嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

更新招募说明书摘要

（2009 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）本招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截止日为 2009 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 2009 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，硕士研究生。1990 年毕业于清华大学经济管理学院。1990 年至今，担任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994 年至今，担任北京德恒有限责任公司总经理；2001 年 11 月至今，担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。

Lindsay Megan Wright 女士，董事，大学本科（学士），新西兰国籍。曾任德意志银行（新西兰）/ 新西兰信托银行 CFO&COO、董事总经理，德意志银行 DB 资本合伙公司亚太区 COO、董事总经理，德意志资产管理公司亚太区 COO、董事总经理，德意志资产管理公司 COO、业务及产品主管（PE）、董事总经理。现任德意志资产管理公司亚太及中东区业务发展主管、董事总经理。

骆小元女士，独立董事，大学本科。1982 年毕业于中国人民大学财会专业。1995 年至 2000 年，担任中国注册会计师协会总会计师；2000 年至今，就职于中国注册会计师协会协会注册中心，担任中心主任。

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 11 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，公司总经理助理邵健先生、总经理助理兼海外投资部总监李凯先生、总经理助理兼定量投资部总监陶荣辉先生、股票投资部总监刘天君先生、机构投资部总监林青先生、资深基金经理党开宇女士、投资流程与风险管理部总监毕万英先生、固定收益部总监刘熹先生。

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：宁敏
电话：（010）66594977
传真：（010）66594942

中国银行总行于 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，下设覆盖销售、市场、运营、风险与合规管理、信息技术、行政管理等各层面的多个团队，现有员工 110 余人；另外，在上海市分行、深圳市分行设有托管业务团队。

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	唐伟宏		

（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	钟俊杰		

（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		

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	王佺
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	蒋浩
电话	（010）85109219	传真	（010）85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

（5）交通银行

住所、办公地址	上海市银城中路 188 号		
法定代表人	蒋超良		
电话	（021）58781234	联系人	曹榕
网址	www.bankcomm.com	传真	（021）58408842

（6）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	万丽
电话	（0755）83198888	传真	（0755）83195049
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

（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	吴海鹏、董云巍
电话	（010）58351666	传真	（010）83914283
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

（8）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

（9）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	潘玲
电话	（021）52629999	传真	（021）62569070
网址	www.cib.com.cn	客服电话	95561

（10）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	法兰克纽曼(Frank N. Newman)		
联系人	石蔚明		
电话	（0755）82088888	传真	（0755）82080406
网址	www.sdb.com.cn	客服电话	95501

（11）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	www.pingan.com	客服电话	4006699999

（12）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	金蕾
电话	（010）65557013	传真	（010）65550827
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

（13）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

（14）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		

（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	詹全鑫、张扬眉
电话	（020）38322542	传真	（020）87310955
网址	www.gdb.com.cn	客服电话	（020）38322222

（16）杭州银行

住所、办公地址	杭州市凤起路 432 号		
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

（17）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

（18）海通证券股份有限公司

住所	上海市淮海中路 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或拨打营业点电话

（19）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)38676161	传真	(021)38670161
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

（20）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	胡长生	联系人	李洋
电话	（010）66568047	传真	（010）66568116
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-888-8888

（21）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）38565783
网址	www.xyzq.com.cn	客服电话	4008888123

（22）华泰联合证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 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	4008888555

（23）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

（24）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

（25）东吴证券有限责任公司

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路 181 号商旅大厦 18-21 层		
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

（26）国信证券股份有限公司

住所、办公地址	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 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

（27）广发证券股份有限公司

住所	广东省广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼		
办公地址	广州市天河北路 183 号大都会广场 18、19、36、38、41、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

（28）国都证券有限责任公司

住所	深圳市福田中心区金田路 4028 号荣超经贸中心 26 层 11、12		
办公地址	北京市东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)64482090
网址	www.guodu.com	客服电话	4008188118

（29）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

（30）中信证券股份有限公司

住所	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层		
办公地址	北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦 3 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

（31）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.cc168.com.cn	客服电话	4006666888

（32）平安证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区八卦岭八卦三路平安大厦三楼		
法定代表人	陈敬达	联系人	袁月
电话	（0755）82450826	传真	（0755）82433794
网址	www.pa18.com	客服电话	95511

（33）民生证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市朝阳门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室		
法定代表人	岳献春	联系人	赵明
电话	（010）85252656	传真	（010）85252655
网址	www.mszq.com	客服电话	400-619-8888

（34）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
电话	（021）22169999	传真	（021）22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	10108998、4008888788

（35）东方证券股份有限公司

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

（36）渤海证券股份有限公司

住所	天津市经济技术开发区第一大街 29 号		
办公地址	天津市河西区宾水道 3 号		
法定代表人	张志军	联系人	徐焕强
电话	（022）28451883	传真	（022）28451892
网址	www.ewww.com.cn	客服电话	4006515988

（37）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	祝丽萍
电话	（0551）2207938	传真	（0551）2207965
网址	www.gyzq.com.cn	客服电话	400-8888-777、95578

