嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

更新招募说明书摘要

(2007 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

重要提示

(一)嘉实沪深 300 指数证券投资基金(以下简称"本基金或基金")经中国证券监督管理委员会于 2005 年 6 月 20 日《关于同意嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集的批复》(证监基金字 [2005]103 号)和《关于同意嘉实沪深 300 指数证券投资基金募集时间安排的函》(基金部函〔2005〕171 号)的批准公开募集。本基金基金合同于 2005 年 8 月 29 日起正式生效,自该日起本基金管理人正式开始管理本基金。

(二)本招募说明书是对原《嘉实沪深 300 指数证券投资基金招募说明书》的定期更新,原招募说明书与本招募说明书不一致的,以本招募说明书为准。基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

(三)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。

(四)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。

(五)基金的过往业绩并不预示其未来表现。

(六) 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 8 月 28 日(特别事项注明除外),已审计的有关财务数据和净值表现截止日为 2007 年 6 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 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,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,历任督察长和公司副总经理。

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

杨宇先生,经济学硕士,毕业于南开大学数学系和金融学系,具有 7 年证券从业经验。曾任平安证券有限责任公司资产管理部证券分析师、中国平安保险股份有限公司投资管理中心基金交易室主任、天同基金管理公司投资管理部部门经理,2003 年 3 月至 2004 年 7 月任万家(原天同)180 指数证券投资基金基金经理。2004 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司,2005 年 8 月至今任本基金基金经理。

杨宇先生对指数基金的投资管理、风险控制、指数化交易等方面具备丰富的投资管理经验。

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、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

(一)基金托管人基本情况

本基金之基金托管人为中国银行股份有限公司(简称"中国银行"),基本情况如下:

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:人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
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 90 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)柜台(场外)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 号震旦国际大厦 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
联系人:高越
网址:www.boc.cn
客户服务电话:95566

(2)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
电话:(010)66107900
传真:(010)66107914
联系人:田耕
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(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
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址: www.ccb.com

(4)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
传真:(021)58408842
联系人:王玮
客户服务电话 :95559
网址:www.bankcomm.com

(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)83195487,82090060
传真:(0755)83195049,83195050
联系人:朱虹、刘薇
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

(6)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
客户服务电话:95528
网址:www.spdb.com.cn

(7)深圳发展银行
住所、办公地址:深圳市深南中路 5047 号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)
客服热线:95501
电话:(0755)82088888—8811
传真:(0755)82080714
联系人:周 勤
网址:www.sdb.com.cn

(8)中国民生银行
住所:北京市东城区正义路 4 号
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
电话:(010)58351666
传真:(010)83914283
联系人:吴杰
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(9)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
电话:(010)65541585
传真:(010)65541230
联系人:秦莉
客户服务电话:95558
网址:www.ecitic.com

(10)深圳平安银行
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:黄立哲
电话:(0755)25859591
传真:(0755)25878304
联系人:霍兆龙
客户服务电话:40066－99999、(0755)961202
网址:www.18ebank.com

(11)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

(12)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

(13)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

(14)长江证券有限责任公司
住所:湖北省武汉市江汉区新华下路特 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

(15)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、(0431)5096710
传真:(0431)5680032
联系人:高新宇
网址: www.nesc.cn

(16)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:400–8888–506,(021)952506
网址:www.dfzq.com.cn

(17) 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

(18)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

(19)安信证券股份有限公司(承接原广东证券股份有限公司营业网点)
住所:深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元
办公地址:北京市西城区金融街 28 号盈泰中心 2 号楼 3 层(销售交易部)
法定代表人:牛冠兴
电话:(010)65778822
传真:(010)65778825
联系人:马正南
客服电话:(0755)82825555
网址:www.essences.com.cn

(20)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

(21)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

(22)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

(23)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

(24)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

(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
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

(26)华西证券有限责任公司
住所:四川省成都市陕西路 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
客服电话:4008–888–818
网址:www.hx168.com.cn

(27)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

(28)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

(29)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

(30)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

(31)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

(32)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,www.eestart.com

(33)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

(34)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:肖时庆
电话:(010)66568587、66568613
传真:(010)66568536
联系人:郭京华
网址:www.chinastock.com.cn

(35)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 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

(36)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

(37)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)5022026
传真:(0532)5022511
联系人:陈向东、丁韶燕
网址:www.zxwt.com.cn

(38)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
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

(39)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

(40)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

(41)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: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: www.glsc.com.cn

(42)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

(43)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
电话:(0755)82492000
传真:(0755)82492962
联系人:盛宗凌
客户服务中心咨询电话: 4008888555、(0755)25125666
网址:www.lhzq.com

(44)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

(45)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:www.scstock.com

(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)87419999
网址:www.westsecu.com.cn

(47)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
电子信箱:mail@tebon.com.cn

(48)中信金通证券有限责任公司
住所、办公地址:浙江省杭州市中河南路 11 号万凯商务楼 A 座
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

(49)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

(50)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

(51)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)83025666
传真:(0755)83025625
联系人:金春
客服电话:4008–888–228
网址:www.jyzq.cn

