嘉实沪深300指数证券投资基金(LOF)

更新招募说明书摘要

(2008年第1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)本招募说明书是对照《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2008年2月29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	中诚信托有限责任公司40%,立信投资有限责任公司30%,德意志资产管理(亚洲)有限公司30%。
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,中煤信托有限责任公司董事长兼总经理,2002年3月至今任中诚信托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月在外经贸部中国机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 Fornen 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。1996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月于中国银行海外分管理部任副处长。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。

李道蔑先生,副总经理,中共党员,法学博士,经济师。1983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,公司总经理助理戴京焕女士,公司总经理助理邵健先生、固定收益部总监刘嘉先生。

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:

办公及住所地址: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:董杰

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)25870666

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:成都市人民南路一段86号城市之心30H嘉实基金

电话:(028)86202100

传真:(028)86202100

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)66596688

传真:(010)66593777

客户服务电话:95566

网址:www.boc.cn

(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号楼长安兴融中心

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:曹彬

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)中国农业银行

住所、办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:项俊波

电话:(010)85109219

传真:(010)85109219

联系人:蒋浩

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

(6)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)83198888

传真:(0755)83196049

联系人:万丽

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(7)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:;徐伟、虞谷云、汤嘉惠

客户服务电话:95528

网址:www.spdb.com.cn

(8)深圳发展银行

住所、办公地址:深圳市深南东路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

传真:(0755)82080714

联系人:周 勤

客服热线:95501

网址:www.sdb.com.cn

(9)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:李群

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(10)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:潘玲

客户服务电话:95561

网址:www.cib.com.cn

(11)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:秦超

客户服务电话:95558

网址:www.ecitic.com

(12)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)25835939

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

(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)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

(15)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

(16)长江证券股份有限公司

住所、办公地址:湖北省武汉市江汉区新华下路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

电话:(021)63219781

传真:(021)51062920

联系人:李良

客户服务热线:4008-888-999或(027)85808318

网址:www.cjsc.com、www.95579.com

(17)东北证券股份有限公司

住所、办公地址:长春市人民大街1138号

法定代表人:李树

电话:(0431)85096709

传真:(0431)85680032

联系人:高新宇

客户服务电话:(0431)966880

网址:www.nesc.cn

(18)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)63326173

联系人:吴宇

客户服务电话:400-8888-506,(021)952506

网址:www.dfzq.com.cn

(19)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:朱科敏

电话:(021)50586660

传真:(021)50586660-8880

联系人:邵一明

客户服务热线:400-888-8588

网址:www.longone.com.cn

(20)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

(21)安信证券股份有限公司

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.essence.com.cn

(22)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

(23)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)6285537

传真电话:(0791)6289395

联系人:徐美云

网址:www.gsstock.com

(24)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:内敏祺

客户服务热线:4008888666

网址:www.gtja.com

(25)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:齐晓燕

客户服务电话:800-810-8868

网址:www.guosen.com.cn

(26)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:金莹

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

(27)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

(28)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:张恒峰

电话:(0755)83025046

传真:(0755)83025991

联系人:张有德

客服电话:4008-888-818

网址:www.hx168.com.cn

(29)浙商证券有限责任公司

住所、办公地址:浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A座6-7楼

法定代表人:吴承根

电话:(0571)87901963

传真:(0571)87902061

联系人:吴颖

客户服务电话:(0571)87902079

网址:www.stocke.com

(30)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)85252656

传真:(010)85252655

联系人:赵明

客户服务电话:400-619-8888

网址:www.mszq.com

(31)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:余江

全国统一客户服务热线:95511

网址:www.pa18.com

(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

(33)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

(34)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

开放式基金客服电话:(021)68634818-8631

网址:www.xcsc.com。

(35)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:易勇

客户服务热线:(021)68419125

网址:www.xyzq.com.cn

(36)中国银河证券股份有限公司

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)66568047

传真:(010)66568536

联系人:李洋

客户服务热线:400-888-8888

网址:www.chinastock.com.cn

(37)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

(38)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)84683893

传真:(010)84865560

联系人:陈忠

网址:www.ecitic.com

(39)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

网址:www.zxwt.com.cn

(40)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

(41)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

(42)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:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层

