嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长基金、嘉实稳健基金及嘉实债券基金更新招募说明书摘要

(上接 B11 版)

(vi) 银行间市场询价达到三家以上;
(vii) 在其他条件相同时,优先选择双边报价商报价债券列表中的债券;
(viii) 优先选择央行公开市场操作的品种。

（二）投资管理程序

1、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小组提供决策依据。

2、在投资决策委员会的指导下,基金经理小组和资产配置委员会综合对国内外宏观经济、货币环境、证券市场发展趋势等要素的分析判断,按照基金的合同规定,提出下一阶段本系列基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例,并制订基金在其他重要股票资产类别上的具体配置计划。

3、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本系列基金的总体投资策略，审核并批准基金经理小组提出的资产配置方案或重大投资决定。

4、基金经理小组根据投资决策委员会所做的决议,参考研究部和其他研究机构的研究报告,选择具体的投资目标,构建投资组合。

5、基金经理小组将投资指令下达给集中交易室,交易主管在复核投资指令合法合规的基础上,将指令分发给交易员执行。保证决策和执行权利的分离。

6、风险控制委员会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、基金经理小组将跟踪证券市场和上市公司的发展变化,结合基金申购、赎回和转换导致的现金流量变化情况，以及组合风险和流动性的评估结果，对投资组合进行动态调整。

8、在确保基金份额持有人利益的前提下,基金管理人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

嘉实增长基金:巨潮 500（小盘）指数
嘉实稳健基金:巨潮 200（大盘）指数
嘉实债券基金:中央国债登记结算公司的中国债券指数

十、基金的风险收益特征

1.嘉实增长基金:本基金属于中高风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的 β 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

2.嘉实稳健基金:本基金属于中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为:基金份额净值相对于基金业绩基准的 β 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

3.嘉实债券基金:本基金属于低风险证券投资基金,其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金,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。

本系列基金托管人中国银行股份有限公司根据本系列基金合同规定,于 2006 年 7 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 2006 年 6 月 30 日（“报告期末”),本报告所列财务数据未经审计。

（一）嘉实增长基金

1.报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	1,543,575,823.27	73.76%
债券	442,082,534.59	21.12%
银行存款及清算备付金合计	83,860,894.83	4.01%
权证		
其他资产	23,146,548.84	1.11%
合计	2,092,665,801.53	100.00%

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	26,197,424.77	1.26%
B 采掘业	63,171,756.80	3.03%
C 制造业	586,980,073.28	28.18%
C0 食品、饮料	228,179,373.77	10.96%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	69,560,888.04	3.34%
C5 电子	18,096,966.10	0.87%
C6 金属、非金属	33,730,903.93	1.62%
C7 机械、设备、仪表	122,765,098.14	5.89%
C8 医药、生物制品	114,646,843.30	5.50%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	17,126,935.65	0.82%
E 建筑业	49,535,611.80	2.38%
F 交通运输、仓储业	169,911,753.33	8.16%
G 信息技术业	138,979,926.10	6.67%
H 批发和零售贸易	364,040,279.24	17.48%
I 金融、保险业		
J 房地产业	87,959,627.33	4.22%
K 社会服务业	36,214,909.97	1.74%
L 传播与文化产业	3,457,525.00	0.17%
M 综合类		
合计	1,543,575,823.27	74.11%

3.报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600859	王 府 井	8,503,426	110,119,366.70	5.29%
2	600125	G 铁 龙	14,035,951	105,971,430.05	5.09%
3	600118	G 卫 星	6,391,373	105,457,654.50	5.06%
4	000538	G 云白药	2,513,830	72,775,378.50	3.49%
5	000848	G 露 露	7,324,499	69,363,005.53	3.33%
6	600694	大商股份	1,630,580	67,424,483.00	3.24%
7	600583	G 海 工	2,758,592	63,171,756.80	3.03%
8	600361	G 综 超	3,454,559	62,389,335.54	3.00%
9	600739	G 成 大	4,765,929	56,619,236.52	2.72%
10	000758	G 中 色	5,968,146	49,535,611.80	2.38%

