嘉实成长收益证券投资基金

更新招募说明书摘要

（2006 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

嘉实成长收益证券投资基金（以下简称“本基金或基金”）经中国证券监督管理委员会于 2002 年 9 月 26 日《关于同意嘉实成长收益证券投资基金设立的批复》（证监基金字 [2002] 68 号）核准公开发售。本基金基金合同于 2002 年 11 月 5 日正式生效，自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。本基金类型为契约型开放式，根据本基金的投资目标和投资范围，本基金属于成长收益混合型证券投资基金。

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。

本招募说明书所载内容截止日为 2006 年 11 月 5 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2006 年 9 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	中诚信托投资有限责任公司 48%，立信投资有限责任公司 32.5%，德意志资产管理（亚洲）有限公司 19.5%。
存续期间	持续经营
电话	（010）65188866
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 月至今任中诚信托投资有限责任公司党委书记、董事长。

王少华先生，董事。大学本科学历，高级会计师。1992 年至 1995 年任中国南方证券有限公司海南分公司副总经理、总经理。1996 年至今在中诚信托投资有限责任公司工作，现任中诚信托投资有限责任公司总裁。

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。1987 年 7 月至 1990 年 9 月在天津通信广播公司电视设计所任助理工程师。1992 年 12 月至 1993 年 6 月在外经贸部中国仪器进出口总公司任经济师。1993 年 7 月至 1994 年 8 月在北京商品交易所任信息处长。1994 年 8 月至 1995 年 5 月在天津纺织原材料交易所任总裁、法定代表人。1995 年 5 月至 1997 年 5 月在商鼎期货经纪有限公司任副总经理兼上海营业部总经理。1998 年 6 月至 1998 年 9 月在北京证券有限公司任基金部总经理助理、阜成路营业部总经理助理。1998 年 9 月至 2000 年 10 月在大成基金管理有限公司助理总经理、副总经理。2000 年 10 月至今在嘉实基金管理有限公司任总经理。

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。

杨启典先生，董事，大学本科。1988 年毕业于东北财经大学财务会计专业。1992 年至今，担任维维集团股份有限公司董事长。

Edouard Femen Peter 先生，董事，瑞士籍，美国 Carlton 大学行政管理学士。曾任 UBS 董事总经理，德意志银行董事总经理。现任德意志资产管理公司董事总经理兼德意志资产管理（亚洲）有限公司首席执行官。

张强先生，独立董事。大学本科学历。1982 年至今在中央财经大学工作，现为教授，1994 年至今任中央财经大学证券期货研究所所长。

汤欣先生，独立董事。法学博士、1998 年至 2000 年任北京大学法学院博士后研究人员、授课教师，1999 年至 2000 年任中国证监会《上市公司收购暂行规定（草案）》起草小组成员，2000 年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。

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 年至今任职于中国注册会计师协会协会注册中心，担任中心主任。

苗菁先生，监事，大学本科。1995 年 7 月起任职于中诚信托投资有限责任公司，现任中诚信托投资有限责任公司投资管理部副总经理。

Lindsay Wright 女士，监事，大学本科（学士），曾任德意志银行（新西兰）（前身为新西兰信托银行）COO、董事总经理，德意志银行亚太资本合伙公司 COO、董事总经理，德意志信托银行亚太区 COO、德意志资产管理集团 COO 及董事总经理，德意志资产管理集团亚太区 COO。现任德意志资产管理有限公司亚太及中东区业务发展主管。

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。

窦玉明先生，副总经理，硕士研究生。1994 年 6 月至 1995 年 6 月在北京中信国际合作公司金融小组工作。1995 年 6 月至 2000 年 2 月任职于深圳君安证券公司投资经理。2000 年 2 月至 2000 年 10 月任职于大成基金管理公司基金经理助理。2000 年 10 月至今任职于嘉实基金管理有限公司，历任投资部总监、总经理助理和公司副总经理。

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 月任职于中沙警卫局。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，督察长，中共党员、硕士。曾就职于国家计委，嘉实基金管理有限公司研究部、市场部。现任嘉实基金管理有限公司督察长。

