嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2009 年第 1 号）

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

嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2008 年 12 月 18 日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2008]1424 号）核准进行募集。本基金基金合同于 2009 年 3 月 20 日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

重要提示

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，并经中国证监会核准。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。

本摘要已经基金托管人复核。本摘要所载内容截止日为 2009 年 9 月 20 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 9 月 30 日(未经审计)。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1.基本情况

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	刘红辉

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，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京，公司在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州设有分公司。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。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

（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，中煤信托投资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、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。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。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，历任督察员和公司副总经理。

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，曾任公司总经理助理。

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

（1）现任基金经理

王永宏，高级定量分析师，经济学博士，11 年证券从业经历。1998–1999 年曾任海通证券业务经理，1999 年曾任大成基金管理有限公司研究员。2001 年 12 月进入嘉实基金管理有限公司工作，历任产品总监，首席金融工程师。2009 年 3 月 20 日至今任本基金基金经理。

陶羽，高级定量分析师，硕士，5 年证券从业经历。2004–2005 年曾任美国高盛公司定量分析师，2005–2008 年曾任美国德意志资产管理公司高级定量分析师、基金经理。2009 年 3 月 20 日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理：无。

3.投资决策委员会

投资决策委员会的成员包括：公司总经理赵学军先生、副总经理戴京焦女士、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

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

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：姜建清
注册资本：人民币 334,018,850,026 元
联系电话：（010）66105799
联系人：蒋松云
发展概况：

截至 2009 年 9 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 123 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。。

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至 2009 年 9 月，托管证券投资基金 127 只，其中封闭式 8 只，开放式 119 只。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII 资产、QDII 资产等产品在内的托管业务体系。2009 年初，中国工商银行先后被《环球金融》、《全球托管人》、《财资》和国内证券类年鉴《中国证券投资基金年鉴》及《证券时报》评选为 2008 年度“中国最佳托管银行”，自 2004 年以来，中国工商银行资产托管服务已经获得 18 项国内外大奖。

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

（2）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

（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	胡怀邦	联系人	曹榕
电话	（021）58781234	传真	（021）58408842
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

（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）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		

（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）青岛银行

住所、办公地址	青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦		
法定代表人	张广鸿	联系人	徐楠
电话	（0532）85709793	传真	（0532）85709839
客服电话	96588（青岛）、4006696588（全国）、（0532）85709799		
网址	www.qdccb.com		

（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）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

（15）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	96228		
网址	www.dongguanbank.cn		

（16）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）68560661
客服电话	95595		
网址	www.cebbank.com		

（17）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

（18）徽商银行

住所、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	王晓昕	联系人	王祎
电话	（0551）2667819	传真	（0551）2667857
客服电话	4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)		
网址	www.hsbank.com.cn		

（19）南京银行

住所、办公地址	南京市白下区淮海路 50 号		
法定代表人	林复	联系人	贺坚
电话	（025）84544135	传真	（010）84544129
客服电话	4008896400	网址	www.njcb.com.cn

（20）临商银行

住所、办公地址	山东省临沂市沂蒙路 336 号		
法定代表人	王傢玉	联系人	寇廷柱
电话	(0539)8304657	传真	(0539)8304657
客服电话	400-699-6588	网址	www.lsbchina.com

（21）温州银行

住所、办公地址	温州市车站大道华海广场 1 号楼		
法定代表人	夏瑞洲	联系人	林波
电话	（0577）88995217	传真	（0577）88995217
客服电话	（0577）96699	网址	www.wzbank.cn

（22）上海农村商业银行

住所	上海市浦东新区浦东大道 981 号		
办公地址	上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层		
法定代表人	李秀仑	联系人	吴海平
电话	（021）38576977	传真	（021）50105124
客服电话	（021）962999	网址	www.srcb.com

（23）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

（24）上海银行

住所、办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号		
法定代表人	宁黎明	联系人	张萍
电话	（021）68475888	传真	（021）68476111
网址	www.bankofshanghai.com	客服电话	（021）962888

（25）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

（26）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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）华泰联合证券有限责任公司（原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

（31）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

（32）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

（33）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

（34）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

（35）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

（36）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

（37）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

（38）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

（39）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

（40）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

（41）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

（42）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	4008888788、10108998

（43）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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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		

（48）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

（49）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

（50）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

（51）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

（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（全国），96100（广西）

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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

（57）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

（58）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	赵珩
电话	（028）86150035	传真	（028）86155733
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

（59）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

（60）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

（61）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

（62）西部证券股份有限公司

住所、办公地址	西安市东新街 232 号信托大厦 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

（63）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

（64）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		

（65）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

（66）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

（67）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

（68）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	刘汝军	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

