嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金

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：上海浦东发展银行股份有限公司

嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会于2004年9月27日《关于同意嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2004]151号)核准公开发售。本基金基金合同于2004年12月1日起正式生效。自基金合同生效之日起，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。

重要提示

（一）投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读招募说明书。

（二）基金的过往业绩并不预示其未来表现。

（三）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。

（四）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。

（五）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2007年5月31日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为2007年3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月在商盟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 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，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，法学硕士，中共党员。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、本基金基金经理

（1）现任基金经理

邹唯先生，硕士研究生，5年证券从业经历。曾任职于长城证券研究发展中心。2003年6月进入嘉实基金管理有限公司研究部工作，2006年8月3日至今任本基金基金经理。

（2）历任基金经理

2004年12月1日至2006年8月3日，邵点女士任本基金基金经理。

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，公司总经理助理王贵文先生、资深基金经理邵健先生、刘夫先生、刘麟先生。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：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：吉晓辉
成立时间：1992年10月19日
组织形式：股份有限公司
注册资本：43.5488亿元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[2003]105号
联系人：张轶美
联系电话：（021）61618888

上海浦东发展银行经过十年来的稳健经营和业务开拓，各项业务发展一直保持较快的增长，各项经营指标在新兴股份制商业银行中处于领先水平。截止到2006年12月31日，全行总资产规模已达6893.44亿元人民币，各项存款余额5964.88亿元人民币，各项贷款余额4608.93亿元人民币。2006年全年，实现净利润33.53亿元人民币，每股收益达0.77元。

上海浦东发展银行总行设资产托管部，资产托管部下设市场发展部、托管运作部、技术保障部、内控管理部四个职能部门，在深圳设立托管分部，现有员工23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）25870663
传真：（0755）25870663
联系人：钟俊杰

2.代销机构

（1）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
电话：（021）61618888
传真：（021）63602431
联系人：倪苏云、汤嘉惠
客服电话：95529
网址：www.spdb.com.cn

（2）交通银行
住所：上海市仙霞路18号
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：王玮
客户服务电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（3）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：（0591）62677777
传真：（0591）62569070
联系人：苏健
客户服务电话：95561
网址：www.cib.com.cn

（4）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)
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）北京银行
住所：北京市西城区复兴门内大街156号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街156号国际金融大厦D座
法定代表人：阎冰竹
联系电话：（010）66226044/66223251
联系人：李娟
开放式基金咨询电话：96169
开放式基金业务传真：（010）66226045
网址：www.hankobeijing.com.cn

（6）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
开放式基金业务传真：（010）65182261
开放式基金清算传真：（010）65183880
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）53285849
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）66568587，66568613
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：上海市浦东陆家嘴东路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
客户服务热线：（021）68419125
网址：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：张雪瑶、袁红彬
客户咨询电话：（025）84579897
网址：www.htsc.com.cn

（13）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

（14）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

（15）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

（16）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

（17）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

（18）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

（19）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：杨晋华
客户服务电话：（0371）7639999
网址：www.mszq.com

（20）光大证券有限责任公司
住所：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号上海证券大厦南塔14楼
法定代表人：王明权
电话：（021）68816000
传真：（021）68815009
联系人：刘晨
客户服务电话：（021）68823685
网址：www.ebsco.com

（21）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

（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）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179号
法定代表人：凤良志
电话：（0551）2634400－1112
传真：（0551）2634400－117
联系人：李蔡
客服电话：安徽地区96888；全国400－8888－777
网址：www.gyzq.com.cn

（24）广东证券股份有限公司（由安信证券有限责任公司承接）
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

（25）长江证券有限责任公司
住所、办公地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人：胡运钊
电话：（027）65799980（总机）
传真：（027）85481900
联系人：甘露
客户服务热线：（027）65799999
网址：www.cjzs315.com.cn

（26）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

（27）上海证券有限责任公司
住所、办公地址：上海市九江路111号
法定代表人：蒋元真
电话：（021）65076608－406
传真：（021）65213164
联系人：成竹娟 吕劲新
客户服务电话：8002200071
网址：www.962518.com

（28）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：史浩民
电话：（0532）5022026
传真：（0532）5022511
联系人：丁韶燕、陈向东
网址：www.zxwt.com.cn

（29）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

（30）财富证券有限责任公司
住所、办公地址：长沙市芙蓉中路2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

(31)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

（32）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

（33）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

（34）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

（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）68406772
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
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

（38）南京证券有限责任公司（含承接西北证券）
住所、办公地址：江苏省南京市大钟亭8号
法人代表人：张华东
联系电话：（025）83367888
传真：（025）83320066
联系人：胥春阳
网址：http://www.njzq.com.cn