4.报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	337,013,737.00	16.18%
央行票据		
企业债		
金融债券	95,120,749.59	4.57%
可转换债券	9,948,048.00	0.48%
合计	442,082,534.59	21.23%

5.报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	20国债00	117,041,912.40	5.62%
2	02国债04	77,788,309.50	3.73%
3	21国债05	67,414,958.60	3.24%
4	01国开 19	30,003,000.00	1.44%
5	04国开 21	20,384,000.00	0.98%

6.报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细:无

7.报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:无

8.投资组合报告附注

①报告期内本基金投资的前十名股票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和处罚。

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其他资产的构成

项目名称	期末余额(元)
交易保证金	966,872.98
应收利息	6,552,347.75
应收申购款	6,297,613.35
待摊费用	
应收证券清算款	6,068,368.36
其他应收款	3,261,346.40
合计	23,146,548.84

④持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	100236	桂冠转债	5,448,281.50	0.26%
2	100795	国电转债	4,499,766.50	0.22%

（二）嘉实稳健基金

1. 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	533,916,868.05	73.82%
债券	154,838,798.00	21.41%
银行存款及清算备付金合计	25,725,406.33	3.56%
权证		
其他资产	8,744,326.30	1.21%
合计	723,225,398.68	100.00%

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业		
B 采掘业	12,265,425.00	1.71%
C 制造业	304,243,628.38	42.40%
C0 食品、饮料	107,235,336.34	14.95%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷		
C4 石油、化学、塑胶、塑料	8,639,136.00	1.20%
C5 电子		
C6 金属、非金属	60,943,231.09	8.49%
C7 机械、设备、仪表	74,904,705.68	10.44%
C8 医药、生物制品	52,521,219.27	7.32%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	38,434,498.63	5.36%
G 信息技术业		
H 批发和零售贸易	120,864,702.92	16.85%
I 金融、保险业	58,108,613.12	8.10%
J 房地产业		
K 社会服务业		
L 传播与文化产业		
M 综合类		
合计	533,916,868.05	74.42%

3. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600036	G 招 行	6,459,872	49,805,613.12	6.94%
2	000729	G 燕 啤	4,799,447	41,035,271.85	5.72%
3	600739	G 成 大	3,199,912	38,014,954.56	5.30%
4	600361	G 综 超	1,950,000	35,217,000.00	4.91%
5	000423	东阿阿胶	3,146,931	35,151,219.27	4.90%
6	600717	G 天津港	3,799,895	31,919,118.00	4.45%
7	000157	中联重科	1,999,824	27,717,560.64	3.86%
8	600519	G 茅 台	579,605	27,496,461.20	3.83%
9	600585	G 海螺	1,789,275	24,674,102.25	3.44%
10	600150	G 重 机	1,114,812	24,603,900.84	3.43%

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	105,048,918.00	14.64%
金融债	49,789,880.00	6.94%
央行票据		
企业债		
可转换债券		
合计	154,838,798.00	21.58%

5. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	02进出 03	39,789,880.00	5.55%
2	02国债04	39,638,250.00	5.52%
3	银行间 03 国债 7	29,970,000.00	4.18%
4	20国债00	15,041,418.00	2.10%
5	21国债(3)	10,105,000.00	1.41%

6. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细:无

7. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:无

8. 投资组合报告附注

①报告期内本基金投资的前十名股票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和处罚。

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其他资产的构成

项目	期末余额(元)
交易保证金	638,549.12
应收证券清算款	3,243,034.31
应收股利	
应收利息	2,079,506.87
应收申购款	1,103,236.00
其他应收款	1,680,000.00
待摊费用	
买入返售证券	
合计	8,744,326.30

④持有的处于转股期的可转换债券明细:无

（三）嘉实债券基金

1. 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票		
债券	194,166,264.28	91.76%
银行存款及清算备付金合计	14,841,140.18	7.01%
权证		
其他资产	2,607,673.60	1.23%
合计	211,615,078.06	100.00%