（38）安信证券股份有限公司

住所、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		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	（0755）82558305	传真	（0755）82558355
网址	www.essences.com.cn	客服电话	4008001001

（39）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	（021）63219781	传真	（021）51062920
客服电话	400-8888-999或（027）85808318		
网址	www.95579.com		

（40）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）87902081
网址	www.stocke.com	客服电话	（0571）96777

（41）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	史洁民	联系人	丁韶燕
电话	（0532）85022026	传真	（0532）85022026
网址	www.zxwt.com.cn	客服电话	（0532）96577

（42）山西证券股份有限公司

住所、办公地址	山西省太原市府西街 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

（43）财富证券有限责任公司

住所、办公地址	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

（44）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）

（45）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）85680032
网址	www.nesc.cn		
客服电话	4006000686（0431）85096733		

（46）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	徐翔
电话	（025）83367888-4201	传真	（025）83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

（47）江南证券有限责任公司

住所、办公地址	江西省南昌市抚河北路 291 号六楼		
法定代表人	姚江涛	联系人	余雅娜
电话	（0791）6768763	传真	（0791）6789414
网址	www.scstock.com	客服电话	（0791）6781119

（48）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	4008888182

（49）东海证券有限责任公司

住所	江苏省常州市延陵西路 59 号常信大厦 18、19 楼		
办公地址	上海市浦东新区东方路 989 号中达广场 17 楼		
法定代表人	朱科敏	联系人	邵一明
电话	（021）50586660-8631	传真	（021）50586660-8880
网址	www.longone.com.cn	客服电话	400-888-8588

（50）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

（51）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	武斌
电话	（0755）83025430	传真	（0755）83025991
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

（52）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	刘军辉
电话	（0755）83199511	传真	（0755）83199545
网址	www.csco.com.cn	客服电话	（0755）83199511

（53）湘财证券有限责任公司

住所	湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼		
办公地址	上海市陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 楼		
法定代表人	陈学荣	联系人	李梦诗
电话	（021）68634510-8631	传真	（021）68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

（54）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.com.cn	客服电话	400-8888-228

（55）西部证券股份有限公司

住所、办公地址	西安市东新街 232 号陕西信托大厦 16、17 层		
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.cn	客服电话	（029）96708

（56）国联证券股份有限公司

住所	江苏省无锡市县前东街 168 号		
办公地址	江苏省无锡市县前东街 8 号国联大厦 6－8 楼		
法定代表人	雷建辉	联系人	袁丽萍
电话	（0510）82588168	传真	（0510）82830162
客服电话	4008885288	网址	www.glsc.com.cn

（57）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		

（58）中信金通证券有限责任公司

住所、办公地址	浙江杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼		
法定代表人	刘军	联系人	俞会亮
电话	（0571）85783715	传真	（0571）85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	（0571）96598

（59）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	江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼		
法定代表人	管荣升	联系人	徐美云
电话	（0791）6285337	传真	（0791）6289390
网址	www.gsstock.com	客服电话	（0791）6285337、6283827

（60）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 5 楼		
法定代表人	吴志明	联系人	樊刚正
电话	（020）87322668	传真	（020）87325036
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	（020）961303

（61）中原证券股份有限公司

住所、办公地址	郑州市经三路 15 号广汇国贸 11 楼		
法定代表人	石保上	联系人	耿铭、程月艳
电话	（0371）65585670	传真	（0371）65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	967218、4008139666

（62）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）4890619	传真	（0931）4890118
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	（0931）4890619

（63）新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 15 层		
法定代表人	马金声	联系人	朱雪雁
电话	（010）68083575	传真	（010）68084986
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

（64）上海证券有限责任公司

住所	上海市西藏中路 336 号		
办公地址	上海市临平北路 19 号		
法定代表人	蒋元真	联系人	谢秀峰
电话	（021）65076608－557	传真	（021）65217206
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518

（65）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

（66）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	李舫金	联系人	罗创斌
电话	（020）37865070	传真	（020）37865008
网址	www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

（67）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	辛国荣
电话	（0351）4167056	传真	（0351）4192803
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	（0351）4167056

（68）齐鲁证券有限公司

住所、办公地址	山东省济南市经十路 128 号		
法定代表人	李玮	联系人	傅咏梅
电话	（0531）81283938	传真	（0531）81283900
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

（69）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		
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）

（70）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.firstcapital.com.cn	客服电话	（0755）25832583

（71）中国建银投资证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳福田益田路福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层		
法定代表人	杨小阳	联系人	刘权
电话	（0755）82026521	传真	（0755）82026539
网址	www.cjis.cn	客服电话	400-600-8008

（72）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）59226788	传真	（010）59226840
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

（73）华鑫证券有限责任公司

住所	深圳罗湖区深南东路 5045 号深业中心大厦 25 层 2512、2513		
办公地址	上海市肇嘉浜路 750 号		
法定代表人	王文学	联系人	杨小江
电话	（021）64339000	传真	（021）64376097
客服电话	（021）32109999，（029）68918888		
网址	www.cfsc.com.cn		