(52)光大证券股份有限公司
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:唐双宁
电话:021–68816000
传真:021–68815009
联系人:刘晨
客服热线:021–68823685
网址:www.ebscn.com

(53)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:www.njzq.com.cn

(二)深圳证券交易所(场内)基金份额发售机构

场内基金份额发售机构为深圳证券交易所会员单位,即具有基金代销业务资格的证券公司:

国泰君安证券、国信证券、招商证券、中信证券、海通证券、联合证券、申银万国证券、长江证券、渤海证券、华泰证券、中信万通证券、东吴证券、长城证券、光大证券、南京证券、上海证券、东莞证券、中原证券、东海证券、中银国际证券、广发证券、银河证券、中信建投证券(原华夏证券)、北京证券、湘财证券、西部证券、大同证券、德邦证券、万联证券、国海证券、国都证券、华林证券、中金公司、广发华福证券、金元证券、信泰证券、国联证券、恒泰证券、国盛证券、金信证券、江南证券、天和证券、兴业证券、平安证券、华西证券、西南证券、山西证券、齐鲁证券、世纪证券、广州证券、华安证券、国元证券、东方证券、东北证券、新时代证券、第一创业证券、民生证券、财富证券、天一证券、宏源证券、泰阳证券、金通证券、西北证券、华龙证券。

(三)注册登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
注册地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907
联系人:朱立元

(四)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:北京市东城区建内大街贡院西街六号 E 座 9 层
负责人:王卫东
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

(五)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:魏珣
经办注册会计师:汪棣 魏珣

四、基金的名称

本基金名称:嘉实沪深 300 指数证券投资基金(LOF)

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

本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%,以实现对沪深 300 指数的有效跟踪,谋求通过中国证券市场来分享中国经济持续、稳定、快速发展的成果。

七、基金的投资方向

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深 300 指数的成份股及其备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发),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 5%。

此外,本基金还可以投资于经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具,待指数衍生金融产品推出以后,本基金可以运用衍生金融产品进行风险管理。

八、基金的投资策略

本基金为被动式指数基金,原则上采用指数复制法,按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金经理会对投资组合进行适当调整,以使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金建仓期为 3 个月,3 个月之后本基金投资组合将达到基金合同的相关规定。

1、资产配置比例

本基金原则上将不低于 90%的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股,其中备选成份股投资比例不高于 15%,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 5%。本基金将根据市场的实际情况,适当调整基金资产的配置比例,以保证对标的指数的有效跟踪。

2、股票组合构建

(1)股票投资原则

本基金原则上通过指数复制法进行被动式指数化投资,根据沪深 300 指数成份股的基准权重构造股票指数化投资组合。

(2)股票组合构建方法

本基金原则上采用指数复制法,按照成份股在沪深 300 指数中的基准权重构建股票投资组合。如有(a)因受股票停牌的限制、股票流动性等其他市场因素,使基金管理人无法依指数权重购买某成份股,或(b)预期标的指数的成份股即将调整,或(c)其他影响指数复制的因素,基金经理可以根据市场情况,结合经验判断,对本基金资产进行适当调整,以期在规定的风险承受限度之内,获得更接近标的指数的收益率。

(3)风险收益目标

本基金运用指数复制法进行被动式指数化投资,在日常管理过程中,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩衡量基准之间的日平均跟踪误差小于 0.3%,以实现对标的指数的有效跟踪,分享中国股票市场的长期收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金以沪深 300 指数为标的指数,业绩衡量基准为 95%的沪深 300 指数增长率加 5%的银行同业存款收益率。

十、基金的风险收益特征

风险中等,获得证券市场平均收益率。

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 2007 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 2007 年 6 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	13,425,088,581.42	89.54%
债券	595,103,103.87	3.97%
权证	13,856,383.60	0.09%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	810,565,254.19	5.41%
其他资产	148,123,414.35	0.99%
合计	14,992,736,737.43	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	61,944,150.70	0.44%
B 采掘业	623,187,422.36	4.39%
C 制造业	4,972,535,630.87	35.04%
C0 食品、饮料	628,531,010.46	4.43%
C1 纺织、服装、皮毛	204,589,540.21	1.44%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	62,738,289.19	0.44%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	474,859,810.92	3.34%
C5 电子	135,621,329.67	0.96%
C6 金属、非金属	1,836,485,462.10	12.94%
C7 机械、设备、仪表	1,295,890,708.59	9.14%
C8 医药、生物制品	265,652,196.43	1.87%
C99 其他制造业	68,167,283.30	0.48%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	839,491,403.04	5.92%
E 建筑业	152,904,740.58	1.08%
F 交通运输、仓储业	1,100,927,987.51	7.76%
G 信息技术业	612,586,443.01	4.32%
H 批发和零售贸易	551,087,385.25	3.88%
I 金融、保险业	2,781,746,074.61	19.62%
J 房地产业	875,640,538.52	6.17%
K 社会服务业	274,508,095.56	1.93%
L 传播与文化产业	85,616,441.12	0.60%
M 综合类	492,912,268.29	3.47%
合计	13,425,088,581.42	94.62%