2、本基金基金经理

（1）现任基金经理

孙林先生，经济学硕士，证券从业经历 8 年。曾受聘于国泰君安证券公司从事证券投资工作。2000 年 10 月进入嘉实基金管理有限公司工作，曾任基金泰和基金经理助理。2003 年 1 月 24 日至今任嘉实成长收益基金基金经理，2005 年 6 月 10 日至今任嘉实服务增值行业基金基金经理。

刘志强先生，管理学硕士，5 年证券从业经历。曾任平安保险（集团）公司投资管理中心研究员，嘉实基金管理有限公司交易员、研究员、嘉实服务增值行业基金经理助理、嘉实成长收益基金经理助理。2006 年 11 月 23 日至今任嘉实成长收益基金经理。

（2）历任基金经理

2002 年 11 月 5 日至 2004 年 8 月 10 日窦玉明先生任本基金基金经理。

3、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，公司副总经理兼投资总监窦玉明先生，公司总经理助理兼固定收益部总监戴京焦女士，资深基金经理邵健先生、王贵文先生、刘夫先生、刘熹先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国银行股份有限公司（简称“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

法定代表人：肖 钢

企业类型：股份有限公司

注册资本：人民币贰千壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元

存续期间：持续经营

成立日期：1983 年 10 月 31 日

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门总经理：秦立儒

托管部门联系人：宁敏

电话：（010）66594977

传真：（010）66594942

网址：http://www.boc.cn

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；并在上海市分行、深圳市分行设立托管业务团队。

中国银行托管及投资者服务部现有员工 70 余人，其中硕士学历以上人员 21 人，具有一年以上海外工作和学习经历的人员有 10 余人。

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北京直销中心

办公地址：北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

电话：（010）65188866

传真：（010）65180017

联系人：钱卫东

（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：晨文红

（3）嘉实基金管理有限公司西南直销中心

办公地址：成都市人民中路 2 段 35 号中银大厦 2911－2912

电话：（028）86402797

传真：（028）86402799

联系人：胡清泉

（4）嘉实基金管理有限公司深圳直销中心

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

2.代销机构

(1) 中国银行股份有限公司

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）66594973

传真：（010）66594946

客户服务统一电话：95566

联系人：高越

网址：http://www.boc.cn

（2）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：金运

电话：（021）68881829

客服电话：95528

联系人：倪苏云

网址：www.spdb.com.cn

（3）兴业银行股份有限公司

住所、办公地址：福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

电话：（0591）87839338

传真：（0591）83317786

联系人：陈丹

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

（4）深圳发展银行股份有限公司

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)

电话：（0755）82088888－8811

传真：（0755）82080714

联系人：周 勤

客服热线：95501

网址：www.sdb.com.cn

（5）招商银行股份有限公司

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

电话：（0755）83195226

传真：（0755）83195201

联系人：姜然

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（6）中信建投证券有限责任公司（原华夏证券股份有限公司）

住所：北京市朝阳区安立路 66 号

办公地址：北京市朝阳门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：（010）65183888

传真：（010）65182261

联系人：权唐

客户服务电话：400－8888－108

网址：www.csc108.com

（7）海通证券股份有限公司

住所：上海市唐山路 218 号

办公地址：上海淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021)53594566－4125

传真：(021)53858549

联系人：金芸

客户服务电话：（021）962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

网址：www.htsec.com

（8）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：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021)62580818－213

传真：(021)62583439

联系人：芮敏祺

客户服务热线：4008888666

网址：www.gtja.com

（9）中国银河证券有限责任公司

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：朱利

电话：（010）66568587，66568613

传真：（010）66568536

联系人：郭京华

网址：www.chinastock.com.cn

（10）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：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 19 楼

法定代表人：兰荣

电话（021）68419974

传真：（021）68419867

联系人：杨盛芳

客户服务电话：（021）68419125

网站：www.xyzq.com.cn

（11）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：马国强

电话：（0755）82492000

传真：（0755）82492062

联系人：范雪玲

客户服务中心咨询电话：4008888555、（0755）25125666

网址：www.lhzq.com

（12）华泰证券有限责任公司

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

电话：(025)84457777－882、721

传真：(025)84579879

联系人：张雪瑾、袁红彬

客户咨询电话：(025)84579897

网址：www.htsc.com.cn

（13）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

电话：(010)68431166

传真：（010）88018657

联系人：白源

客户服务热线：（010）68431166－8002、8009

网址：www.bjzq.com.cn

（14）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 40－45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755)82943511

