,930,383.94	0.26
C4	石油、化学、塑胶、塑料	554,875,856.04	1.96
C5	电子	109,884,076.40	0.39
C6	金属、非金属	2,057,180,935.44	7.26
C7	机械、设备、仪表	2,684,641,201.17	9.48
C8	医药、生物制品	987,938,438.16	3.49
C99	其他制造业	92,577,994.55	0.33
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,019,129,356.53	3.60
E	建筑业	947,977,182.04	3.35
F	交通运输、仓储业	1,241,425,669.03	4.38
G	信息技术业	946,855,966.02	3.34
H	批发和零售贸易	847,722,146.84	2.99
I	金融、保险业	8,588,384,626.90	30.32
J	房地产业	1,449,996,656.69	5.12
K	社会服务业	265,823,891.40	0.94
L	传播与文化产业	61,167,688.88	0.22
M	综合类	480,020,312.01	1.69
	合计	26,619,150,678.95	93.99

(2)报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末本基金未持有积极投资股票。

3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

(1)报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	77,496,293	1,008,226,771.93	3.56
2	601318	中国平安	20,540,699	961,510,120.19	3.39
3	601328	交通银行	130,441,338	783,952,441.38	2.77
4	600016	民生银行	117,958,917	713,651,447.85	2.52
5	601166	兴业银行	26,287,207	605,394,377.21	2.14
6	600000	浦发银行	43,161,758	586,999,908.80	2.07
7	600030	中信证券	43,628,961	510,458,843.70	1.80
8	601398	工商银行	125,556,809	509,760,644.54	1.80
9	601088	中国神华	20,668,942	454,096,655.74	1.60
10	601601	中国太保	19,698,529	448,535,505.33	1.58

(2)报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

报告期末本基金未持有积极投资股票。

注：根据本基金基金合同的约定，本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法。原则上将不低于90%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于15%。

4. 报告期末按券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	1,234,685,000.00	4.36
3	金融债券	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	可转换债券	–	–
7	资产支持证券	–	–
8	其他	–	–
	合计	1,234,685,000.00	4.36

5. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901036	09央行票据36	3,000,000	294,510,000.00	1.04
2	1001019	10央行票据19	2,400,000	234,840,000.00	0.83
3	1001021	10央行票据21	1,800,000	176,112,000.00	0.62
4	0901042	09央行票据42	1,300,000	127,608,000.00	0.45
5	0801044	08央行票据44	1,000,000	101,760,000.00	0.36

6. 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

8. 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)报告期末其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	1,687,202.37
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	13,304,905.22
4	应收利息	12,584,267.39
5	应收申购款	37,693,448.79
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
	合计	65,269,823.77

(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

①报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票简称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	961,510,120.19	3.39	筹划重大资产重组

②报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

十二、基金的业绩

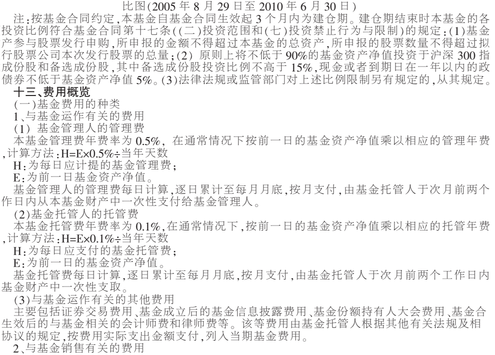
基金业绩截止日为2010年6月30日。

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)基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2005年8月29日基金合同生效日至2005年12月31日	-1.90%	0.82%	-0.48%	0.89%	-1.42%	-0.07%
2006年年度	120.19%	1.32%	112.79%	1.33%	7.40%	-0.01%
2007年年度	130.32%	2.18%	150.20%	2.18%	-19.88%	0.00%
2008年年度	-64.36%	2.92%	-63.85%	2.89%	-0.51%	0.03%
2009年年度	91.97%	1.95%	90.72%	1.95%	1.25%	0.00%
2010年上半年	-26.69%	1.51%	-27.05%	1.51%	0.36%	0.00%

(二)自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准收益率的变动比较



图：嘉实沪深300指数(LOF)累计份额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(2005年8月29日至2010年6月30日)

