



# 嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金 联接基金更新招募说明书摘要

(2012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

嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金或基金”)根据2011年6月9日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》(证监许可[2011]906号)核准进行募集。本基金基金合同于2011年8月1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。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。但不保证基金一定盈利,也不向投资者保证最低收益。

本摘要所载内容截止日为2012年2月1日,有关财务数据和净值表现(未经审计)截止日为2011年12月31日(特别事项注明截止日除外)。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况



## 1.基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期23楼01-03单元
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	安奎
总经理	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
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) 65215588
传真	(010) 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

嘉实基金管理有限公司无任何受处罚记录。

## (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

安奎先生，董事长，大学本科，中共党员，曾任吉林农业机械研究所主任；吉林省信托投资公司外经处处长、香港吉信有限公司总经理；吉林省证券公司总经理；东北证券有限责任公司监事长；吉林天信投资公司总经理；中诚信托有限责任公司副总经理。2011年8月5日起任嘉实基金管理有限公司董事长。

赵学军先生，董事、总经理。中共党员，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商鼎期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至今任嘉实基金管理有限公司董事、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，硕士研究生。1990年至今任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今任立信投资有限责任公司董事长。

高方先生，董事，大学本科，中共党员，高级经济师。曾任中国建设银行总行副处长，外企服务总公司宏银实业公司副总经理。1996年9月至今历任中诚信托有限责任公司总裁助

理、副总裁，现任中诚信托有限责任公司副总裁。

**Wolfgang Matis** 先生，董事，德国籍，法兰克福商学校经济专业（**Frankfurt Business School of Economics**）。曾任德意志银行全球固定收益负责人、全球市场负责人，董事总经理（**MD**）。现任德意志资产管理公司(法兰克福)董事会成员、**CEO**兼发言人。

**Mark Cullen** 先生，董事，澳大利亚籍，澳大利亚莫纳什大学经济政治专业学士。曾任达灵顿商品(**Darlington Commodities**)商品交易主管，贝恩(**Bain&Company**)期货与商品部负责人，德意志银行（纽约）全球股票投资部首席运营官、**MD**。现任德意志资产管理（纽约）全球首席运营官、**MD**。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士。1998 年9 月至2000 年6 月在北京大学法学学科从事博士后研究工作，2000 年7 月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。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

张维炯先生，独立董事、中共党员，教授、加拿大不列颠哥伦比亚大学商学院博士。曾任上海交通大学动力机械工程系教师，上海交通大学管理学院副教授、副院长。1997年至今任中欧国际工商学院教授、副院长。

朱蕾女士，监事，中共党员，硕士研究生。曾任首都医科大学教师，中国保险监督管理委员会主任科员，国都证券有限责任公司高级经理，中欧基金管理有限公司发展战略官、北京代表处首席代表、董事会秘书。2007年10月至今任中诚信托有限责任公司国际业务部总经理。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

王利刚先生，监事，经济学学士。2001年2月至今，就职于嘉实基金管理有限公司综合管理部、人力资源部，历任人力资源部副总监、总监。

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。

戴京焦女士，副总经理，武汉大学经济学硕士，加拿大大不列颠哥伦比亚大学MBA。历任平安证券投资银行部总经理、平安保险集团公司资产管理部副总经理兼负责人；平安证券公司助理总经理，平安集团投资审批委员会委员。2004年3月加盟嘉实基金管理有限公司曾任公司总经理助理，现任公司副总经理。

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

### (1) 现任基金经理

杨阳先生，中国科学技术大学学士，宾夕法尼亚州立大学硕士，10年证券从业经验，具有基金从业资格。2000年至2003年任贝尔斯登高级工程师，2003至2005年任HBK投资公司高级工程师/交易操盘手，2005至2006年任Citadel投资集团高级数量分析师，2006年至2008年任高盛集团高级数量分析师，2008年3月加入嘉实基金管理有限公司担任高级数量分析师，2009年12月30日至今任嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金(LOF)基金经理职务。2011年8月1日至今任嘉实深证基本面120ETF基金经理，2011年8月4日至今任嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)基金经理，2011年8月1日至今任本基金基金经理。

### (2) 历任基金经理：无。

## 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，公司副总经理戴京焦女士，总经理助理邵健先生、总经理助理詹凌蔚先生、总经理助理陶荣辉先生、股票投资部总监刘天君先生、机构投资部总监党开宇女士、资深基金经理陈勤先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

变更注册登记日期：2004 年 8 月 26 日

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

法定代表人：肖 钢

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理：董杰

托管部门联系人：唐州徽

电话：（010）66594855

传真：（010）66594942

发展概况：

中国银行于 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，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，下设覆盖集合类产品、机构类产品、全球托管产品、投资分析及监督服务、风险管理与内控、核算估值、信息技术、资金和证券交收等各层面的多个团队，现有员工 110 余人，其中，90%以上的员工具备本科以上学历。另外，中国银行在重点分行已开展托管业务。