2. 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	79,114,463.00	38.00%
央行票据	39,592,313.84	19.01%
企业债券	34,450,500.00	16.55%
金融债券		
可转换债券	41,008,987.44	19.69%
合计	194,166,264.28	93.25%

3. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	06央行票据 15	39,592,313.84	19.01%
2	06华能 CP02	20,016,000.00	9.61%
3	02国债04	16,635,019.50	7.99%
4	05中化 CP01	14,434,500.00	6.93%
5	20国债00	14,375,699.70	6.90%

4. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细:无

5. 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细:无

6. 投资组合报告附注

①报告期内本基金投资的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证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

②报告期末本基金未持有股票。

③其他资产的构成

项目名称	期末余额(元)
交易保证金	250,000.00
应收证券清算款	
应收股利	
应收利息	1,933,881.07
应收申购款	396,592.53
其他应收款	27,200.00
待摊费用	
买入返售证券	
合计	2,607,673.60

④持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例
1	100795	国电转债	13,881,810.60	6.67%
2	125936	华西转债	8,699,296.44	4.18%
3	110317	宫港转债	7,407,195.20	3.56%
4	100726	华电转债	5,415,449.40	2.60%
5	100196	复星转债	2,710,734.40	1.30%
6	100236	桂冠转债	2,137,000.00	1.03%
7	110874	创业转债	706,305.60	0.34%
8	110001	邯钢转债	51,195.80	0.02%

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2006 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系列基金的招募说明书。

（一）嘉实增长基金

1. 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
2003年 7 月 9 日至 2003 年 12 月 31 日	6.49%	0.41%	-17.35%	1.16%	23.84%	-0.75%
2004年度	15.56%	0.89%	-15.41%	1.52%	30.97%	-0.63%
2005年度	8.85%	0.93%	-13.29%	1.67%	22.14%	-0.74%
2006年上半年	58.18%	1.13%	69.88%	1.63%	-11.70%	-0.50%

2.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的变动进行比较

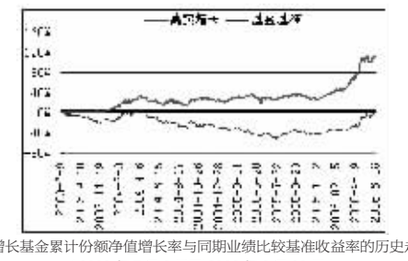

图 1:嘉实增长基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2003 年 7 月 9 日至 2006 年 6 月 30 日）

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。本报告期内,本基金的各项投资比例已符合基金合同第三部分（四、（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定:

（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;（2）持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;（5） 本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;（6）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。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但应在 10 个交易日内进行调整,并符合相应的规定。

（二）嘉实稳健基金

1. 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
2003年 7 月 9 日至 2003 年 12 月 31 日	6.29%	0.55%	-3.73%	0.94%	10.02%	-0.39%
2004年度	2.23%	0.91%	-15.97%	1.28%	18.20%	-0.37%
2005年度	2.96%	0.87%	-7.37%	1.31%	10.33%	-0.44%
2006年上半年	47.09%	1.07%	48.84%	1.36%	-1.75%	-0.29%

2.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的变动进行比较

图 2:嘉实稳健基金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
（2003 年 7 月 9 日至 2006 年 6 月 30 日）

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。本报告期内,本基金的各项投资比例已符合基金合同第三部分（四（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定:

（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%;（2）持有一家公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%;（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;（5） 本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容;（6）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。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但应在 10 个交易日内进行调整,并符合相应的规定。

（三）嘉实债券基金

1. 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
2003年 7 月 9 日至 2003 年 12 月 31 日	0.70%	0.15%	-1.24%	0.31%	1.94%	-0.16%
2004年度	-7.45%	0.27%	-2.42%	0.35%	-5.03%	-0.08%
2005年度	13.14%	0.19%	10.55%	0.18%	2.59%	0.01%
2006年上半年	17.74%	0.74%	0.52%	0.11%	17.22%	0.63%

