嘉实主题精选混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

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

（2007 年第 1 号）

嘉实主题精选混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据 2006 年 6 月 12 日中国证券监督管理委员会《关于同意嘉实主题精选混合型证券投资基金募集的批复》（证监基金字[2006]117 号）核准进行募集。本基金基金合同于 2006 年 7 月 21 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系列基金 / 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 2007 年 1 月 21 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 12 月 31 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。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。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 Fernen 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。

贺强先生,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。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。

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。

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

王贵文先生,CFA,拥有十一年国内外金融从业经验。曾任职于国家计委经济研究中心,1998 年至 1999 年任花旗集团所属 PRIMERICA 投资理财顾问公司投资顾问,1999 年至 2000 年任加拿大 ASSANTE 资产管理有限公司投资经理,2000 年至 2002 年任职于大成基金管理有限公司、2002 年任国信证券资产管理部副总经理、资产管理部总经理、国信证券总裁助理。2005 年 10 月至今任嘉实基金管理公司投资决策委员会成员,基金经理,负责社保组合的投资管理。2002 年 1 月至 2002 年 12 月曾任基金景业基金经理,2006 年 7 月至今任本基金基金经理。

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。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

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:人民币贰仟壹佰柒拾玖亿肆仟壹佰柒拾柒万捌仟零玖元
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。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深圳直销中心
办公地址:深圳市深南东路发展银行大厦附楼二楼
电话:（0755）25870686
传真:（0755）25870663
联系人:钟俊杰

（4）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

2.代销机构

（1）中国银行
住所:北京市复兴门内大街 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
联系人:高越
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn

（2）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:上海市中山东一路 12 号
法定代表人:金运
电话:（021）61618888
传真:（021）63602431
联系人:倪苏云、汤嘉惠
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

（3）深圳发展银行
住所、办公地址:深圳深南中路 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
网站:www.sdb.com.cn

（4）兴业银行
住所:福州市湖东路 154 号
办公地址:福州市五一中路元洪大厦 25 层
法定代表人:高建平
电话:（021）62677777
传真:（021）62569070
联系人:陈晓瑾
客户服务电话:95561
网址:www.cib.com.cn

（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
电话:（0755）83195226
传真:（0755）83195021
联系人:姜然
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

（6）华夏银行
住所、办公地址:北京市东城区建国门内大街 22 号
法定代表人:刘海燕
电话:（010）85238422
传真:（010）85238419
联系人:郑鹏
客户服务中心电话:95577
网址:www.hxb.com.cn

（7）中国银河证券股份有限公司（原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
传真:（010）66568536
联系人:郭京华
网址:www.chinastock.com.cn

(8)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

（9）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

（10）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
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

（11）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

（12）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

（13）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

（14）海通证券股份有限公司
注册、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

（15）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

（16）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
法定代表人:兰荣
联系电话:（021）68419974
传真:（021）68419867
联系人:杨盛芳
客户服务电话:（021）68419974
网站:www.xyzq.com.cn

（17）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

（18）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
办公地点: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

（19）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:www.bocichina.com.cn

（20）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:陈向东、丁韶燕
网址:www.zxwt.com.cn

（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）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

（23）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

（24）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:上海市中山南路 318 号 2 号楼 22－29 层
法定代表人:王益民
电话:（021）63325888
传真:（021）63327888
联系人:盛云
客户服务电话:（021）952506
网址:www.dfzq.com.cn

（25）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
开放式基金咨询电话:（0431）96688－99,5096733
开放式基金业务传真:（0431）5680032
联系人:高新宇
网址:http://www.nesc.cn

（26）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:叶黎成
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

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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:www.bigsun.com.cn

（31）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

（32）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

（33）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:安徽地区:96888;全国:400－8888－777
传真:（0551）2634400－117
联系人: 李蔡
电话:安徽地区:96888;全国:400－8888－777
网址: www.gyzq.com.cn

（34）长江证券有限责任公司
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

（35）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

（36）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（518034）
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