目前，中国银行拥有证券投资基金、一对多专户、一对一专户、社保基金、保险资产、QFII 资产、QDII 资产、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、信托资产、年金资产、理财产品、海外人民币基金、私募基金等门类齐全的托管产品体系。在国内，中国银行率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管服务。2010 年末中国银行在中国内地托管的资产突破万亿元，居同业前列。

## 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直销中心

办公地址	北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层		
电话	(010) 65215588	传真	(010) 65180615
联系人	赵虹		

## (2) 嘉实基金管理有限公司上海直销中心

办公地址	上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 23 楼 01-03 单元		
电话	(021) 38789658	传真	(021) 68880023
联系人	吴冬梅		

## (3) 嘉实基金管理有限公司成都分公司

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		

## (4) 嘉实基金管理有限公司深圳分公司

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	周炜		

## (5) 嘉实基金管理有限公司青岛分公司

办公地址	青岛市市南区香港中路 10 号颐和国际大厦 A 座 3502 室		
电话	(0532) 66777766	传真	(0532) 66777676
联系人	曹涌		

## (6) 嘉实基金管理有限公司杭州分公司

办公地址	杭州市西湖区杭大路 15 号嘉华国际商务中心 313 室		
电话	(0571) 87759328	传真	(0571) 87759331
联系人	徐莉莉		

## (7) 嘉实基金管理有限公司福州分公司

办公地址	福州市鼓楼区五四路 158 号环球广场 25 层 04 单元		
电话	(0591) 88013673	传真	(0591) 88013670
联系人	吴冬梅		

## (8) 嘉实基金管理有限公司南京分公司

办公地址	南京市白下区中山东路 288 号新世纪广场 A 座 4202 室		
电话	(025) 66671118	传真	(025) 66671100
联系人	施镜葵		

## (9) 嘉实基金管理有限公司广州分公司

办公地址	广州市天河区天河北路 183 号大都会广场 2415-2416 室		
电话	(020) 87555163	传真	(020) 81552120
联系人	庄文胜		

**2. 代销机构**

## (1) 中国银行股份有限公司

注册地址	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) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	95566

## (2) 中国工商银行股份有限公司

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	联系人	刘业伟
电话	95588	传真	(010) 66107914
网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588

## (3) 中国农业银行股份有限公司

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	联系人	滕涛
电话	(010) 85108227	传真	(010) 85109219
网址	www.abchina.com	客服电话	95599

## (4) 中国民生银行股份有限公司

住所、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	联系人	董云巍
电话	(010) 58560666	传真	(010) 57092611
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

## (5) 华夏银行股份有限公司

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	吴建	联系人	郑鹏
电话	010-85238667	传真	010-85238680
网址	www.hxb.com.cn	客服电话	95577

## (6) 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	肖遂宁	联系人	张青
电话	(0755) 82088888	传真	(0755) 82080406
网址	www.sdb.com.cn	客服电话	95501

## (7) 宁波银行股份有限公司

住所、办公地址	宁波市鄞州区宁南南路 700 号		
法定代表人	郭少泉	联系人	于庆君
电话	(0574) 89068340	传真	(0574) 87050024
网址	www.nbcb.com.cn	客服电话	96528, 962528

## (8) 青岛银行股份有限公司

住所、办公地址	青岛市市南区香港中路 68 号华普大厦		
法定代表人	郭少泉	联系人	于庆君
电话	68602127	传真	85709799
客服电话	96588 (青岛)、4006696588 (全国)		
网址	www.qdccb.com		



## (9) 东莞银行股份有限公司

住所、办公地址	东莞市城区运河东一路 193 号		
法定代表人	廖玉林	联系人	巫渝峰
电话	(0769) 22100193	传真	(0769) 22117730
客服电话	(0769) 96228		
网址	www.dongguanbank.cn		

## (10) 徽商银行股份有限公司

住所、办公地址	安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座		
法定代表人	王晓昕	联系人	叶卓伟
电话	(0551) 2667635	传真	(0551) 2667684
客服电话	4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)		
网址	www.hsbank.com.cn		

## (11) 临商银行股份有限公司

住所、办公地址	山东省临沂市沂蒙路 336 号		
法定代表人	王傢玉	联系人	寇廷柱
电话	(0539)8304657	传真	(0539)8051127
客服电话	400-699-6588	网址	www.lsbchina.com

## (12) 杭州银行股份有限公司

住所、办公地址	杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦		
法定代表人	吴太普	联系人	严峻
电话	(0571) 85108309	传真	(0571) 85108309
客服电话	400-888-8508	网址	www.hzbank.com.cn

## (13) 温州银行股份有限公司

住所	温州市车站大道华海广场 1 号楼		
办公地址	温州市车站大道 196 号		
法定代表人	邢增福	联系人	林波
电话	(0577) 88990082	传真	(0577) 88995217
客服电话	(0577) 96699	网址	www.wzbank.cn