2.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的变动进行比较

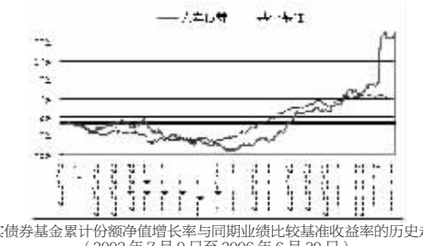

图 3:嘉实债券基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2003 年 7 月 9 日至 2006 年 6 月 30 日）

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。本报告期内,本基金的各项投资比例已符合基金合同第三部分（四、（一）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定:

（1）投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%;（2）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%;（3）投资于国债及信用等级为 BBB 级及以上（或者有高信用等级机构或相当优质资产担保）的金融债、企业（公司）债（包括可转债）等债券的比例不低于基金非现金资产的 80%。前述信用等级是指由国家有权机构批准或认可的信用评级机构进行的信用评级;（4）本基金所投资的新股上市流通后持有期不超过六个月;（5）新股投资比例不超过基金资产总值的 20%。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内,但应在 10 个交易日内进行调整,并符合相应的规定。

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

①以下条款适用于嘉实增长基金和嘉实稳健基金

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.5%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 1.5% ÷ 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

②以下条款适用于嘉实债券基金

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 0.6%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 0.6%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.6% ÷ 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

基金管理费每日计提,按月支付。经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

（2）基金托管人的基金托管费

①以下条款适用于嘉实增长基金和嘉实稳健基金

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E × 0.25% ÷ 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

②以下条款适用于嘉实债券基金

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.2%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.2%年费率计提。计算方法如下:

H=E × 0.2% ÷ 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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

（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、基金成立后与基金相关的会计师费和律师费。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。

（4）上述系列基金 / 基金费用由基金管理人按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

上述基金费用由相应的基金独立承担，本系列基金费用按各基金份额与各基金份额总和之比分摊。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

1.本系列基金 / 基金的申购费按申购金额采用比例费率,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。费率表如下:

申购金额（含申购费）	申购费率	
	嘉实增长 / 嘉实稳健	嘉实债券
100万元以下	1.5%	0.8%
100万元（含）— 500 万元	1.2%	0.6%
500万元（含）以上	每笔 1000 元	每笔 1000 元

投资者通过本基金管理人网上交易系统申购本系列基金 / 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%。但基金招募说明书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.赎回费根据持有时间实行递减收费。费率表如下:

持有期限	赎回费率	
	嘉实增长 / 嘉实稳健	嘉实债券
1年之内	0.5%	0.3%
1年（含）- 2 年	0.25%	0.15%
2年（含）以上	0	0

基金的赎回费用由赎回人承担,在扣除必要的手续费后,赎回费余额不得低于赎回费总额的 25%,并归入基金财产。

（3）转换费

基金份额持有人办理基金份额转换需要支付转换费，费率为被转出基金份额净值的 0.5%。如所转换的基金份额已被连续持有超过三个月时间,基金份额持有人可以免费转换。转换后的基金份额的持有时间重新开始计算。但以下情形除外:

1.嘉实保本基金保本期内,由基金管理人管理的其他开放式基金转入嘉实保本基金执行嘉实保本基金申购费率，由嘉实保本基金转出到基金管理人管理的其他开放式基金执行嘉实保本基金赎回费率。

2.由嘉实货币市场基金转出至嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金,转换费 = 转出金额 × 转入基金的适用申购费率（注:此转换行为,视同将转出金额用于申购嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金）。

3.由嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金转出至嘉实货币市场基金,转换费 = 转出金额 × 转出基金的适用赎回费率,转换费的 25%计入转出基金的基金资产（注:此转换行为,视同赎回嘉实成长收益基金、嘉实理财通系列基金、嘉实服务增值行业基金,再将赎回金额用于申购嘉实货币市场基金）。

（4）销售服务费

基金管理人可以根据中国证监会的有关规定从基金财产中计提销售服务费，用于基金的持续销售和服务基金份额持有人。

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。

（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基金资产的损失,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调低部分或全部基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告;此项调整无须召开基金份额持有人大会。