（37）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

（38）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

（39）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

（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）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）67639999
网址:www.mszq.com

（42）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东塔楼
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

（43）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
客服热线:（029）87406132
网址:www.westsecu.com.cn

（44）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
电话:（020）87320991
传真:（020）87325036
联 系 人:王江川
客户服务热线:（020）87320991、87320595
网址:www.gzs.com.cn

（45）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
开放式基金咨询电话:（0510）82831662,82588168
开放式基金业务传真:（0510）82831589
网址: www.glsc.com.cn

（二）基金注册登记机构: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:北京市东城区建内大街贡院西街六号 E 座 9 层
联系电话:（010）65171188
传真:（010）65176800
联系人:黄伟民
经办律师:黄伟民、曾宪政

（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:嘉实主题精选混合型证券投资基金

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

充分把握中国崛起过程中的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。

七、基金的投资方向

本基金投资范围限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合的资产配置范围为:股票资产 30%～95%,债券 0～70%,权证 0～3%,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的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金采用“主题投资策略”（Thematic Investment Approach）,依托基金管理人的投研团队,借鉴外部合作方的研究成果,构建投资组合,动态把握市场投资机会。

1、资产配置

本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金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,减小基金的系统性风险。在资产配置上,将优先考虑股票类资产的配置,在确定证券市场主题之后构造股票组合,剩余资产将配置于固定收益类和现金类等大类资产上。

2、股票投资策略

股票投资部分,将从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合。

（1）主题发掘

投资主题是影响经济发展和企业盈利的关键性和趋势性因素,它具有以下特点:

●前瞻性;

●动态变化;

●主题所涉及的企业不局限于某一具体的行业或地域;

●主题之间相对独立;

中国的发展具有多层次、多样化、动态变化的特点,不同主题下的企业两极分化的特点更加明显;中国的崛起也是一个多层次、长周期的历史性进程,不同特点的企业发展顺序有先有后,发展速度和获益程度各不相同,新旧投资主题将出现更替。投资主题所影响的企业不仅仅局限于行业、地域这一传统的划分范围之内,具有跨行业、跨地域特点的投资主题将为市场带来新的投资机会。各主题之间具有相对独立的特点,证券市场存在“多主题驱动”的投资机会。

基金管理人将依托基金管理人的投研团队,立足于“嘉实 TOP－DOWN 研究模型”,根据嘉实宏观经济、政策制度和其他领域的相关研究报告以及外部合作方的研究成果,采用定性和定量模型分析相结合的方法,从宏观经济、政策制度、技术进步和社会文化等多个角度出发,动态分析影响经济发展和企业盈利的关键性、趋势性因素,前瞻性发掘在中国崛起过程中所不断涌现出来的投资主题。

（2）主题配置

在主题发掘基础上,基金管理人将根据嘉实“企业投资价值评估体系”,对不同主题进行分析和评估,根据主题与企业的关联度,确定明确受惠于相关主题的企业,形成“主题企业群”,根据不同主题因素对企业 EPS 和企业价值的影响幅度,确定主题企业群的受益程度;根据企业群所涵盖的企业数目、市值等指标,确定主题企业群的市场容量;根据证券市场的情绪、主题企业群在证券市场近一个月的表现,确定主题企业群的市场反应速度。根据上述三个关键变量,确定“主题企业群”的配置权重。对于受益程度高、市场容量大、反应时间快的主题企业群,基金将加大配置力度。

（3）个股选择

本基金在个股选择层面,采用“研究驱动”的模式,基于基金管理人研究团队的独立研究,精选受益于相关主题的个股,并在此基础上构建股票投资组合。

个股选择的标准为:

●属于主题企业群,并且根据嘉实“企业投资价值评估体系”,从 EPS 增长、企业经济价值等指标评估看,受惠程度居“主题企业群”中前 1/2;;