传真：(0755)82943227

联系人：黄健

客户服务热线：4008888111、(0755)26951111

网址：www.newone.com.cn

（15）东吴证券有限责任公司

住所：苏州市十梓街 298 号

办公地址：苏州市石路爱河桥 26 号

法定代表人：吴永敏

电话：(0512)65581136

传真：（0512）65588021

联系人：方晓丹

客户服务热线：(0512)96288

网址：www.dwzq.com.cn

（16）国信证券有限责任公司

住所、办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦

法定代表人：何如

电话：(0755)82130833

传真：(0755)82133302

联系人：林建闽

客户服务电话：800－810－8868

网址：www.guosen.com.cn

（17）广发证券股份有限公司

住所：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36、38、41、42 楼

法定代表人：王志伟

电话：（020）87555888

传真：（020）87557987

联系人：肖中梅

客户咨询电话：（020）87555888 转各营业网点

网址：www.gf.com.cn

（18）国都证券有限责任公司

住所：深圳市福田区华强北路赛格广场 45 楼

办公地址：北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层

法定代表人：王少华

电话：(010)64482828

传真：(010)64482090

联系人：马泽承

客户服务电话：8008108809

网址：www.guodu.com

（19）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：王明权

电话：（021）54033888

传真：（021）54038844

联系人：王序微

客服电话：（021）962505

网址：www.sw2000.com.cn

(20)中信证券股份有限公司

住所：深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦

法定代表人：王东明

电话：（010）84864818

传真：（010）84865560

联系人：陈忠

网址：www.ecitic.com

（21）长城证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14 层

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：魏云鹏

电话：（0755）83516094

传真：（0755）83516199

联系人：高峰

客户咨询电话：(0755)82288968

网址：www.cc168.com.cn

（22）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：杨秀丽

电话：（0755）82450826

传真：（0755）82433794

联系人：任磊、苗永华

全国统一客户服务热线：95511

网址：www.pa18.com

（23）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

电话：（010）85252605

传真：（010）85252655

联系人：杨甦华

客户服务电话：（0371）7639999

网址：www.mszq.com

（24）光大证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15－16 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦北塔 2004 室