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	招商银行	20,707,722	508,995,806.76	3.59%
2	600000	浦发银行	12,287,784	449,610,016.56	3.17%
3	600030	中信证券	7,309,432	387,180,613.04	2.73%
4	000002	万 科 A	20,220,353	386,613,149.36	2.72%
5	600016	民生银行	29,871,524	341,431,519.32	2.41%
6	600900	长江电力	16,598,276	250,965,933.12	1.77%
7	601318	中国平安	3,404,241	243,437,273.91	1.72%
8	600019	宝钢股份	18,529,507	203,824,577.00	1.44%
9	600519	贵州茅台	1,664,389	199,194,075.52	1.40%
10	600050	中国联通	29,904,300	175,538,241.00	1.24%

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	497,950,569.62	3.51%
央行票据	97,152,534.25	0.68%
企业债		
可转换债券		
资产支持证券		
合计	595,103,103.87	4.19%

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	债券简称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	060408	06农发 08	199,928,000.00	1.41%
2	0701009	07央行票据 09	97,152,534.25	0.68%
3	070301	07进出 01	88,055,969.62	0.62%
4	060305	06进出 05	79,970,640.00	0.56%
5	000213	00国开 13	50,101,950.00	0.35%

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

序号	权证代码	权证简称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	031003	深发 SFC1	8,973,220.56	0.06%
2	031004	深发 SFC2	4,883,163.04	0.03%

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	3,679,513.66
应收证券交易清算款	91,457,363.11
应收利息	11,574,554.23
应收股利	6,792,789.72
应收申购款	34,619,193.63
待摊费用	
合计	148,123,414.35

(4)持有的处于转股期的可转换债券明细:无

(5)报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	031003	深发 SFC1	588,794	0	被动持有
2	031004	深发 SFC2	294,397	0	被动持有
3	580989	南航 JTP1	6,369,012	0	被动持有

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2007 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基金的招募说明书。

(一)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
2005年 8 月 29 日基金合同生效日至 2005 年 12 月 31 日	–1.90%	0.82%	–0.48%	0.89%	–1.42%	–0.07%
2006年度	120.19%	1.32%	112.79%	1.33%	7.40%	–0.01%
2007年上半年	68.51%	2.40%	79.24%	2.38%	–10.73%	0.02%

(二)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

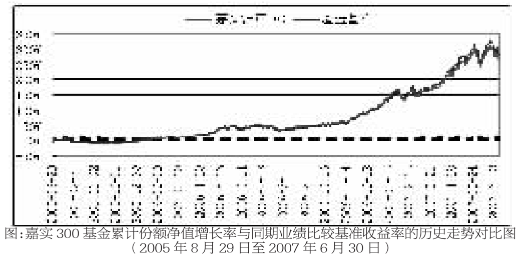

图:嘉实 300 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005 年 8 月 29 日至 2007 年 6 月 30 日)

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效起 3 个月内为建仓期。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同第十七条((二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制)的规定:

(1)基金财产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(2)原则上将不低于 90%的基金资产净值投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股,其中备选成份股投资比例不高于 15%,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 5%。

(3)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。

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

本基金管理费年费率为 0.5%,在通常情况下按前一日的基金资产净值乘以相应的管理年费率,计算方法:H＝E×0.5%÷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。

基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从本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

本基金托管费年费率为 0.1%,在通常情况下,按前一日的基金资产净值乘以相应的托管年费率,计算方法:H＝E×0.1%÷当年天数

H:为每日应支付的基金托管费;

E:为前一日的基金资产净值。

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

(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、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费等。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。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费

本基金的申购费率不高于 1.5%,随申购金额的增加而递减:

申购金额(M,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	1.0%
M≥500 万	按笔收取,1000 元 / 笔

投资者通过本基金管理人及相关代销机构的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

持有期限	赎回费率
持有期＜一年	0.5%
一年≤持有期＜两年	0.25%
持有期≥两年	0

本基金收取的赎回费中 25%的部分归入基金财产。

(3)转换费

本基金将在未来开放与基金管理人管理的其他基金之间的基金份额的转换,届时基金管理人将会同基金托管人制定基金的转换费收取水平并予公告。

(4)销售服务费,具体计提办法按中国证监会的规定执行。

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,从当期基金财产中支付。

(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本基金财产的损失,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降低基金管理费、基金托管费,下调前述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 3 个工作日在至少一种指定报刊和网站上刊登公告。

(四)基金的税收

本基金运作过程中的各类纳税主体,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,对基金管理人于 2005 年 7 月 2 日刊登的本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金合同生效日后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新。

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:更新了托管人的相关信息。

4.在"五、相关服务机构"部分:增加中国工商银行、中国建设银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、深圳平安银行为本基金代销机构,并更新相关代销机构信息。

5.在"十三、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"十四、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"二十七、其他应披露事项"部分:列表说明自 2007 年 2 月 28 日至 2007 年 8 月 28 日本基金的相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2007 年 11 月 6 日