## (14) 上海农村商业银行股份有限公司

住所	上海市浦东新区浦东大道 981 号		
办公地址	上海市银城中路 8 号中融碧玉蓝天大厦 15 层		
法定代表人	胡平西	联系人	吴海平
电话	(021) 38576977	传真	(021) 50105124
客服电话	(021) 962999	网址	www.srcb.com

## (15) 乌鲁木齐商业银行股份有限公司

住所	乌鲁木齐市新华北路 8 号		
办公地址	乌鲁木齐市新华北路 8 号商业银行大厦		
法定代表人	农惠臣	联系人	何佳
电话	(0991) 8824667	传真	(0991) 8824667





网址	www.uccb.com.cn	客服电话	(0991) 96518
----	-----------------	------	--------------

## (16) 渤海银行股份有限公司

住所、办公地址	天津市河西区马场道 201-205 号		
法定代表人	刘宝凤	联系人	王宏
电话	(022) 58316666	传真	(022) 58316569
网址	www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811

## (17) 洛阳银行股份有限公司

住所、办公地址	洛阳市洛龙区开元大道 256 号		
法定代表人	王建甫	联系人	胡艳丽
电话	(0379) 65921977	传真	(0379) 65920155
网址	www.bankofluoyang.com.cn	客服电话	(0379) 96699

## (18) 深圳农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址	广东省深圳市罗湖区深南东路 3038 号合作金融大厦		
法定代表人	李伟	联系人	宋永成
电话	(0755) 25188064、 (0755) 25188263	传真	(0755) 25188785
网址	www.961200.net www.4001961200.net	客服电话	4001961200

## (19) 北京农村商业银行股份有限公司

住所	北京市西城区阜成门内大街 410 号		
办公地址	北京市西城区金融大街 9 号金融街中心 B 座		
法定代表人	乔瑞	联系人	王薇娜
电话	(010) 63229475	传真	(010) 63229478
网址	www.bjrcb.com	客服电话	96198

## (20) 烟台银行股份有限公司

住所、办公地址	山东省烟台市芝罘区海港路 25 号		
法定代表人	庄永辉	联系人	姚华
电话	(0535) 6691337	传真	(0535) 6699884
网址	www.yantaibank.net	客服电话	4008-311-777

## (21) 浙江稠州商业银行股份有限公司

住所地址	浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧		
法定代表人	金子军	联系人	董晓岚、邵利兵
电话	(0571) 87117616	传真	(0571) 87117607
网址	www.czcb.com.cn	客服电话	(0571) 96527、 4008096527

## (22) 天津银行股份有限公司

住所、办公地址	天津市河西区友谊路 15 号		
法定代表人	王金龙	联系人	杨森



电话	(0769) 22118343	传真	(0769) 22320896
网址	www.bank-of-tianjin.com	客服电话	4006-960296

## (23) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所、办公地址	东莞市城区旗峰路 2 号		
法定代表人	何沛良	联系人	谭少筠
电话	(0769) 22118343	传真	(0769) 22320896
网址	www.drcbank.com	客服电话	(0769) 961122

## (24) 中信证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010) 60833722	传真	(010) 60833739
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

## (25) 广发证券股份有限公司

住所	广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼(4301-4316)		
办公地址	广东省广州天河北路大都会广场 18、19、36、38、41 和 42 楼		
法定代表人	林治海	联系人	黄岚
电话	(020) 87555888	传真	(020) 87555305
网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各营业网点

## (26) 中信建投证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼		
办公地址	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
清算传真	(010) 65183880	业务传真	(010) 65182261
网址	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

## (27) 海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路 98 号		
办公地址	上海市广东路 689 号		
法定代表人	王开国	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021) 23219000	传真	(021) 23219100
网址	www.htsec.com	客服电话	95553 或拨打各城市营业网点咨询电话

## (28) 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	联系人	李清怡
电话	(021) 54033888	传真	(021) 54030294
网址	www.sywg.com	客服电话	(021) 962505

## (29) 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	上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼		



法定代表人	万建华	联系人	芮敏祺
电话	(021) 38676666	传真	(021) 38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

## (30) 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	顾伟国	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	010-66568990
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

## (31) 兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路 268 号		
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层		
法定代表人	兰荣	联系人	谢高得
电话	(021) 38565785	传真	(021) 38565955
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

## (32) 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 38-45 层		
法定代表人	宫少林	联系人	林生迎
电话	(0755) 82943666	传真	(0755) 82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008881111、95565

## (33) 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	联系人	孙菁菁
电话	025-83290537	传真	025- 51863323
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

## (34) 长城证券有限责任公司

住所、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	黄耀华	联系人	李春芳
电话	(0755) 83516089	传真	(0755) 83515567
网址	www.cgws.com	客服电话	4006668888、(0755) 33680000

## (35) 国都证券有限责任公司

住所、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 10 层		
法定代表人	常喆	联系人	黄静
电话	(010) 84183389	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

## (36) 华福证券有限责任公司

住所	福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层		
----	-------------------------	--	--