法定代表人：王明权

电话：（021）68816000

传真：（021）68815009

联系人：张琦

客户服务电话：（021）68823685

网址：www.ebscn.com

（25）东方证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东大道 720 号 20 楼

办公地址：上海市巨鹿路 756 号

法定代表人：王益民

电话：（021）62476600

传真：（021）62474651

联系人：盛云

客户服务电话：（021）952506

网址：www.dfzq.com.cn

（26）渤海证券有限责任公司

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

电话：（022）28451883

传真：（022）28451892

联系人：徐焕强

网址：www.ewww.com.cn

（27）国元证券有限责任公司

住所、办公地址：安徽省合肥市寿春路 139 号

法定代表人：凤良志

电话：（0551）2634400－1112

传真：（0551）2634400－117

客户服务电话：4008－888－777，安徽地区 96888

联系人：李赛

网址：www.gyzq.com.cn

（28）广东证券股份有限公司

住所、办公地址：广州市解放南路 123 号金汇大厦

法定代表人：钟伟华

电话：（020）83270846

传真：（020）83270846－76504

联系人：陈新

网址：www.stock2000.com.cn

（29）长江证券有限责任公司

住所：湖北省武汉市新华路特 8 号

办公地址：上海市汉口路 130 号长江证券大厦 5F

法定代表人：胡运钊

电话：（021）63296362

传真：（021）51062920

联系人：甘露

客户服务热线：4008－888－999

网址：www.cz318.com.cn

（30）浙商证券有限责任公司（原金信证券有限责任公司）

住所、办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

法定代表人：陈唯贤

电话：（0571）87901946

传真：（0571）87902128

联系人：陈凡

网址：www.kinghing.com

（31）中信万通证券有限责任公司

住所、办公地址：青岛市崂山区香港东路 316 号

法定代表人：史洁民

电话：（0532）85022026

传真：（0532）85022511

联系人：丁韶燕、陈向东

网址：www.zxwt.com.cn

（32）山西证券有限责任公司

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

法定代表人：吴晋安

电话：（0351）8686703

传真：（0351）8686709

联系人：张治国

客户服务电话：（0351）8686868

网址：www.i618.com.cn

（33）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：蒋永明

电话：（0731）4403343

传真：（0731）4403439

联系人：张治平

客户服务热线：（0731）4403343

网址：www.cfzq.com

（34）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

电话：（0771）5539262

传真：（0771）5539033

联系人：覃清芳

客服热线：4008888100（全国），96100（广西）

网址：www.ghzq.com.cn

（35）恒泰证券有限责任公司

住所：内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 111 号

办公地址：上海市广东路 689 号海通大厦

法定代表人：李庆阳

电话：（021）68405772

传真：（021）51159597

联系人：吴李红

网址：http://www.cnht.com.cn

（36）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：张慎修

电话：（0755）83025430

传真：（0755）83025991

联系人：杨玲

客户服务电话：4008－888－818

网址：www.hx168.com.cn

（37）东北证券有限责任公司

住所：长春市人民大街 138－1 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：李树

电话：（0431）96688－99，5096733

传真：（0431）5680032

联系人：高新宇

网址：http://www.nesc.cn

（38）西北证券有限责任公司

住所：宁夏银川民族北街 1 号

办公地址：宁夏银川市民族北街 15 号西北证券经纪业务部

法定代表人：姜魏

联系人：杨晓东

传真：（0951）6024646

网址：www.nws.com.cn

（39）江南证券有限责任公司

住所、办公地址：江西省南昌市象山北路 208 号

法定代表人：姚江涛

电话：（010）84802022

传真：（010）84801799

联系人：方俊才

客户服务电话：（0755）83366612，83325909

网址：http://www.scstock.com

（40）德邦证券有限责任公司

住所：沈阳市沈河区小西路 49 号

办公地址：上海市浦东南路 588 号浦发大厦 26 楼

法定代表人：王军

电话：（021）68590808－8125

传真：（021）68596077

联系人：罗芳

客服电话：（021）68590808－8119

网址：www.tebon.com.cn

（41）东海证券有限责任公司

住所：常州延陵西路 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 13 楼

法定代表人：顾森贤

电话：（021）50586660

传真：（021）50586660－8880

联系人：邵一明

客户服务热线：（010）86525005、（021）62196752 、（0755）83154530，（0519）6634000

网址：www.longone.com.cn

（42）宏源证券股份有限公司

住所：新疆乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址：北京海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层（营销经纪总部）

法人代表人：汤世生

电话：（010）62267799－6416

传真：（010）62294470

联系人：张智江

咨询电话：（010）62267799－6789

网址：www.ehongyuan.com

（43）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：上海市浦东银城东路 139 号华能联合大厦 18 楼

