



# 嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金 更新招募说明书摘要

(2010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

嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),根据2009年7月6日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2009]605号)核准进行募集。本基金基金合同于2009年8月18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。

本摘要所载内容截止日为2010年8月18日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2010年6月30日(未经审计)。

## 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	1.5亿元
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、福州、南京、广州分公司。公司获得全国社保基金、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

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局长，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月至今任中诚信托有限责任公司党委书记、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。



Ingo Gefeke先生，董事，德国籍，康斯坦斯（Constance）大学国际经济学硕士研究生。曾任德意志银行（纽约）全球交易银行首席运营官及国际投资银行首席运营官。现任德意志资产管理公司（法兰克福）董事会成员，德意志资产管理公司（纽约）董事总经理兼首席行政管理官、全球交易总监。

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。

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。

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。

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。

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

赵勇先生，北大光华管理学院硕士，9年证券从业经历。2001年起先后在大成基金管理有限公司担任基金经理助理，以及泰康资产管理有限公司任职投资经理。2008年3月进入嘉实基金管理有限公司投资部工作，任基金经理助理。

(2) 历任基金经理：无。

## 3、投资决策委员会

投资决策委员会的成员包括：公司总经理赵学军先生、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、总经理助理李凯先生。

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

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：

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；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。另外，中国银行在北京市分行、上海市分行、深圳市分行、广东省分行、江苏省分行等重点分行已开展托管业务。

### 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	上海市浦东新区富城路 99 号震旦国际大楼 1702 室		
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		
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) 6677766	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	沈峥		

## (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	陈涤		

## 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) 66594946
网址	www.boc.cn	客服电话	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	联系人	田耕
电话	(010) 66107900	传真	(010) 66107914



网址	www.icbc.com.cn	客服电话	95588
----	-----------------	------	-------

**(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		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

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

**(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	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83077278	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

**(6) 交通银行**

住所、办公地址	上海市银城中路 188 号		
法定代表人	胡怀邦	联系人	曹榕
电话	(021) 58781234	传真	(021) 58408483
网址	www.bankcomm.com	客服电话	95559

**(7) 中国邮政储蓄银行**

住所、办公地址	北京市西城区宣武门西大街 131 号		
法定代表人	刘安东	联系人	陈春林
传真	(010) 66415194	网址	www.psbc.com
客服电话	95580		

**(8) 中国民生银行**

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、吴海鹏
电话	(010) 58351666	传真	(010) 83914283
网址	www.cmbc.com.cn	客服电话	95568

**(9) 中国光大银行**

住所、办公地址	北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦		
法定代表人	唐双宁	联系人	李伟
电话	(010) 68098778	传真	(010) 68560312
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595 (全国)



**(10) 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	联系人	丰靖
电话	(010) 65557083	传真	(010) 65550827
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

**(11) 兴业银行**

住所	福州市湖东路154号		
办公地址	上海市江宁路168号		
法定代表人	高建平	联系人	梁曦
电话	(021) 52629999	传真	(021) 62569070
网址	www.cib.com.cn	客服电话	95561

**(12) 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	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

**(13) 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	联系人	倪苏云、虞谷云
电话	(021) 61618888	传真	(021) 63604199
网址	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

**(14) 北京银行**

住所	北京市西城区金融大街甲17号首层		
办公地址	北京市西城区金融大街丙17号北京银行大厦		
法定代表人	闫冰竹	联系人	王曦
电话	(010) 66223584	传真	(010) 66226073
网址	www.bankofbeijing.com.cn	客服电话	(010) 96169

**(15) 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	孙建一	联系人	霍兆龙
电话	(0755) 25859591	传真	(0755) 25879453
网址	http://bank.pingan.com	客服电话	4006699999

**(16) 广东发展银行**

住所、办公地址	广东省广州市农林下路83号		
---------	---------------	--	--





法定代表人	董建岳	联系人	李晓鹏
电话	(020) 38322256	传真	(020) 87310955
网址	www.gdb.com.cn	客服电话	800-830-8003 400-830-8003

**(17) 青岛银行**

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	滕克
电话	(0532) 85709787	传真	(0532) 85709799
客服电话	96588 (青岛)、4006696588 (全国)		
网址	www.qdccb.com		

**(18) 宁波银行**

住所、办公地址	宁波市江东区中山东路 294 号		
法定代表人	陆华裕	联系人	胡技勋
电话	(021) 63586210	传真	(021) 63586215
网址	www.nbc.com.cn	客服电话	96528, 962528 上海地区

**(19) 东莞银行**

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	胡昱
电话	(0769) 22119061	传真	(0769) 22117730
客服电话	(0769) 96228		
网址	www.dongguanbank.cn		

**(20) 杭州银行**

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	马时雍	联系人	江波
电话	(0571) 85108309	传真	(0571) 85108309
客服电话	400-888-8508	网址	www.hzbank.com.cn