注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效起3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十七条((二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制)的规定：(1)基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；(2)原则上将不低于90%的基金资产净值投资于沪深300指数成份股和备选成份股，其中备选成份股投资比例不高于15%，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5%。(3)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

十三、费用概览

(一)基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

(1)基金管理人的管理费

本基金管理费年费率为0.5%，在通常情况下按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率，计算方法：H=E×0.5%÷当年天数

H：为每日应计提的基金管理费；

E：为前一日基金资产净值。

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从本基金财产中一次性支付给基金管理人。

(2)基金托管人的托管费

本基金托管费年费率为0.1%，在通常情况下，按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率，计算方法：H=E×0.1%÷当年天数

H：为每日应支付的基金托管费；

E：为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

(3)与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金成立后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费等。该等费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

本基金的申购费率不高于1.5%，随申购金额的增加而递减：

申购金额(M，含申购费)	申购费率
M<50万	1.5%
50万元≤M<200万元	1.2%
200万元≤M<500万元	1.0%
M≥500万元	按笔收取，1000元/笔

个人投资者通过本基金管理人网上交易和电话交易系统申购本基金实行申购费率优惠，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%；但招商银行借记卡、中国建设银行龙卡、中国农业银行金穗卡持卡人，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，优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%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开放式基金业务，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临时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。

(2)赎回费

本基金场内的赎回费率统一为0.5%；本基金场外赎回费率不高于0.5%，随在开放式基金账户中的持有期限的增加而递减：

持有期限	赎回费率
持有期<一年	0.5%
一年≤持有期<两年	0.25%
持有期≥两年	0

本基金收取的赎回费中25%的部分归入基金财产。

(3)转换费

本基金与嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)场外基金份额之间互相转换时，基金转换费率采用“赎回费 + 申购费率补差”算法，计算公式如下：

净转入金额 = B×C×(1-D)/(1+G)

转换补差费用 = [B×C×(1-D)/(1+G)]×G

转入份额 = 净转入金额 / E

其中，B 为转出的基金份额；

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值；

D 为转出基金的对应赎回费率；

G 为对应的申购补差费率，当转出基金的申购费率 ≥ 转入基金的申购费率时，则申购补差费率G为零；

E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费的25%归入转出基金资产。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

(4)销售服务费，具体计提办法按中国证监会的规定执行。

3、其他费用

按照国家有关规定可以列入的其他费用，根据相关法律及中国证监会相关规定，从当期基金财产中支付。

(二)不列入基金费用的项目

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本基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(三)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磋商酌情降低基金管理费、基金托管费，下调前述费率无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前3个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(四)基金的税收

本基金运作过程中的各类纳税主体，依照国家法律法规的规定，履行纳税义务。

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》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对基金管理人于2005年7月2日刊登的本基金原招募说明书进行了更新，并根据本基金管理人在本基金合同生效日后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新。

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的截止日期。

2.在“三、基金管理人”部分：更新了基金管理人的相关信息。

3.在“四、基金托管人”部分：更新了托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分：增加江苏银行、东莞银行、中国光大银行、华融证券、恒泰证券5家代销机构，并更新相关代销机构信息。

5.在“十三、基金的投资”部分：补充了本基金最近一期投资组合报告内容。

6.在“十四、基金的业绩”部分：说明了本基金2005年8月29日至2005年12月31日、2006年年度、2007年年度、2008年年度、2009年年度、2010年上半年基金业绩。。

7.在“二十七、其他应披露事项”部分：列表说明自2010年2月28日至2010年8月29日本基金的相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2010年10月22日

嘉实基金管理有限公司关于旗下开放式基金通过长江证券开办定投业务的公告

为满足广大投资者的理财需求，嘉实基金管理有限公司决定从2010年10月22日起通过长江证券股份有限公司(以下简称“长江证券”)开办嘉实旗下开放式基金定期定额投资业务。

“定期定额投资业务”是基金申购业务的一种方式，投资者可以通过长江证券提交申请，约定每期扣款时间、扣款金额及扣款方式，由长江证券于约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款及基金申购业务，投资者在办理相关基金“定期定额投资业务”的同时，仍然可以进行日常申购、赎回业务。