法定代表人：陈学荣

电话：（021）68634518

传真：（021）68865938

联系人：陈伟（021）68634818－8631

开放式基金客服电话：（021）68865020

网址：www.xcsc.com

（44）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 41 层

法定代表人：段强

电话：（0755）83199511

传真：（0755）83199545

联系人：夏尚

客户服务电话：（0755）83199511

网址：www.csco.com.cn

（45）金元证券有限责任公司

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：郑辉

电话：（0755）83025695

传真：（0755）83025625

联系人：金春

开放式基金客服电话：（0755）83025695

网址：http://www.jyzq.cn

（46）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

电话：（029）87406172

传真：（029）87406387

联系人：黄晓军

客户服务电话：（029）87406132

网址：www.westsecu.com.cn

（47）国联证券有限责任公司

住所：江苏省无锡市县前东街 8 号

办公地址：江苏省无锡市县前东街 8 号国联大厦 7 楼

法定代表人：范炎

联系人：袁丽萍

电话：（0510）2831662，2588168

传真：（0510）2831589

网址：http://www.glsc.com.cn

（48）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：平岳

客服电话：（021）68604866

传真：（021）50372474

联系人：张静

网址：http://www.bocichina.com.cn

（49）中信金通证券有限责任公司（原金通证券股份有限公司）

住所、办公地址：浙江省杭州市凤起路 108 号国信房产大厦 8－12 层

法定代表人：应土歌

电话：（0571）85783750

传真：（0571）85783771

联系人：龚晓军

客户服务电话：（0571）96598

网址：http://www.bigsun.com.cn

（50）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

联系电话：（0791）6289771

传真电话：（0791）6289395

联系人：万齐志

网址：www.gsstock.com

注：基金管理人于 2005 年 1 月 27 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》刊登《关于暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的基金申购业务的公告》，从即日起暂停办理闽发证券、汉唐证券提交的本基金申购业务。对于此前通过闽发证券、汉唐证券认购、申购的本基金份额，基金份额持有人仍可在闽发证券、汉唐证券正常办理赎回或转托管业务。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（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：德恒律师事务所

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座十二层

负责人：王丽

电话：（010）66575888

传真：（010）65232181

联系人：刘继

经办律师：黄侦武　刘继

（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

电话：（021）61238888

传真：（021）61238800

联 系 人：许康玮

经办注册会计师：汪棣、许康玮

四、基金的名称

本基金名称：嘉实成长收益证券投资基金

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

本基金定位于成长收益混合型基金，在获取稳定的现金收益的基础上，积极谋求资本增值机会。

七、基金的投资方向

本基金的投资限于具有良好流动性的金融工具。主要包括国内依法发行上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票资产 30%－75%；债券资产 20%－65%；现金资产比例控制在 5%左右。其中，基金对收益型资产类(包括收益型股票和债券)的投资不低于基金资产净值的 40%，对国债的投资不低于基金资产净值的 20%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

1、大类资产配置

在全面评估证券市场现阶段系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上，制订基金资产在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。

2、收益型资产类的投资策略

根据目前金融市场状况，为实现收益目标，本基金主要投资于以下三类资产：一是按照规定，至少 20%的国债投资；二是投资于具有相对较高收益率的企业债、金融债和公司可转债；三是投资收益型股票。本基金将在分析比较债券到期收益率和当前市场收益型股票的股息收益率的基础上，结合市场情况从而对收益型资产类中债券和收益型股票进行资产配置，并通过“精选收益型股票”的策略以及稳健的债券投资来获得良好的收益目标。

（1）“精选收益型股票”的投资策略

对于收益型股票，将以预期股息收益率超过同期一年期银行存款利率为核心，同时结合以下几方面进行选择：

A. 公司进入稳定发展阶段，预期主营业务收入及净利润保持稳定增长；

B. 公司现金流状况良好；

C. 公司有现金分红历史记录，同时具有继续进行现金分红的潜力；

D. 预期股息收益率处于市场平均水平之上。

根据以上标准，选择出重点目标公司，在周密的案头研究基础上，通过实地调研，最终精选一批具备投资价值的收益型股票，做中长期投资。

（2）债券投资策略

债券是实现基金资产安全和当期收益目标的重要金融工具，本基金在国债投资部分将根据对国债市场和利率走势的综合判断，在银行间市场和交易所市场之间积极寻找价格被低估的债券品种，追求稳定的债券票息收入或差价收益。对所有的国债资产，在充分估算基金资产流动性状况的基础上，积极参与债券回购交易，获取无风险收益。

3、成长型资产类的投资策略

本基金将主要通过实施“行业优选、积极轮换”的策略，实现“资本增值”目标。

本基金将加强对行业基本面的研判，跟踪各行业发展动态，对行业择优而投，即投资于那些基本面已出现积极变化、景气程度增加但股票市场却反应滞后的行业，并根据行业的基本面变化以及股票市场行业指数表现，实施积极的行业轮换，不断寻找新的行业投资机会。而实施以上策略的关键在于寻找一个合适的行业价值评估方法，本基金管理人结合自身研究和国外研究成果，建立了一套适合中国股票市场特点的行业价值评估体系，并在基金的投资实践中不断修正和完善该体系。总结起来，本基金管理人目前使用的行业价值评估体系可归结为“两个方法、一个系统”，即行业景气评价方法和行业指数对基本面因素的敏感度分析方法，以及数据库支持系统。策略实施的主要流程如下：