办公地址	福州市五四路 157 号新天地大厦 7 至 10 层		
法定代表人	黄金琳	联系人	张腾
电话	(0591) 87383623	传真	(0591) 87383610
客服电话	(0591) 96326	网址	www.hfzq.com.cn

## (37) 光大证券股份有限公司

住所、办公地址	上海市静安区新闻路 1508 号		
法定代表人	徐浩明	联系人	刘晨、李芳芳
电话	(021) 22169999	传真	(021) 22169134
网址	www.ebscn.com	客服电话	4008888788 , 10108998

## (38) 渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室		
办公地址	天津市南开区滨水西道 8 号		
法定代表人	杜庆平	联系人	王兆权
电话	(022) 28451861	传真	(022) 28451892
网址	www.bhzq.com	客服电话	4006515988

## (39) 安信证券股份有限公司

住所	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元		
办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元 深圳市福田区深南大道凤凰大厦 1 栋 9 层		
法定代表人	牛冠兴	联系人	陈剑虹
电话	(0755) 82825551	传真	(0755) 82558355
网址	www.essence.com.cn	客服电话	4008001001

## (40) 东北证券股份有限公司

住所、办公地址	长春市自由大路 1138 号		
法定代表人	矫正中	联系人	潘锴
电话	(0431) 85096709	传真	(0431) 85096795
网址	www.nesc.cn	客服电话	4006000686、(0431) 85096733

## (41) 平安证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼		
办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼 (518048)		
法定代表人	杨宇翔	联系人	郑舒丽
电话	0755-22626391	传真	(0755) 82400862
网址	http://www.pingan.com	客服电话	95511—8

## (42) 国元证券股份有限公司

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	联系人	陈玲玲
电话	(0551) 2246273	传真	(0551) 2272100
网址	www.gyzq.com.cn	客服电话	95578

## (43) 中国中投证券有限责任公司

住所地址	深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01、02、03、05、11、12、13、15、16、18、19、20、21、22、23 单元		
办公地址	深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层		
法定代表人	龙增来	联系人	刘毅
电话	0755-82023442	传真	0755-82026539
网址	www.china-invs.cn	客服电话	400 600 8008

## (44) 德邦证券有限责任公司

住所	上海市普陀区曹阳路 510 号南半幢 9 楼		
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	姚文平	联系人	罗芳
电话	(021) 68761616	传真	(021) 68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

## (45) 财富证券有限责任公司

住所、办公地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731) 84403319	传真	(0731) 84403439
网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731) 84403360

## (46) 中信万通证券有限责任公司

住所	青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层(1507-1510 室)		
办公地址	青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层		
法定代表人	杨宝林	联系人	吴忠超
电话	(0532) 85022326	传真	(0532) 85022605
网址	www.zxwt.com.cn	客服电话	(0532) 96577

## (47) 中航证券有限公司

住所、办公地址	南昌红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼		
法定代表人	杜航	联系人	戴蕾
电话	(0791) 86768681	传真	(0791) 86770178
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

## (48) 中信证券(浙江)有限责任公司

住所、办公地址	浙江杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19 层、20 层		
法定代表人	沈强	联系人	丁思聪
电话	(0571) 96598	传真	(0571) 85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571) 96598

## (49) 长江证券股份有限公司

住所、办公地址	湖北省武汉市新华路特 8 号长江证券大厦		
法定代表人	胡运钊	联系人	李良



电话	(027) 65799999	传真	(027) 85481900
客服电话	95579 或 4008-888-999		
网址	www.95579.com		

## (50) 金元证券股份有限公司

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	陆涛	联系人	马贤清
电话	(0755) 83025022	传真	(0755) 83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

## (51) 国盛证券有限责任公司

住所	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦		
办公地址	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼		
法定代表人	曾小普	联系人	徐美云
电话	(0791) 86285337	传真	(0791) 86282293
网址	www.gsstock.com	客服电话	4008222111

## (52) 山西证券股份有限公司

住所、办公地址	太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼		
法定代表人	侯巍	联系人	郭熠
电话	(0351) 8686659	传真	(0351) 8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

## (53) 广州证券有限责任公司

办公地址	广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、20 楼		
法定代表人	刘东	联系人	林洁茹
电话	020-88836999	传真	020-88836654
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

## (54) 国联证券股份有限公司

注册地址	江苏省无锡市县前东街 168 号国联大厦 6 层		
办公地址	江苏省无锡市太湖新城金融一街 8 号国联金融大厦 702		
法定代表人	雷建辉	联系人	沈刚
电话	0510-82831662	传真	0510-82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	95570

## (55) 东吴证券股份有限公司

住所、办公地址	苏州工业园区翠园路 181 号		
法定代表人	吴永敏	联系人	方晓丹
电话	(0512)65581136	传真	(0512) 65588021
网址	www.dwzq.com.cn	客服电话	(0512)33396288

## (56) 南京证券有限责任公司

住所、办公地址	江苏省南京市大钟亭 8 号		
---------	---------------	--	--



法定代表人	张华东	联系人	李铮
电话	(025) 83367888	传真	(025) 83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