（39）江西证券有限责任公司
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：上海市浦东新区福山路500号“城建国际中心”26楼
法定代表人：王军
电话：（021）68761616
传真：（021）68767880
联系人：罗芳
客服电话：（021）68761616
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：http://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：高冠江
电话：（010）62267799－6416
传真：（010）62294470
联系人：师敬泽
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

（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）83025696
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
开放式基金咨询电话：（0510）2831662，2588168
开放式基金业务传真：（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）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

（51）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

（52）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

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《关于暂停办理阿发证券、汉唐证券提交的基金申购业务的公告》，从周日起暂停办理阿发证券有限责任公司、汉唐证券有限责任公司提交的本基金申购业务。对于此前通过阿发证券、汉唐证券认购、申购的本基金份额，基金份额持有人仍可在阿发证券、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：国浩律师集团（北京）事务所
住所：北京市东城区建国门内大街贡院六号E座9层
负责人：王卫东
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：安永华明会计师事务所
住所：中国北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
法定代表人：葛明
电话：（010）65246688
传真：（010）85188298
联 系 人：张小东
经办注册会计师：张小东、李欣

（五）基金保证人

上海浦东发展银行股份有限公司（同上）

四、基金的名称

本基金名称：嘉实浦安保本混合型开放式证券投资基金

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

在保本期内，运用投资组合保险技术，力争在保本到期日，保证投资本金安全的同时，谋求基金资产的稳定增值。

在增强指数期内，本基金进行增强指数化投资，在保持对目标指数有效跟踪的基础上，力争收益达到并适度超越目标指数。

注：保本期是指本基金合同生效日（2004年12月1日）起满三个公历年；增强指数期是指从投资转型期（保本到期日的次日起为期30个工作日的时间段）结束的次日至基金合同终止之间的时间段。

七、基金的投资方向

在保本期内，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。

在增强指数期内，本基金主要投资于具有良好流动性的组成标的指数的成份股及其备选成份股，一级市场发行的新股，成份股的增发、配股以及其他增强投资的股票资产等。

八、基金的投资策略

（一）保本期投资策略

1.大类资产配置

本基金按照固定比例投资组合保险机制（CPPI）来动态调整股票、债券投资比例。

① 根据数量模型，确定基金的安全垫子；

② 根据安全垫子和放大倍数（小于等于3）确定股票投资比例上限，每一基金份额净值越大，股票投资比例上限越高；

③ 动态调整在股票和债券上的投资比例，确保股票实际投资比例不超过股票投资比例上限。

2.债券资产类

本基金债券投资对象主要集中在交易所和银行间两个债券市场，以追求本金安全为目的，通过持有相当数量的剩余期限小于或等于保本期限的国债和政策性金融债券，来规避利率、再投资等风险，以确保债券资产的稳定收益。

3.股票资产类

① 灵活配置、积极管理：注重股市趋势研究，发挥市场时机选择能力，充分分享股票市场的收益；同时通过选择流动性高、风险低、具有中长期上涨潜力的股票进行分散化组合投资，控制流动性风险和非系统性风险，保证股票组合的稳定性和收益性。

② 选择优势行业：重点关注已经或即将进入成长期但距离成熟期和衰退期较远的行业，辅之以“行业轮换”策略。

③ 选择优势企业：重点关注红利回报率高或动态市盈率低的个股。

④ 基于市场有效性研究，寻找套利机会。

（二）投资转型期投资策略

在基金保本到期日起的30个工作日内，为本基金的投资转型期。在该期间内，本基金只进行持有现金、逆回购等流动性资产。在投资转型期结束之后，本基金进入增强指数期。

（三）增强指数期投资策略

采用增强指数化投资方式，基本按照成份股在跟踪指数的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生变化时，股票投资组合及时做出相应调整。在投资组合建立后，基金经理定期检查本基金收益率与基准收益率的跟踪误差和相关系数，适当对投资组合进行调整，使跟踪误差和相关系数控制在限定的范围之内。在此基础上，对跟踪指数进行有效的偏离，以谋求超越跟踪指数。

1.资产配置比例

本基金股票资产不低于90%；现金资产比例控制在5%以内。

2.股票组合构建

A、以跟踪指数构成及其权重等指标为基础，通过基本复制基准指数的投资方法，构造指数化投资组合。

B、采用基本复制基准指数的方法，按照成份股在基准指数中的基准权重构建股票投资组合。

C、运用基本复制的指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，控制本基金的净值增长率与业绩基准指数增长率之间的年度累计跟踪误差小于3%，并保持两者之间的正相关系数大于95%，以分享中国股票市场的长期收益。