（四）基金的税收

本系列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 2003 年 5 月 29 日刊登的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。

3. 在“三、基金管理人”部分:更新了基金管理人的相关信息。

4.在“四、基金托管人”部分:更新了托管人的相关信息。

5.在“五、相关服务机构”部分:增加国盛证券有限责任公司为本基金代销机构。

6.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。

7.在“十二、基金的业绩”部分:说明了基金成立以来的投资业绩。

8.在“二十四、其他应披露事项”部分:增加了 2006 年 1 月 9 日至 2006 年 7 月 9 日本基金的相关临时公告事项列表。

嘉实基金管理有限公司
2006 年 9 月 6 日

证券代码:002021　　证券简称:中捷股份　　公告编号:2006-036

中捷缝纫机股份有限公司限售股份上市流通提示性公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

特别提示:

1、本次限售股份实际可上市流通数量为 15,976,480 股。

2、本次限售股份可上市流通日为 2006 年 9 月 8 日。

一、股权分置改革方案概述

1、股权分置改革对价方案要点:

全体流通股股东按照每 10 股获付 4.5 股的比例取得非流通股股东支付的对价股份,共计 18,720,000 股。

2、通过股权分置改革方案的股东大会日期、届次:

2005 年 7 月 27 日,经公司 2005 年第一次临时股东大会审议通过。

3、股权分置改革方案实施日:

2005 年 9 月 7 日

二、本次限售股份可上市流通安排

1、本次限售股份可上市流通时间为 2006 年 9 月 8 日;

2、本次可上市流通股份的总数 15,976,480 股,占限售股份总数的 15.90%、无限售条件股份总数的 20.38%和公司股份总数的 8.93%; 各限售股份持有人本次限售股份可上市流通情况如下:

序号	限售股份持有人名称	持有限售股份数(股)	本次可上市流通股数(股)	本次可上市流通股数占限售股份总数的比例(%)	本次可上市流通股数占无限售条件股份总数的比例(%)	本次可上市流通股数占公司股份总数的比例(%)
1	蔡开坚	48,222,720	0	0	0	0
2	蔡冰	16,074,240	0	0	0	0
3	佐藤秀一	1,004,640	1,004,640	1	1.28	0.56
4	玉环兴业服务有限公司	16,074,240	8,944,000	8.90	11.41	5
5	中捷控股集团有限公司	13,060,320	0	0	0	0
6	北京网智通信息技术有限公司	6,027,840	6,027,840	6	7.69	3.37
合 计		10,0464,000	15,976,480	15.90	20.38	8.93

三、本次可上市流通限售股份持有人在股权分置改革时做出的各项承诺及履行情况

限售股份持有人名称	承诺内容	承诺内容调整	承诺履行情况
蔡开坚	1.2005 年 9 月 8 日至 2006 年 9 月 7 日不上市交易或者转让。2006 年 9 月 8 日至 2008 年 9 月 7 日不通过深圳证券交易所中小企业板块挂牌向社会公众出售。 2.此后二十四个月内,若其通过深圳证券交易所中小企业板挂牌出售股票，出售价格不能低于每股人民币 12.99 元（若自非流通股取得流通权之日起至出售股份期间有派息、送股、资本公积金转增股份等除权事项，应对该价格进行除权处理）。	2005年度利润分配及公积金转增股本后,承诺出售价格调整为不能低于每股人民币 9.84 元。	履行承诺
蔡冰	同上	同上	履行承诺
中捷控股集团有限公司	同上	同上	履行承诺
玉环兴业服务有限公司	1.2005 年 9 月 8 日至 2006 年 9 月 7 日不上市交易或者转让。 2.在上述承诺期满后,其通过深圳证券交易所中小企业板挂牌交易出售股份的数量占中捷股份的股份总数比例在十二个月内不超过 5%,在二十四个月内不超过 10%。	承诺履行条件未发生变化。	履行承诺
北京网智通信息技术有限公司	2005年 9 月 8 日至 2006 年 9 月 7 日不上市交易或者转让。	承诺履行条件未发生变化。	履行承诺
佐藤秀一	2005年 9 月 8 日至 2006 年 9 月 7 日不上市交易或者转让。	承诺履行条件未发生变化。	履行承诺