## (57) 恒泰证券股份有限公司

住所、办公地址	内蒙古呼和浩特市新城区新华大街 111 号		
法定代表人	庞介民	联系人	王旭华
电话	(010) 66297386	传真	(0471) 4961259
网址	www.cnht.com.cn	客服电话	(0471) 4972343

## (58) 东海证券有限责任公司

住所、办公地址	江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 楼		
法定代表人	朱科敏	联系人	梁旭
电话	(0519) 88157761	传真	(0519) 88157761
网址	www.longone.com.cn	客服电话	400-888-8588

## (59) 第一创业证券有限责任公司

住所、办公地址	广东省深圳罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层		
法定代表人	刘学民	联系人	崔国良
电话	(0755) 25832852	传真	(0755) 82485081
网址	www.fcsc.cn	客服电话	4008881888

## (60) 宏源证券股份有限公司

住所	新疆乌鲁木齐市文艺路 233 号宏源大厦		
办公地址	北京西城区太平桥大街 19 号宏源证券		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
电话	(010) 88085858	传真	(010) 88085195
网址	www.hysec.com	客服电话	4008-000-562

## (61) 民生证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层		
法定代表人	余政	联系人	赵明
电话	(010) 85127622	传真	(010) 85127917
网址	www.msza.com	客服电话	400-619-8888

## (62) 新时代证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 1 号 A 座 8 层		
法定代表人	马金声	联系人	孙恺
电话	(010) 83561149	传真	(010) 83561094
网址	www.xsdzq.cn	客服电话	4006989898

## (63) 上海证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市西藏中路 336 号		
法定代表人	郁忠民	联系人	张瑾
电话	(021) 53519888	传真	(021) 53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518





			4008918918
--	--	--	------------

## (64) 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 40-42 层		
法定代表人	卢长才	联系人	方文
电话	(0755) 83199599	传真	(0755) 83199545
客服电话	(0755) 83199511	网址	www.csc.com.cn

## (65) 中原证券股份有限公司

住所、办公地址	郑州市郑东新区商务外环路 10 号		
法定代表人	石保上	联系人	程月艳 耿铭
电话	(0371) 65585670	传真	(0371) 65585665
网址	www.ccnew.com	客服电话	967218 4008139666

## (66) 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	张运勇	联系人	苏卓仁
电话	(0769) 22112062	传真	(0769) 22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769) 961130

## (67) 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	联系人	李昕田
电话	(0931) 8784656	传真	(0931) 4890628
客服电话	(0931) 4890208 (0931) 4890619	网址	www.hlzqgs.com

## (68) 万联证券有限责任公司

住所、办公地址	广州市中山二路 18 号电信广场 36、37 层		
法定代表人	张建军	联系人	罗创斌
电话	(020) 37865070	传真	020-22373718-1013
网址	www.wlzq.com.cn	客服电话	4008888133

## (69) 国金证券股份有限公司

住所、办公地址	成都市东城根上街 95 号		
法定代表人	冉云	联系人	金喆
电话	(028) 86690126	传真	(028) 86690126
网址	www.gjq.com.cn	客服电话	4006600109

## (70) 齐鲁证券有限公司

住所	山东省济南市市中区经七路 86 号		
办公地址	山东省济南市市中区经七路 86 号		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 68889155	传真	(0531) 68889752
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

## (71) 大同证券经纪有限责任公司

住所	山西省大同市大北街 13 号		
办公地址	山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351) 4130322	传真	(0351) 4130322
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	4007121212

## (72) 瑞银证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层		
法定代表人	刘弘	联系人	牟冲
电话	(010) 58328366, (010) 58328722	传真	(010) 58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

## (73) 华鑫证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元		
法定代表人	洪家新	联系人	雷蕾
电话	(0755) 82083788	传真	(0755) 82083408
客服电话	(021) 32109999, (029) 68918888		
网址	www.cfsc.com.cn		

## (74) 中山证券有限责任公司

住所、办公地址	深圳市福田区益田路 6009 号新世界中心 29 层		
法定代表人	吴永良	联系人	李珍
电话	(0755) 82570586	传真	(0755) 82960582
网址	www.zszq.com	客服电话	4001022011

## (75) 天相投资顾问有限公司

注册地址	北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701		
办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层		
法定代表人	林义相	联系人	林爽
电话	(010) 66045608	传真	(010) 66045500
客服电话	(010) 66045678		
天相投顾网址	http://www.txsec.com		
天相基金网网址	http://jijin.txsec.com		

## (76) 江海证券有限公司

住所、办公地址	黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号		
法定代表人	孙名扬	联系人	张宇宏
电话	(0451) 82336863	传真	(0451) 82287211
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

## (77) 中国民族证券有限责任公司

住所、办公地址	北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层		
---------	-----------------------------	--	--



法定代表人	赵大建	联系人	李微
电话	(010) 59355941	传真	(010) 66553791
客服电话	400-889-5618	网址	www.e5618.com