●考虑到企业未来的成长性,未来一至三年企业的 EPS、EVA 等财务指标预计有较大幅度增长,从 PEG、PCF 等指标比较,目前的估值水平明显低估或者相对合理;

●根据上市公司股权结构、公司组织框架、信息透明度等角度定性分析,选择公司治理结构良好的上市公司;

●兼具有中长期成长性及中短期市场表现的催化剂。

3、债券投资组合构建

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。

（1）久期策略

在分析宏观经济指标（主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP 增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率）和财政货币政策等的基础上,对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测,决定组合的久期,并通过不同债券剩余期限的合理分布,有效地控制利率波动对基金净值波动的影响,并尽可能提高基金收益率。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析,预测收益率曲线的变化趋势,并据此进行投资组合的构建。收益率曲线策略有两方面的内容,一是收益率曲线本身的变化,根据收益率曲线可能向上移动或向下移动,降低或加长整个投资组合的平均剩余期限。二是根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征,通过骑乘策略,投资于最有投资价值的债券。

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）投资决策程序

1、主题研究与个股研究

研究员通过宏观研究、市场策略研究、定量研究和个股研究等手段,从宏观经济、政策制度、科技进步、社会文化等角度进行综合分析,为基金经理提供主题选择和主题企业群选择的建议。基金经理综合上述判断,确定投资主题和主题企业群,并上报投资决策委员会;

2、投资决策

在主题和主题企业群确定的基础上,基金经理根据“主题企业群”的市场容量、受益程度和市场反映速度,做出本基金的资产配置决策,包括对主题和主题企业群的资产配置以及债券和现金类资产的配置决策。研究员根据个券选择标准,提供个券选择建议。基金经理根据研究员的建议,完成组合构建,下达投资指令。

3、组合风险控制

组合控制员按照风险控制标准,对基金经理下达的投资指令进行事前审核。符合风险控制标准的指令将交由中央交易室执行。

4、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。

九、基金的业绩比较基准

沪深 300 指数增长率×95%＋同业存款收益率×5%

如果今后市场出现更具代表性的业绩比较基准,或更科学的复合指数权重比例,在与基金托管人协商一致后,本基金管理人可调整或变更业绩比较基准。

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007 年 1 月 18 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 12 月 31 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	7,303,165,886.75	83.20%
债券	220,080,480.00	2.51%
银行存款及清算备付金合计	1,196,060,327.94	13.62%
应收证券清算款	4,174,667.49	0.05%
权证		
其他资产	54,560,978.77	0.62%
合计	8,778,042,340.95	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	2,605,319.52	0.03%
B 采掘业	633,983,433.78	7.47%
C 制造业	1,879,899,638.65	22.12%
C0 食品、饮料	33,899,863.07	0.40%
C1 纺织、服装、皮毛	106,575,211.98	1.25%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	1,099,795.68	0.01%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	140,487,424.55	1.65%
C5 电子	26,664,428.88	0.31%
C6 金属、非金属	548,508,277.84	6.46%
C7 机械、设备、仪表	694,974,313.09	8.18%
C8 医药、生物制品	219,401,947.81	2.58%
C99 其他制造业	108,288,375.75	1.28%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	385,146,765.36	4.54%
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	1,174,740,361.23	13.83%
G 信息技术业	230,682,859.70	2.72%
H 批发和零售贸易	293,578,112.37	3.46%
I 金融、保险业	1,280,179,971.32	15.07%
J 房地产业	808,432,147.59	9.52%
K 社会服务业	595,597,188.77	7.01%
L 传播与文化产业	18,320,088.46	0.22%
M 综合类		
合计	7,303,165,886.75	85.99%

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	601111	中国国航	148,498,000	764,764,700.00	9.00%
2	600016	民生银行	62,773,324	640,287,904.80	7.54%
3	600036	招商银行	39,113,207	639,892,066.52	7.53%
4	600028	中国石化	68,675,842	626,323,679.04	7.37%
5	600690	青岛海尔	52,695,010	485,847,992.20	5.72%
6	000402	金 融 街	23,049,109	388,377,486.65	4.57%
7	600900	长江电力	39,421,368	385,146,765.36	4.54%
8	000069	华侨城 A	17,425,359	383,532,151.59	4.52%
9	600019	宝钢股份	32,999,808	285,778,337.28	3.37%
10	000002	万 科 A	16,999,782	262,476,634.08	3.09%