3.股票组合调整

A、定期调整

根据基准指数的调整规则和备选股票的预期，对股票投资组合的样本股及时进行调整。

B、不定期调整

（a）当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中的权重时，本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合。参与配售后，若组合内该成份股权重超过标的指数权重，将在增发新股上市后一个月内，将超出部分择机卖出；若组合内该成份股权重达不到指数权重，将及时从二级市场买入使之基本一致。

（b）根据法律、法规的规定，成份股在基准指数中的权重因其它原因发生相应变化的，本基金将做相应调整，以保持基金资产中该成份股的权重同指数基本一致。

4. 增强指数投资

利用宏观经济及政策分析、行业／板块分析、个股分析等，对跟踪指数进行有效偏离，具体做法为：

① 加大预期业绩优于指数的股票的投资；

② 降低预期业绩劣于指数的股票的投资；

③ 对于预期业绩与指数涨跌相一致的股票，按比例投资；

④ 建立数量模型以决定各股票的权重；

⑤ 持有指数中部分（不是全部）的股票品种；

⑥ 在适当的时机实现股票收益。

（四）投资管理程序

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小组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《基金合同》的规定，提出下一阶段本基金投资组合中大类资产的配置比例，制订基金在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所做的决议，参考本公司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，按照《基金合同》的规定对投资组合进行动态调整。

8、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做出调整。

九、基金的业绩比较基准

保本期：保本周期同期限的3年期银行定期存款税后收益率

增强指数期：中信标普300指数

十、基金的风险收益特征

在保本期内，本基金为证券投资基金中的低风险投资品种。

在增强指数期内，本基金运用基本复制的指数化投资方式，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，控制本基金净值增长率与业绩基准指数增长率之间的年度累计跟踪误差小于3%，并保持两者之间的正相关系数大于95%，以分享中国股票市场的长期收益。

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。

本基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年4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2007年3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	99,264,332.62	29.32%
债券	232,240,460.00	68.58%
权证		
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	1,023,254.59	0.30%
其他资产	6,091,919.86	1.80%
合计	338,619,967.07	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		
B 采掘业	6,840,536.80	2.04%
C 制造业	36,862,174.78	10.97%
C0 食品、饮料	8,154,061.60	2.43%
C1 纺织、服装、皮毛		
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	664,000.00	0.20%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	3,301,192.83	0.98%
C5 电子	1,009,600.00	0.30%
C6 金属、非金属	7,827,000.00	2.33%
C7 机械、设备、仪表	9,160,175.49	2.72%
C8 医药、生物制品	6,746,144.86	2.01%
C99 其他制造业		
D 电力、煤气及水的生产和供应业	4,172,500.08	1.24%
E 建筑业	476,500.00	0.14%
F 交通运输、仓储业	9,691,738.10	2.89%
G 信息技术业	6,159,937.68	1.83%
H 批发和零售贸易	16,827,142.06	5.01%
I 金融、保险业	11,333,763.12	3.37%
J 房地产业	1,758,540.00	0.52%
K 社会服务业	2,431,800.00	0.72%
L 传播与文化产业	2,099,300.00	0.63%
M 综合类	610,400.00	0.18%
合计	99,264,332.62	29.54%

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	339,980	9,097,864.80	2.71%
2	600019	宝钢股份	630,000	6,237,000.00	1.86%
3	600361	华联综超	260,000	5,470,400.00	1.63%
4	600036	招商银行	293,724	5,104,923.12	1.52%
5	000423	S阿 股	324,996	4,449,181.55	1.32%
6	600122	宏图高科	364,488	4,341,052.08	1.29%
7	600900	长江电力	319,977	4,172,500.08	1.24%
8	000568	泸州老窖	139,903	3,805,361.60	1.13%
9	600583	海油工程	100,000	3,427,000.00	1.02%
10	600028	中国石化	343,760	3,413,536.80	1.02%

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	81,659,960.00	24.30%
金融债	150,580,500.00	44.80%
央行票据		
企业债		
可转换债券		
资产支持证券		
合计	232,240,460.00	69.10%

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	债券代码	债券名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	040215	04国开15	55,363,000.00	16.47%
2	040302	04进出02	55,291,500.00	16.45%
3	010214	02国债(14)	55,236,500.00	16.44%
4	009905	99国债(5)	26,423,460.00	7.86%
5	050202	05国开02	20,020,000.00	5.96%

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