(78) 厦门证券有限公司

住所、办公地址	厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼		
法定代表人	傅毅辉	联系人	卢金文
电话	(0592) 5161642	传真	(0592) 5161140
网址	www.xmzq.cn	客服电话	(0592) 5163588

(79) 爱建证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼		
法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888	传真	021- 68728782
客服电话	(021) 63340678	网址	www.ajzq.com

(80) 华宝证券有限责任公司

住所、办公地址	上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层		
法定代表人	陈林	联系人	毛雪梅
电话	(021) 50122222	传真	(021) 50122200
客服电话	4008209898	网址	www.cnhbstock.com

(81) 方正证券股份有限公司

住所、办公地址	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层		
法定代表人	雷杰	联系人	郭军瑞
电话	(0731) 85832503	传真	(0731) 85832214
客服电话	95571	网址	www.foundersc.com

(82) 日信证券有限责任公司

住所	呼和浩特市新城区锡林南路 18 号		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 1 号长安兴融中心西楼 11 层		
法定代表人	孔佑杰	联系人	冯杰
电话	(010) 83991743	传真	(010) 66412537
客服电话	(010) 83991888	网址	www.rxzq.com.cn

(83) 信达证券股份有限公司

住所、办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼		
办公地址	北京市西城区金融大街 8 号中国华融 A 座 3 层		
法定代表人	高冠江	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
客服电话	400-800-8899	网址	www.cindasc.com

(84) 华融证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街 8 号		
办公地址	北京市西城区金融大街 8 号中国华融 A 座 3 层		
法定代表人	丁之锁	法定代表人	梁宇



电话	(010) 58568007	传真	(010) 58568062
客服电话	(010) 58568118	网址	www.hrsec.com.cn

## (85) 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	杨炯洋	联系人	金达勇
电话	(0755) 83025723	传真	(0755) 83025991
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

## (86) 国信证券股份有限公司

注册地址	深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	齐晓燕
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

## (87) 财富里昂证券有限责任公司

注册地址	上海市浦东新区世纪大道 100 号 环球金融中心 9 楼		
法定代表人	罗浩	联系人	倪丹
电话	021-38784818	传真	021-68775878
网址	www.cf-clsa.com	客服电话	68777877

## (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	上海市通力律师事务所		
住所、办公地址	上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	(021) 31358666	传真	(021) 31358600
经办律师	吕红、黎明		

## (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	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼		
办公地址	上海卢湾区湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼		
法定代表人	杨绍信	联系人	吴海霞
电话	(021) 61238888	传真	(021) 61238800
经办注册会计师	汪棣、吴海霞		

## 四、基金的名称

本基金名称：嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 五、基金的类型

本基金类型：契约型开放式，联接基金

## 六、基金的投资目标

紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。

## 七、基金的投资范围

本基金以目标ETF基金份额、标的指数成份股及备选成份股为主要投资对象。正常情况下，本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购等固定收益类资产、现金资产、以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

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

本基金为目标ETF的联接基金。主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。

在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标ETF的买卖。

此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、

交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的，基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

本基金投资于股票期货、期权等相关金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

### 1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

### 2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

### 3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行，避免重大风险的发生。

（1）研究：指数投资研究小组依托公司整体研究平台，整合内部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展目标 ETF 的申购赎回清单分析、目标 ETF 流动性分析、标的指数成份证券相关信息的搜集与分析等，作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策：投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告，定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议，决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议，每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）交易执行：集中交易室负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责。

（4）投资绩效评估：风险管理部门定期和不定期对基金进行投资绩效评估，并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（5）组合监控与调整：基金经理将跟踪目标 ETF 申购赎回清单特征、二级市场交易特征、标的指数变动情况，并结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、本基金申购和赎回的现金流量以及组合投资绩效评估的结果等，对投资组合进行监控和调整，密切

跟踪业绩比较基准。

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,并在基金招募说明书及其更新中公告。

## 九、基金的业绩比较基准

深证基本面 120 指数\*95% + 银行同业存款利率\*5%。

深证基本面 120 指数在深圳证券交易所上市公司中,以 4 个基本面指标来衡量上市公司的经济规模,并选取其中最大的 120 家 A 股上市公司作为样本,且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数不仅具有良好的基本面、市场代表性和流动性,且打破了样本股价格与其权重之间的联系,使得基本面经济规模大的股票可以获得较高的权重,并在一定程度上减少了高估股票在组合中权重过高的现象,因此可以为投资者提供另一个投资深圳市场的业绩比较基准和投资分析工具。

深证基本面 120 指数是本基金目标 ETF 的标的指数。如果目标 ETF 变更标的指数、或深证基本面 120 指数编制单位变更或停止深证基本面 120 指数的编制及发布、或深证基本面 120 指数由其他指数替代、或深证基本面 120 指数由于指数编制方法发生重大变更等原因导致深证基本面 120 指数不宜继续作为业绩比较基准的组成部分,本基金管理人可以依据审慎性原则,在充分考虑持有人利益及履行适当程序的前提下,变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