（69）国金证券股份有限公司

住所、办公地址	成都市东城根上街 95 号		
法定代表人	雷波	联系人	王丹
电话	（028）86690125	传真	（028）86690126
网址	www.gjzq.com.cn	客服电话	（028）95105111

（70）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

（71）信泰证券有限责任公司

住所、办公地址	南京市长江路 88 号		
法定代表人	钱凯法	联系人	舒萌菲
电话	（025）84784782	传真	（025）84784741
网址	www.thope.com	客服电话	400-8888-918

（72）中原证券股份有限公司

住所	郑州市经三路 15 号广汇国际贸易大厦		
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

（73）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
客服电话	（0931）4890619		
网址	www.hlzqgs.com		

（74）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

（75）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

（76）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

（77）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

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

（79）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

（80）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）

（81）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

（82）中国建银投资证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳福田区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

（83）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	谢雅凡、田文健
电话	（010）59226788	传真	（010）59226840
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

（84）华鑫证券有限责任公司

住所	深圳罗湖区深南路 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		

（85）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

（86）中国国际金融有限公司

住所	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
办公地址	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层		
法定代表人	李剑阁	联系人	王雪筠
电话	（010）65051166	传真	（010）85679535
网址	www.cicc.com.cn		
客服电话	（010）85679238；（010）85679169		

（87）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		

（88）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、59355946	传真	（010）66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

（89）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

（90）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

（91）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

（92）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

（93）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

（94）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	李欣
电话	（0755）83007179	传真	（0755）26998301
客服电话	（0755）26982993	网址	www.vsun.com

（95）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

（96）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	张利军 陈韦杉
电话	(010)88086830	传真	(010)88086637
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	北京：（010）82200210/82200220 呼和浩特：（0471）6292456 /6292494 通辽:(0475)8263840/ 8265217 乌兰浩特:(0482)8223737/ 8223131		

（二）注册登记机构

嘉实基金管理有限公司（同上）

（三）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）65890661	传真	（010）65176801
经办律师	黄伟民		

（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：嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金

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

追求长期持续稳定高于业绩比较基准的投资回报。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括：股票资产（A 股以及监管机构允许投资的其他市场的股票资产等）、衍生工具（权证等）、债券资产（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、央行票据、短期融资券等）、债券回购、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货等金融衍生产品或其它品种，可以根据有关规定且和基金托管人进行协商后将其纳入投资范围，并报证监会备案。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 60 ~ 95%；现金、债券资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5–40%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。

若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定，适用新的规定。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1.资产配置

本基金将从宏观面、政策面、资金面和基本面等四个角度进行综合分析，根据市场情况灵活配置大类资产，在具备足够多预期收益率良好的投资标的时，将优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券类和现金类等大类资产上。

2.股票投资策略

本基金以 “定量投资” 为主 （Quantitative Investment Approach），辅以 “定性投资”（Traditional Investment Approach），力争实现稳定超额回报。

定量投资方面，本基金将依托内部自主研发的定量投资模型以及强大的数据库系统，构建投资组合。其中，核心模型包括嘉实行业选择模型、嘉实 Alpha 多因素模型以及嘉实组合优化器。数量小组将根据市场变化趋势，定期或不定期地对模型进行复核，并做相应调整，以不断改善模型的适用性。

（1）嘉实行业选择模型

嘉实行业选择模型，通过定量分析行业赢利能力、分析师的盈利预期、市场认同度等因素，捕捉具有投资吸引力的行业。

根据各行业的投资吸引力，决定各行业相对于业绩比较基准中股票指数的相对偏离度。提高投资吸引力高的行业配置，降低投资吸引力低的行业配置。

（2）嘉实 Alpha 多因素模型

通过嘉实行业选择模型筛选的行业进入个股筛选程序。本基金在个股选择层面，采用 “嘉实 Alpha 多因素模型”。

嘉实基金根据对中国证券市场运行特征的长期研究，选取估值因子 （Valuation）、成长因子（Growth）、盈利趋势（Operating）、分析师情绪（Sentiment）、市场因素（Market）五大类对 A 股股价波动具有较强解释度的指标，建立“嘉实 Alpha 多因素模型”，并使该模型成为股票选择的重要依据。

定性投资主要利用基本面研究成果，对模型自动选股的结果进行复核，剔除掉满足某些特殊条件的股票，即在嘉实 Alpha 多因素模型筛选出的股票名单中，根据分析师定性研究成果，剔除掉限制买入类股票，从而进行定性优选。