（74）中山证券有限责任公司

住所、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	吴泳良	联系人	刘军
电话	（0755）82944659	传真	（0755）82960582
网址	www.zszq.com.cn	客服电话	（0755）82943750

（75）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	莫晓丽
电话	（010）66045529	传真	（010）66045500
客服电话	（010）66045678		
网址	www.txsec.com 、www.txjijin.com		

（76）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	北京市西城区太平桥大街 19 号宏源证券		
法定代表人	汤世生	联系人	李巍
电话	（010）88085338	传真	（010）88085240
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

（77）中国民族证券有限责任公司

住所	北京市丰台区北路 81 号		
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、张伟智
电话	（010）59355941	传真	（010）66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

（78）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）5161640
客服电话	（0592）5163588	网址	www.xmzq.cn

（79）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

（80）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 23 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

（81）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	张建华	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

（82）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）85832342
客服电话	95571	网址	www.foundersc.com

（83）西南证券有限责任公司

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	秦治国
电话	（023）63721712	传真	（023）63786215
客服电话	4008096096	网址	www.swsc.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：

国泰君安证券、国信证券、招商证券、中信证券、海通证券、联合证券、申银万国证券、长江证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、长城证券、光大证券、南京证券、上海证券、东莞证券、中原证券、东海证券、中银国际证券、广发证券、银河证券、中信建投证券（原华夏证券）、北京证券、湘财证券、西部证券、大同证券、德邦证券、万联证券、国海证券、国都证券、华林证券、中金公司、广发华福证券、金元证券、信泰证券、国联证券、恒泰证券、国盛证券、金信证券、江南证券、天和证券、兴业证券、平安证券、华西证券、西南证券、山西证券、齐鲁证券、世纪证券、广州证券、华安证券、国元证券、东方证券、东北证券、新时代证券、第一创业证券、民生证券、财富证券、天一证券、宏源证券、泰阳证券、金通证券、华龙证券。

（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	陈耀先	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	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 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	许康伟、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 2009 年 7 月 16 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 2009 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	29,800,622,977.86	93.96
	其中：股票	29,800,622,977.86	93.96
2	固定收益投资	680,490,000.00	2.15
	其中：债券	680,490,000.00	2.15
	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	1,034,049,176.07	3.26
6	其他资产	202,149,611.59	0.64
合计		31,717,311,765.52	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	123,736,521.97	0.39
B	采掘业	3,334,475,694.29	10.62
C	制造业	7,934,953,692.20	25.27
C0	食品、饮料	1,004,401,996.76	3.20
C1	纺织、服装、皮毛	170,780,230.35	0.54
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	107,542,407.38	0.34
C4	石油、化学、塑胶、塑料	714,096,868.34	2.27
C5	电子	141,817,879.52	0.45
C6	金属、非金属	2,642,147,387.43	8.42
C7	机械、设备、仪表	2,314,214,617.35	7.37
C8	医药、生物制品	678,681,620.23	2.16
C99	其他制造业	161,270,684.84	0.51
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,016,846,450.96	3.24
E	建筑业	694,282,737.13	2.21
F	交通运输、仓储业	1,530,742,210.09	4.88
G	信息技术业	852,684,461.59	2.72
H	批发和零售贸易	898,359,360.58	2.86
I	金融、保险业	10,024,100,019.20	31.93
J	房地产业	2,162,304,176.55	6.89
K	社会服务业	514,308,609.03	1.64
L	传播与文化产业	74,601,957.66	0.24
M	综合类	639,227,086.61	2.04
	合计	29,800,622,977.86	94.92

3. 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	51,059,540	1,144,244,291.40	3.64
2	601328	交通银行	109,917,054	990,352,656.54	3.15
3	600016	民生银行	113,986,982	902,776,897.44	2.88
4	601318	中国平安	17,391,124	860,164,993.04	2.74
5	600030	中信证券	28,106,542	794,290,876.92	2.53
6	601166	兴业银行	21,190,576	786,382,275.36	2.50
7	600000	浦发银行	33,597,900	773,423,658.00	2.46
8	000002	万 科 A	58,620,918	747,416,704.50	2.38
9	601398	工商银行	121,296,843	657,428,889.06	2.09
10	601088	中国神华	19,972,932	597,390,396.12	1.90

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	580,630,000.00	1.85
3	金融债券	99,860,000.00	0.32
	其中：政策性金融债	99,860,000.00	0.32
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	680,490,000.00	2.17

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	0801106	08央行票据 106	4,000,000	386,880,000.00	1.23
2	090404	09农发 04	1,000,000	99,860,000.00	0.32
3	0801110	08央行票据 110	1,000,000	96,960,000.00	0.31
4	0801108	08央行票据 108	1,000,000	96,790,000.00	0.31

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	1,583,931.06
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	5,900,921.63
4	应收利息	18,338,765.32
5	应收申购款	176,325,993.58
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
合计		202,149,611.59

（下转 B5 版）