## 十、基金的风险收益特征

本基金为深证基本面 120ETF 的联接基金,主要通过投资于深证基本面 120ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪。因此,本基金的业绩表现与深证基本面 120 指数及深证基本面 120ETF 的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。

## 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。

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2012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 2011 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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	12,403,350.00	3.82
	其中：股票	12,403,350.00	3.82
2	基金投资	293,655,812.38	90.50
3	固定收益投资	9,673,000.00	2.98
	其中：债券	9,673,000.00	2.98
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,034,959.54	2.48
7	其他资产	729,544.80	0.22
8	合计	324,496,666.72	100.00

### 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	39,172.00	0.01
B	采掘业	414,543.00	0.13
C	制造业	7,157,591.00	2.21
C0	食品、饮料	1,055,132.00	0.33
C1	纺织、服装、皮毛	92,045.00	0.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	152,684.00	0.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	504,877.00	0.16
C5	电子	334,522.00	0.10
C6	金属、非金属	2,648,651.00	0.82
C7	机械、设备、仪表	1,901,283.00	0.59
C8	医药、生物制品	468,397.00	0.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	325,135.00	0.10
E	建筑业	21,050.00	0.01
F	交通运输、仓储业	872,445.00	0.27
G	信息技术业	420,559.00	0.13
H	批发和零售贸易	556,004.00	0.17
I	金融、保险业	957,819.00	0.30
J	房地产业	1,427,223.00	0.44



K	社会服务业	165,648.00	0.05
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	46,161.00	0.01
	合计	12,403,350.00	3.83

### 3.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000002	万 科 A	122,200	912,834.00	0.28
2	000900	现代投资	57,100	718,318.00	0.22
3	000898	鞍钢股份	118,300	538,265.00	0.17
4	000709	河北钢铁	182,900	523,094.00	0.16
5	000001	深发展 A	22,300	347,657.00	0.11
6	000825	太钢不锈	90,200	336,446.00	0.10
7	000651	格力电器	17,800	307,762.00	0.10
8	000063	中兴通讯	15,400	260,260.00	0.08
9	002024	苏宁电器	29,200	246,448.00	0.08
10	000858	五 粮 液	6,800	223,040.00	0.07

### 4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	9,673,000.00	2.99
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	9,673,000.00	2.99

### 5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	1101030	11 央行票据 30	100,000	9,673,000.00	2.99

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

### 6.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

**7.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细**

报告期末，本基金未持有权证。

**8.期末投资目标基金明细**

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值 (人民币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	嘉实深证基本面 120ETF	股票型	交易型 开放式	嘉实基金管理 有限公司	293,655,812.38	90.72

**9.投资组合报告附注**

(1) 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

①2011年5月27日，宜宾五粮液股份有限公司发布了《关于收到中国证监会〈行政处罚决定书〉的公告》，中国证监会决定对五粮液给予警告，并处以60万元罚款。

本基金投资于“五粮液(000858)”的决策程序说明：基于五粮液基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“五粮液”股票，其决策流程符合公司投资管理制度的相关规定。

②报告期内本基金投资的前十名证券中其他九名证券发行主体无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中其他九名证券发行主体未受到公开谴责、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) 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	458,716.80
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	207,323.54
5	应收申购款	63,504.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	729,544.80

**(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2011年12月31日。

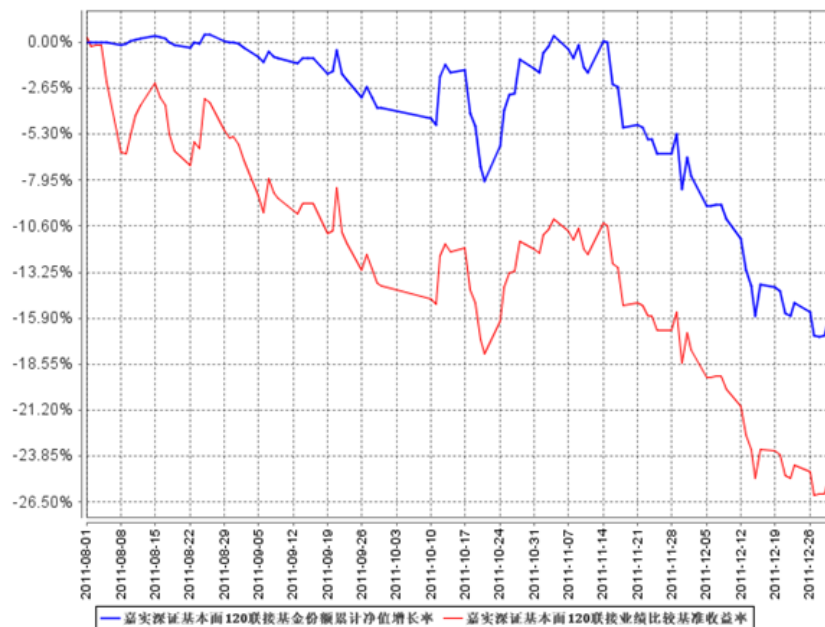
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 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
2011年8月1日至 2011年12月31日	-15.72%	1.03%	-24.92%	1.38%	9.20%	-0.35%