（1）进行准确有效的行业分类，为开展行业研究和行业资产类投资奠定基础。

（2）研究员采取自上而下的研究方法，以细分行业作为最终研究对象，从以下两方面对行业进行评级分析：一是以行业相对增长率为核心的行业景气趋势研究；另一方面是对股票市场是否合理反映行业基本面变化做出判断。本基金在以上研究的基础上，对行业进行优选并积极轮换，以尽享行业的周期性增长机会。

（3）在确定具体的行业投资比例后，本基金在业绩主导原则基础上对行业内个股进行投资价值判断。所谓业绩主导原则具体包括以下几方面要求：①业绩增长性要求，公司预期经营性收入、净利润等业绩指标增长能够保持在行业内中上水平；②业绩含金量要求，公司收入或利润的增长 50%以上来源于主营业务收入或利润的增长；③业绩的行业相关性要求，公司经营状况与行业基本面状况具有较强相关性，公司能够从行业景气上升中直接受益。在此基础上，本基金重点采用相对价值评价方法，对股票投资价值进行判断。

（4）针对某些市场环境和行业特点，本基金会采用程序交易技术，对行业内个股采取指数化投资策略。

（二）投资管理程序

1、研究部通过内部独立研究，并借鉴其它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，按照基金的契约规定，提出下一阶段本基金投资组合中股票、债券、现金的配置比例，并制订基金在其它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决议，参考本公司研究部和其它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。

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，结合基金申购和赎回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

上证 A 股指数

十、基金的风险收益特征

本基金属于中等风险证券投资基金，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 值不超过 0.75。在此前提下，本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例，努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证 A 股指数涨幅的 65%，股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证 A 股指数跌幅的 55%。

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 2006 年 10 月 25 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 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

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	1,016,600,531.22	71.23%
债券	290,666,760.40	20.36%
银行存款及清算备付金合计	90,827,409.83	6.36%
应收证券清算款	22,682,294.85	1.59%
权证		
其他资产	6,511,252.05	0.46%
合计	1,427,288,248.35	100%

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	2,405,462.12	0.18%
B 采掘业		
C 制造业	279,302,927.82	20.52%
C0 食品、饮料		
C1 纺织、服装、皮毛	471,419.52	0.03%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	1,228,879.68	0.09%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	107,100,140.72	7.87%
C5 电子	585,497.46	0.04%
C6 金属、非金属		
C7 机械、设备、仪表	123,368,574.40	9.07%
C8 医药、生物制品	46,548,416.04	3.42%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	3,801,559.68	0.28%
E 建筑业	819,811.89	0.06%
F 交通运输、仓储业	117,000,986.10	8.60%
G 信息技术业	36,783,651.70	2.70%
H 批发和零售贸易	126,801,383.12	9.32%
I 金融、保险业	161,270,139.10	11.86%
J 房地产业	93,926,202.44	6.91%
K 社会服务业	132,115,467.25	9.71%
L 传播与文化产业	62,372,940.00	4.59%
M 综合类		
合计	1,016,600,531.22	74.73%

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	000069	G华侨城	8,837,155	132,115,467.25	9.71%
2	600036	G招行	13,133,515	130,547,139.10	9.60%
3	600859	王府井	7,964,911	126,801,383.12	9.32%
4	600386	G北巴	13,063,359	108,425,879.70	7.97%
5	000402	G金融街	8,628,862	86,461,197.24	6.36%
6	000936	G华西村	19,073,319	76,293,276.00	5.61%
7	600150	G重机	2,969,360	70,641,074.40	5.19%
8	600037	G歌华	4,158,196	62,372,940.00	4.58%
9	600590	G泰豪	5,750,000	52,727,500.00	3.88%
10	600436	G片仔癀	2,286,644	42,737,376.36	3.14%

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	69,807,918.20	5.13%
金融债	220,255,880.00	16.19%
央行票据		
企业债		
可转换债券	602,962.20	0.05%
资产支持证券		
合计	290,666,760.40	21.37%

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	02国开 10	70,784,000.00	5.20%
2	21国债(3)	40,464,000.00	2.97%
3	02进出 03	39,789,880.00	2.92%
4	00国开 13	39,788,000.00	2.92%
5	00国开 03	30,174,000.00	2.22%

6. 报告期末按市