法定代表人:王少华

全国免费业务咨询电话:800-810-8809

开放式基金业务传真:(010)64482090

联系人:马泽承

客户服务电话:8008108809

网址:www.guodu.com

(43)国联证券有限责任公司

住所:江苏省无锡市县前东街168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)82588168

开放式基金业务传真:(0510)82880162

网址:www.glsc.com.cn

(44)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)2207938

传真:(0551)2207935

联系人:祝丽萍

客服电话:安徽地区:96888;全国:400-8888-777

网址:www.gyzq.com.cn

(45)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

(46)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

(47)华泰证券股份有限公司

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:程高峰

客户咨询电话:(025)84579897

网址:www.htsc.com.cn

(48)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:(0791)6768763

传真:(0791)6789414

联系人:余雅娜

客户服务电话:(0791)6768763

网址:www.scstock.com

(49)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:刘春茂

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

(50)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

(51)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:刘军

开放式基金咨询电话:(0571)96598

开放式基金业务传真:(0571)85783771

联系人:王勤

联系电话:(0571)85783715

网址:www.bigsun.com.cn

(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)87322668

传真:(020)87325036

联 系 人:樊刚正

客户服务热线:(020)961303

网址:www.gzs.com.cn

(53)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

(54)金元证券有限责任公司

住所:海南省省海口市南宝路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:陆涛

电话:(0755)83025695

传真:(0755)83025625

联系人:金春

客服电话:4008-888-228

网址:www.jyzq.cn

(55)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:薛双宁

电话:(021)68816000

传真:(021)68815009

联系人:刘晨

客服热线:(021)68823685

网址:www.ebscn.com

(56)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:张华东

联系电话:(025)83367888

传真:(025)83320066

联系人:蒋春阳

网址:www.njzq.com.cn

(57)中原证券股份有限公司

住所:许昌市南关大街38号

办公地址:郑州市经三路15号广汇国贸11楼

法定代表人:宫龙云

开放式基金咨询电话:(0371)967218

开放式基金业务传真:(0371)65585670

联系人:陈利民 程月艳

联系电话:(0371)65585670

网址:www.ccnew.com,www.zyzq.cn

(58)华龙证券有限责任公司

住所、办公地址:甘肃省兰州市静宁路308号

法定代表人:李晓安

电话:(0931)8888088

传真:(0931)4890515

联系人:陈郦

客户服务热线:(0931)4890619,4890618,4890100

网址:www.hlzqgs.com

(59)新时代证券有限责任公司

住所、办公地址:北京市西城区月坛北街2号月坛大厦15层

法定代表人:马金声

电话:(010)68084591

传真:(010)68084986

联系人:臧庆

客户服务热线:(010)68084591

网址:www.xsdzq.cn

(60)上海证券有限责任公司

住所、办公地址:上海市九江路111号上海市临平北路19号

法定代表人:蒋元真

电话:(021)65076608

传真:(021)65217206

联系人:谢秀峰

客户服务热线:(021)962518

网址:www.962518.com

(61)东莞证券有限责任公司

住所、办公地址:东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人:陈就明

电话:(0769)22119423

传真:(0769)22119423

联系人:张建平

客户服务热线:961130

网址:www.dgzq.com.cn

(62)万联证券有限责任公司

住所:广州市东山区东风东路836号东峻广场34-35层

办公地址:广州市中山二路18号广东电信广场37层

法定代表人:李舫金

电话:(020)37865026

传真:(020)37865008

联系人:李俊

客户服务热线:(020)37865009

网址:www.wlzq.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、中银万国证券、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、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:陈宇

经办注册会计师:许康玮 陈宇

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2008年1月16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12月31日("报告期末"),本报告所列财务数据未经审计。本节"报告期"是指2007年10月1日起至2007年12月31日止。

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	36,964,474,405.58	93.34%
债券	923,028,000.00	2.33%
权证	280,851,083.18	0.71%
银行存款及清算备付金合计	1,104,783,673.23	2.79%
其他资产	326,985,869.73	0.83%
合计	39,600,123,031.72	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	165,733,896.62	0.42%
B 采掘业	4,390,797,483.71	11.16%
C 制造业	11,548,103,984.60	29.35%
C0 食品、饮料	1,298,438,146.65	3.30%
C1 纺织、服装、皮毛	298,296,749.36	0.76%
C2 木材、家具	27,297,680.25	0.07%
C3 造纸、印刷	160,573,849.19	0.41%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	944,425,188.59	2.40%
C5 电子	154,472,012.00	0.39%
C6 金属、非金属	4,914,528,660.63	12.49%
C7 机械、设备、仪表	3,181,780,098.57	8.09%
C8 医药、生物制品	406,751,254.85	1.03%
C99 其他制造业	161,540,344.51	0.41%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	2,054,721,716.43	5.22%
E 建筑业	312,832,523.09	0.80%
F 交通运输、仓储业	3,543,574,669.47	9.01%
G 信息技术业	1,440,931,278.94	3.66%
H 批发和零售贸易	1,296,427,703.77	3.30%
I 金融、保险业	8,259,041,332.39	20.99%
J 房地产业	2,206,692,457.14	5.61%
K 社会服务业	689,215,970.30	1.75%
L 传播与文化产业	168,378,197.04	0.43%
M 综合类	893,023,192.08	2.26%
合计	36,964,474,405.58	93.96%

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	600028	中国石化	75,917,685	1,778,751,359.55	4.52%
2	600030	中信证券	17,997,565	1,606,642,627.55	4.08%
3	600000	浦发银行	23,619,327	1,247,100,465.60	3.17%
4	600036	招商银行	31,064,053	1,231,068,420.39	3.13%
5	600016	民生银行	78,603,412	1,164,902,565.84	2.96%
6	000002	万 科 A	32,844,813	947,244,406.92	2.41%
7	600050	中国联通	57,535,564	695,029,613.12	1.77%
8	600019	宝钢股份	38,027,356	663,197,088.64	1.69%
9	600900	长江电力	30,657,526	597,515,181.74	1.52%
10	600519	贵州茅台	2,561,895	589,235,850.00	1.50%

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	9,747,000.00	0.03%
央行票据	913,281,000.00	2.32%
企业债		
可转换债券		
资产支持证券		
其他		
合计	923,028,000.00	2.35%

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	0701004	07央行票据04	194,560,000.00	0.49%
2	0701018	07央行票据18	194,300,000.00	0.49%
3	0701028	07央行票据28	194,000,000.00	0.49%
4	0701015	07央行票据15	145,815,000.00	0.37%
5	0701009	07央行票据09	97,270,000.00	0.25%

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	数量(份)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	5,899,861	280,851,083.18	0.71%

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