需要考虑的定性因素包括：

A）上市公司治理结构存在问题；

B）存在对股价有负面影响的潜在事件；

C）存在压制股价的其它非基本面因素。

本基金通过量化技术，对上述定量模型和定性因素筛选的结果进行优化，以确定个股权重，实现风险收益的最佳匹配。定量投资方法以科学性和系统性著称，将在严格的纪律化模型制约下，精准跟踪策略，使运作风险最小化，并力争取得较高收益。在现阶段，本基金使用“稳健优化”的方法，在所有可能的期望回报的最坏条件下，计算最优组合。与其他优化方法相比，使用“稳健优化”方法获得的最优组合，更加稳定，更加分散化，交易成本和换手率更低。

3.债券投资策略

本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。

债券投资采取“自上而下”的策略，深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，采取以久期管理策略为主，辅以收益率曲线策略、收益率利差策略等，确定和构造能够提供稳定收益、较高流动性的债券和货币市场工具组合。

4.权证投资策略

本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，结合期权定价模型和我国证券市场的交易制度估计权证价值，主要考虑运用的策略包括：杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空有保护的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。

（二）投资决策

1、决策依据

(1)法律法规和基金合同。本基金的投资将严格遵守国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。

(2)宏观经济和上市公司的基本面数据。

(3)投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系。本基金将在承受适度风险的范围内，选择预期收益大于预期风险的品种进行投资。

2、决策程序

(1)公司研究部通过内部独立研究，并借鉴其他研究机构的研究成果，形成宏观、政策、投资策略、行业和上市公司等分析报告，为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。

(2)投资决策委员会定期和不定期召开会议，根据基金投资目标和对市场的判断决定基金的总体投资策略，审核并批准基金经理提出的资产配置方案或重大投资决定。

(3)在既定的投资目标与原则下，根据定量投资模型以及分析师基本面研究成果，由基金经理选择符合投资策略的品种进行投资。

(4)独立的交易执行：基金管理人设置独立的中央交易室，通过严格的交易制度和实时的一线监控功能，保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效地执行。

(5)动态的组合管理：基金经理将跟踪证券市场和上市公司的发展变化，结合基金申购和赎回导致的现金流量情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态的调整，使之不断得到优化。

(6)投资流程与风险管理部根据市场变化对基金投资组合进行风险评估与监控，并授权风险控制小组进行日常跟踪，出具风险分析报告。监察稽核部对基金投资过程进行日常监督。

(7) 基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序作出调整。

九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数 × 75% + 上证国债指数 × 25%

十、基金的风险收益特征

较高风险，较高收益。

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。

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 2009 年 10 月 27 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 9 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	2,047,435,029.28	83.64
	其中：股票	2,047,435,029.28	83.64
2	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	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	370,863,769.42	15.15
6	其他资产	29,554,898.12	1.21
合计		2,447,853,696.82	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	3,824,909.60	0.16
B	采掘业	176,989,937.36	7.37
C	制造业	680,403,172.14	28.34
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	22,309,060.20	0.93
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	84,832,348.63	3.53
C5	电子	6,426,099.18	0.27
C6	金属、非金属	255,273,779.78	10.63
C7	机械、设备、仪表	215,407,058.30	8.97
C8	医药、生物制品	95,730,026.05	3.99
C99	其他制造业	424,800.00	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,024,606.27	0.21
E	建筑业	55,316,208.96	2.30
F	交通运输、仓储业	29,068,935.70	1.21
G	信息技术业	86,274,990.20	3.59
H	批发和零售贸易	57,388,352.09	2.39
I	金融、保险业	538,950,472.90	22.45
J	房地产业	291,641,531.28	12.15
K	社会服务业	22,422,962.21	0.93
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	100,128,950.57	4.17
	合计	2,047,435,029.28	85.29

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	601318	中国平安	2,007,300	101,770,110.00	4.24
2	600000	浦发银行	4,638,714	91,150,730.10	3.80
3	600016	民生银行	12,716,038	85,706,096.12	3.57
4	000623	吉林敖东	1,999,951	79,698,047.35	3.32
5	000878	云南铜业	2,599,576	65,769,272.80	2.74
6	600348	国阳新能	1,789,850	63,754,457.00	2.66
7	601601	中国太保	2,400,000	53,448,000.00	2.23
8	601628	中国人寿	1,800,000	49,824,000.00	2.08
9	600325	华发股份	2,731,856	46,824,011.84	1.95
10	600052	浙江广厦	6,000,000	44,340,000.00	1.85

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有债券。

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	4,048,690.25
2	应收证券清算款	21,331,195.32
3	应收股利	644,092.45
4	应收利息	51,339.30
5	应收申购款	3,479,580.80
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
合计		29,554,898.12