一、适用基金

嘉实成长收益证券投资基金、嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金、嘉实债券证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、嘉实货币市场基金、嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)、嘉实超短债证券投资基金、嘉实主题精选混合型证券投资基金、嘉实策略增长混合型证券投资基金、嘉实优质企业股票型证券投资基金、嘉实海外中国股票股票型证券投资基金、嘉实研究精选股票型证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金、嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金、嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金、嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)、嘉实价值优势股票型证券投资基金，合计18只开放式证券投资基金。

嘉实增长混合、嘉实主题混合、嘉实超短债债券3只基金的申购及定投限制，请参见本公告“十一、特别提示”，其中嘉实主题混合每月开放1日申购业务。

二、适用投资者

“定期定额投资业务”适用于依据国家有关法律法规和基金合同约定的可以投资证券投资基金的投资者。

三、办理场所

自2010年10月22日起，投资者可到长江证券的业务网点办理“定期定额投资业务”申请。

四、申请方式

1、凡申请办理上述基金(嘉实沪深300指数(LOF)和嘉实基本面50指数(LOF)除外)“定期定额投资业务”的投资者，须先开立嘉实基金管理有限公司开放式基金账户(已开户者除外)；申请办理嘉实沪深300指数(LOF)和嘉实基本面50指数(LOF)“定期定额投资业务”的投资者，须先开立中登公司的深圳开放式基金账户(已开户者除外)。

2、已开立上述基金账户的投资者，应携带本人有效身份证件及相关业务凭证，到长江证券的销售网点申请办理此项业务。

五、办理时间

“定期定额投资业务”申请办理时间为开放式基金法定开放日9:30-15:00。

六、扣款日期

投资者应与长江证券约定每月固定扣款日期，该扣款日期视为基金合同中约定的申购申请日(T日)。

七、扣款金额

投资者应与长江证券就相应基金申请开办“定期定额投资业务”约定每月固定扣款(申购)金额，每只基金每月扣款金额为人民币300元起(含300元)。

其中，嘉实增长混合、嘉实主题混合、嘉实超短债债券3只基金的定投限制，请参见本公告“十一、特别提示”。

八、扣款方式

1、按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日、扣款金额进行扣款。若遇非基金申购开放日，则顺延至下一基金申购开放日；

2、投资者须指定一个有效资金账户作为每月固定扣款账户。

九、交易确认

以每月实际扣款日(T日)的基金份额净值为基准计算申购份额。基金份额确认日为T+1日(嘉实海外中国股票(QDII)T+3日内)，投资者可在T+2日(嘉实海外中国股票(QDII)为T+3日)到长江证券的销售网点查询相应基金的申购确认情况。

十、“定期定额投资业务”的变更和终止

1、投资者变更每月扣款金额、扣款日期、扣款帐户等信息，须携带本人有效身份证件及相关凭证，到长江证券的销售网点申请办理业务变更手续；

2、投资者终止“定期定额投资业务”，须携带本人有效身份证件及相关凭证，到长江证券的销售网点申请办理业务终止手续；

3、具体办理程序应遵循长江证券的有关规定。

十一、特别提示

1、自2010年6月23日起，嘉实增长混合单日每个基金账户的累计申购(含转入及定期定投)金额不得超过10万元。请参见嘉实基金网站刊载的《关于嘉实增长混合实施限额申购(含转入及定投)业务的公告》及其相关临时公告)。

2、自2010年5月26日起，嘉实主题混合暂停申购及转入业务，之后每月开放1日(开放日)办理申购业务(不含转入)；自2010年7月13日起，嘉实主题混合单日单个基金账户单笔定期定额计划的申购金额不得超过5万元定投上限。请参见嘉实基金网站刊载的《嘉实主题混合实施暂停转入业务及限制申购业务的定期更新公告(2010年10月)》及其相关临时公告。

3、自2010年8月11日起，嘉实超短债债券单日每个基金账户的累计申购金额及定期定额投资金额不得超过50万元。请参见嘉实基金网站刊载的《关于嘉实超短债实施限额申购(含转入及定投)业务的公告》及其相关临时公告。

十二、业务咨询

1、长江证券客户服务电话：95579或4008888999，网址：www.95579.com；

2、嘉实基金管理有限公司客户服务电话：400-600-8800，网址：www.jsfund.cn。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2010年10月22日