四、股本变动结构表

股份类型	本次限售股份上市流通前	本次限售股份上市流通后
一、有限售条件的流通股		
1.有限售条件的流通股 其中: 国家及国有法人持股 境内一般法人持股 境内自然人持股 境外法人、自然人持股	 35,162,400 64,296,960 1,004,640	 20,190,560 64,296,960 0
2.内部职工股		
3.机构投资者配售股份		
4.高管股份		
5.其他		
有限售条件的流通股合计	100,464,000	84,487,520
二、无限售条件的流通股		
1.人民币普通股	78,416,000	94,392,480
2.境内上市的外资股		
3.境外上市的外资股		
4.其他		
无限售条件的流通股合计	78,416,000	94,392,480
三、股份总数	178,880,000	178,880,000

五、保荐机构核查报告的结论性意见

截止本核查报告出具日，中捷股份限售股份持有人均能严格履行其在公司股权分置改革时做出的各项承诺。至 2006 年 9 月 7 日,玉环兴业服务有限公司、北京网智通信息技术有限公司、佐藤秀一限售承诺履行完毕,其持有的公司限售股份将于 2006 年 9 月 8 日解除限售,上市流通。其中,玉环兴业服务有限公司通过深圳证券交易所中小企业板挂牌交易出售股份的数量占中捷股份的股份总数比例在十二个月内不超过 5%（8,944,000 股）。实际控制人股东蔡开坚、蔡冰、中捷控股集团有限公司限售承诺未履行完毕,其持有的公司限售股份仍处于限售期,不在深圳证券交易所中小企业板块挂牌交易。

公司本次部分限售股份上市流通符合《公司法》、《证券法》、《中小企业上市公司限售股份上市流通实施细则》等法律、法规及深圳证券交易所的有关规定;公司本次限售股份上市流通不存在实质性障碍;本保荐人同意公司本次限售股份上市流通。

六、其他事项

1、公司限售股份不存在垫付对价情形及偿还情况;

2、申请限售股份上市流通的限售股份持有人是不存在对公司的非经营性资金占用及公司对该股东的违规担保;

3、2006 年 7 月 11 日，蔡开坚、蔡冰与中捷控股集团有限公司签署了《中捷控股集团有限公司增资扩股合同》,蔡开坚、蔡冰拟以持有的中捷股份限售流通股增资中捷控股集团有限公司。中捷控股集团有限公司承诺,在增资完成后,保证继续履行包括蔡开坚、蔡冰在中捷股份股权分置改革时做出的各项承诺。

该收购事项经中捷股份 2006 年第三次临时股东大会审议通过,需获得国家商务部、中国证监会批准,目前相关手续尚在办理中。

七、备查文件

1、限售股份上市流通申请表

2、保荐机构核查报告

3、深交所要求提供的其他文件

中捷缝纫机股份有限公司董事会
2006 年 9 月 6 日

证券代码:600150　　证券简称:G 重机　　编号:临 2006—20

沪东重机股份有限公司
第三届董事会 2006 年第六次临时会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的准确和完整,对公告的虚假记载,误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

沪东重机股份有限公司第三届董事会 2006 年第六次临时会议于 2006 年 9 月 5 日以通讯方式召开,应参加表决董事 11 名,实参加表决董事 11 名。本次会议符合公司章程和有关法律、法规的要求,会议合法有效。会议经与会董事审议,并以记名投票方式表决,形成决议如下:

审议通过《关于对上海沪东造船柴油机配套厂改制相关内容进行确认的议案》。

1、同意解除联营协议,同意上海沪东造船柴油机配套厂由原来的国有联营企业改制为有限公司。

2、同意上海长信资产评估有限责任公司