（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

报告期末本基金持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

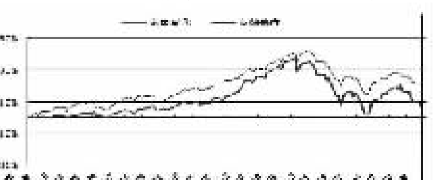
基金业绩截止日为 2009 年 9 月 30 日。

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。

1.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	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
2009年 3 月 20 日起至 2009 年 9 月 30 日	7.00%	1.92%	19.82%	1.53%	–12.82%	0.39%

2.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



图：嘉实量化阿尔法股票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
（2009 年 3 月 20 日至 2009 年 9 月 30 日）

注：本基金基金合同生效日 2009 年 3 月 20 日至 2009 年 9 月 30 日未满 1 年。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十一部分（二、投资范围和五、（二）投资组合限制）的有关约定。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费；

（2）基金托管人的托管费；

（3）《基金合同》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和律师费；

（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）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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

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 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% \div$ 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 2.5‰的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 2.5‰ \div$ 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。

上述一、基金费用的种类中第(3)–(7)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。

3、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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

（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。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率或基金托管费率等相关费率。调高基金管理费率、基金托管费率等至本基金合同第十四部分第二款规定的费率水平以上时，须召开基金份额持有人大会审议；在第（一）条规定的费率水平以内，调整基金管理费率、基金托管费率等费率，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 2 个工作日在至少一家指定媒体公告并报中国证监会备案。

（二）与基金销售有关的费用

（1）申购费

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。本基金申购费率最高不超过申购金额的 5%，具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M < 100 万元	1.5%
100万元≤M < 200 万元	1.2%
200万元≤M < 500 万元	0.8%
M≥500 万元	单笔 1000 元

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、注册登记等各项费用，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、电话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%。但招商银行借记卡与中国建设银行龙卡、中国农业银行金穗卡、中国工商银行借记卡的持卡人申购本基金的申购费率均按申购金额分档，分别优惠为招募说明书及相关公告规定的申购费率的 80%（招行借记卡与建行龙卡持卡人）、70%（金穗卡持卡人） 及 50%（工行借记卡持卡人自 2009 年 10 月 12 日起至 2009 年 12 月 15 日 15:00 止），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%。

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。

（2）赎回费

本基金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。 本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，随持有期限的增加而递减。具体如下：

持有期限	赎回费率
< 365 天	0.50%
365天≤M < 730 天	0.25%
≥730 天	0

本基金的赎回费用由基金份额持有人承担，其中 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。

（3）转换费

基金转换费由基金份额持有人承担，用于支付有关手续费和注册登记费。本基金转换费率按照如下方式收取：

①嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金 B 转换为嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金时，转换费率均为转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

净转入金额 =（转出份额 × 转出当日转出基金的基金份额净值）/（1+ 转换费率）+ M

转换费用 =（转出份额 × 转出当日转出基金的基金份额净值）× 转换费率 /（1+ 转换费率）

转入份额 = 净转入金额 / 转入当日转入基金的基金份额净值

其中 M 为嘉实货币市场基金全部转出时账户当前累计未付收益

②嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金与嘉实旗下其他 11 只开放式基金（包括：嘉实成长收益证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、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 A、嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金）之间互转，以及嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金转入嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金 B 时，均采用“赎回费 + 申购费率补差”算法，计算公式如下：

$净转入金额 = B \times C \times (1-D)/(1+G)$

$转换补差费用 = [B \times C \times (1-D)/(1+G)] \times G$

$转入份额 = 净转入金额 / E$

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。

基金管理人可以在不违背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）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

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列支。

（三）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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，结合本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营情况，对本基金原招募说明书进行了更新。主要更新内容如下：

1. 在“重要提示”部分：明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

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：更新了基金托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分：增加深圳发展银行、上海浦东发展银行、中国农业银行、南京银行、光大银行、中国民生银行、东莞银行、临商银行、徽商银行、温州银行、杭州银行、上海银行、上海农商银行、万联证券、国金证券、天相投资顾问有限公司、宏源证券、中国民族证券、厦门证券、江海证券、爱建证券、华宝证券、方正证券、英大证券、西南证券 25 家代销机构，并更新相关代销机构信息。

5.在“十一、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“十二、基金的业绩”部分：说明了自 2009 年 3 月 20 日本基金合同生效以来至 2009 年 9 月 30 日的基金业绩。

7.在“二十五、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2009 年 2 月 11 日首次刊登招募说明书至 2009 年 9 月 20 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2009 年 11 月 26 日