### 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

嘉实深证基本面120联接基金份额累计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



图：嘉实深证基本面120联接基金份额累计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

(2011年8月1日至2011年12月31日)

注：本基金基金合同生效日2011年8月1日至报告期末未满1年。按基金合同和招募



说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“十四、基金的投资（二）投资范围和（八）2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

### 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

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.5% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### （2）基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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扣除基金财产中目标 ETF 份额所对应资产净值后的剩余部分；若为负数，则 E 取 0。

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金资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

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用、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、基金的资金汇划费用等。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。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 万元	1.2%
50 万元 ≤ M < 200 万元	0.8%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.4%
M ≥ 500 万元	单笔 1000 元

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易系统和电话交易系统申购开放式基金业务实行申购费率优惠，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%，但招商银行借记卡、中国农业银行金穗卡持卡人申购本基金的申购费率优惠按照相关公告规定的费率执行；机构投资者通过本基金管理人直销网上交易系统申购开放式基金业务，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%。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%执行。

基金招募说明书及相关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。

本基金的申购费用由申购人承担，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用，不列入基金资产。

(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。

本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。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%的部分归入基金资产，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嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金B、嘉实安心货币市场基金转换为嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金时,转换费率均为转入基金适用的申购费率,计算公式如下:

$$\begin{aligned} \text{净转入金额} &= (\text{转出份额} \times \text{转出当日转出基金的基金份额净值}) / (1 + \text{转换费率}) + M \\ \text{转换费用} &= (\text{转出份额} \times \text{转出当日转出基金的基金份额净值}) \times \text{转换费率} / (1 + \text{转换费率}) \\ \text{转入份额} &= \text{净转入金额} / \text{转入当日转入基金的基金份额净值} \end{aligned}$$

其中M为嘉实货币市场基金、嘉实安心货币市场基金全部转出时账户当前累计未付收益

②嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金与嘉实旗下原有其他17只开放式基金(包括: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、嘉实债券证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、嘉实优质企业股票型证券投资基金、嘉实主题精选混合型证券投资基金、嘉实策略增长混合型证券投资基金、嘉实研究精选股票型证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金A、嘉实量化阿尔法股票型证券投资基金、嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金、嘉实价值优势股票型证券投资基金、嘉实稳固收益债券型证券投资基金、嘉实主题新动力股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、嘉实信用债券型证券投资基金A)之间互转,以及嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金转入嘉实货币市场基金、嘉实超短债证券投资基金、嘉实多元收益债券型证券投资基金B、嘉实信用债券型证券投资基金C、嘉实安心货币市场基金时,均采用“赎回费 + 申购费率补差”算法,计算公式如下:

$$\begin{aligned} \text{净转入金额} &= B \times C \times (1 - D) / (1 + G) \\ \text{转换补差费用} &= [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G \\ \text{转入份额} &= \text{净转入金额} / E \end{aligned}$$

其中, B 为转出的基金份额;

C 为转换申请当日转出基金的基金份额净值;

D 为转出基金的对应赎回费率;

G 为对应的申购补差费率,当转出基金的申购费率  $\geq$  转入基金的申购费率时,则申购补差费率G为零;



E 为转换申请当日转入基金的基金份额净值。

其中赎回费的 25% 归入转出基金资产（嘉实稳固收益债券基金除外）；根据嘉实稳固收益债券基金合同的约定，该基金的赎回费全部归入该基金资产（注：在运作期和间歇期，该基金按不同的方式收取赎回费）。

基金转换费由基金份额持有人承担。基金管理人可以根据市场情况调整基金转换费率，调整后的基金转换费率应及时公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对以特定交易方式（如网上交易等）或在特定时间段等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金转换费率。

注：自 2010 年 5 月 26 日起，嘉实主题混合实施暂停转入业务；自 2011 年 1 月 7 日起，嘉实增长混合实施暂停转入业务；自 2011 年 1 月 7 日起，嘉实策略混合实施暂停转入业务。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

### 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项纳税主体，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：将本基金基金份额发售公告中“代销机构”以及发售公告披露日起至2012年2月1日止新增的代销机构，列示在本招募说明书，包括中国银行等23家银行，中信证券等64家代销机构，并更新相关代销机构信息。

5.在“九、基金转换”部分：增加了基金转换的相关内容。

6.在“十二、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。

7.增加“十三、基金的业绩”：说明了自 2011 年 8 月 1 日本基金合同生效日至 2011 年 12 月 31 日的基金业绩。

8.在“二十七、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2011 年 6 月 28 日首次刊登招募说明书至 2012 年 2 月 1 日相关临时公告事项。

**嘉实基金管理有限公司**

**2012年3月27日**