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		
金融债	220,080,480.00	2.59%
央行票据		
企业债		
可转换债券		
资产支持证券		
合计	220,080,480.00	2.59%

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	06进出 03	100,056,400.00	1.18%
2	06进出 05	99,971,300.00	1.18%
3	05国开 02	20,052,780.00	0.24%

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	1,022,299.95
应收利息	2,343,623.34
应收申购款	51,195,055.48
待摊费用	
合计	54,560,978.77

（4）持有的处于转股期的可转换债券明细:无

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2006 年 12 月 31 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. 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
基金合同生效之日至 2006 年 12 月 31 日	57.62%	1.22%	48.71%	1.28%	8.91%	－0.06%

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收益率的变动比较

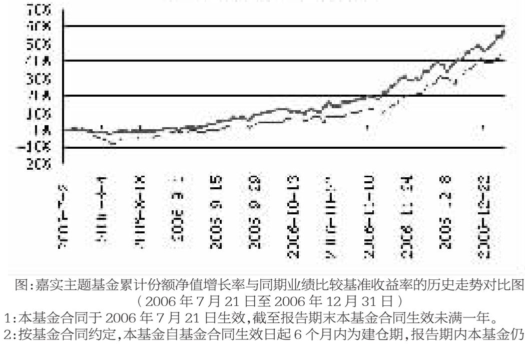

图:嘉实主题基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2006 年 7 月 21 日至 2006 年 12 月 31 日）

注 1:本基金合同于 2006 年 7 月 21 日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

注 2:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期,报告期内本基金仍处于建仓期。截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同第十四条（（二）投资范围、（八）2.投资组合比例限制）约定:

（1）资产配置范围为:股票资产 30%～95%,债券 0～70%,权证 0～3%,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的 5%;（2）持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的 10%;（3） 本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的 10%;（4）在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五;（5）持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的 3%;（6）法律法规和基金合同规定的其他限制。

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

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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从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

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

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十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

（3）与基金运作有关的其他费用

主要包括证券交易费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效以后的会计师费和律师费等。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,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,申购费用等于申购金额乘以所适用的申购费率。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。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＜50 万	1.5%
50万≤M＜200 万	1.2%
200万≤M＜500 万	0.8%
M≥500 万	单笔 1000 元

投资者通过本基金管理人网上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,赎回费用等于赎回金额乘以所适用的赎回费率。本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%,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 本基金与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、嘉实服务增值行业证券投资基金之间互相转换,本基金转入嘉实策略增长证券投资基金,转换费＝转出金额×转换费率,其中转换费率如下:

持有时间	转换费率
三个月以内	0.5%
三个月（含）以上	0

② 本基金转至嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金,转换费率为本基金的赎回费率（转换费的 25%计入本基金的基金资产）;嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金转入本基金,转换费率为本基金的申购费率。转换费＝转出金额×转换费率。

③ 嘉实策略增长证券投资基金转至本基金时,基金转换费率由申购费率补差和本基金赎回费率两部分构成,其中赎回费的 25%计入本基金的基金资产,具体收取情况视每次转换时两只基金的申购费率的差异情况而定。

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协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

（四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,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,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 2006 年 6 月 16 日首次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。

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:增加招商银行、上海浦东发展银行、深圳发展银行、兴业银行、华夏银行、山西证券、民生证券、西部证券、广州证券、国联证券 10 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:说明了基金合同生效以来的投资业绩。

7.在“二十六、其他应披露事项”部分:增加了自 2006 年 6 月 16 日首次公告招募说明书至 2007 年 1 月 21 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
2007 年 3 月 29 日