**(21) 南京银行**

住所、办公地址	南京市白下区淮海路 50 号		
法定代表人	林复	联系人	贺坚
电话	(025) 84544135	传真	(025) 84544129
客服电话	4008896400	网址	www.njcb.com.cn

**(22) 临商银行**

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

**(23) 温州银行**

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

**(24) 上海银行**

住所、办公地址	上海市浦东新区银城中路 168 号		
法定代表人	宁黎明	联系人	张萍
电话	(021) 68475888	传真	(021) 68476111
客服电话	(021) 962888	网址	www.bankofshanghai.com

**(25) 浙商银行**

住所、办公地址	浙江省杭州市庆春路 288 号		
法定代表人	张达洋	联系人	吴军阳
电话	(0571) 87659084	传真	(0571) 87659188
网址	www.czbank.com	客服电话	95105665

**(26) 江苏银行**

住所、办公地址	南京市洪武北路 55 号		
法定代表人	黄志伟	联系人	田春慧
电话	(025) 58588167	传真	(025) 58588164
网址	www.jsbchina.cn	客服电话	(025) 96098、4008696098

**(27) 乌鲁木齐市商业银行**

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

**(28) 渤海银行**

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) 58316259
网址	www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811

**(29) 洛阳银行**

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
----	--------------------------	------	--------------

**(30) 中信证券股份有限公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层		
法定代表人	王东明	联系人	陈忠
电话	(010) 84863893	传真	(010) 84865560
网址	www.cs.ecitic.com	客服电话	(010) 84588888

**(31) 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 房)		
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	王志伟	联系人	黄岚
电话	(020) 87555888	传真	(020) 87555305
网址	www.gf.com.cn	客服电话	95575 或致电各地营业网点

**(32) 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	北京市朝阳区门内大街 188 号		
法定代表人	张佑君	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

**(33) 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

**(34) 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.sw2000.com.cn	客服电话	(021) 962505

**(35) 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	祝幼一	联系人	芮敏祺
电话	(021) 38676666	传真	(021) 38670666
网址	www.gtja.com	客服电话	4008888666

**(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	顾伟国	联系人	田薇
电话	(010) 66568430	传真	(010) 66568536
网址	www.chinastock.com.cn	客服电话	400-888-8888

**(37) 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	www.xyzq.com.cn	客服电话	4008888123

**(38) 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	黄健
电话	(0755) 82943666	传真	(0755) 82943636
网址	www.newone.com.cn	客服电话	4008888111、95565

**(39) 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	程高峰
电话	(025) 84457777	传真	(025) 84579763
网址	www.htsc.com.cn	客服电话	95597

**(40) 华泰联合证券有限责任公司**

住所	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 (01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A		
办公地址	深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第 5 层、17 层、18 层、24 层、25 层、26 层		
法定代表人	马昭明	联系人	盛宗凌
电话	(0755) 82492000	传真	(0755) 82492962
网址	www.lhzq.com	客服电话	95513

**(41) 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	匡婷
电话	(0755) 83516289	传真	(0755) 83516199
网址	www.cgws.com	客服电话	4006666888、(0755) 33680000

**(42) 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) 84183333	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

**(43) 广发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) 87841160	传真	(0591) 87841150
客服电话	(0591) 96326	网址	www.gfhfzq.com.cn

**(44) 光大证券股份有限公司**

住所、办公地址	上海市静安区新闸路 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

**(45) 渤海证券股份有限公司**

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

**(46) 国信证券股份有限公司**

住所、办公地址	深圳罗湖区红岭中路 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) 82133302
网址	www.guosen.com.cn	客服电话	95536

**(47) 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) 82558305	传真	(0755) 82558355
网址	www.essences.com.cn	客服电话	4008001001

**(48) 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

**(49) 平安证券有限责任公司**



住所、办公地址	深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼		
法定代表人	杨宇翔	联系人	周璐
电话	4008866338	传真	(0755) 82400862
网址	www.PINGAN.com	客服电话	4008816168

**(50) 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		

**(51) 中国建银投资证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳福田益田路福中路交界荣超商务中心 A 栋第 18 层至 20 层		
法定代表人	杨明辉	联系人	杨瑞芳
电话	(0755) 82026511	传真	(0755) 82026539
网址	www.cjis.cn	客服电话	400-600-8008

**(52) 湘财证券有限责任公司**

住所、办公地址	湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼		
法定代表人	林俊波	联系人	李梦诗
电话	(021) 68634518-8631	传真	(021) 68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

**(53) 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	唐新宇	联系人	张静
传真	(021) 50372474	客服电话	4006208888
网址	www.bocichina.com.cn		

**(54) 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	方加春	联系人	罗芳
电话	(021) 68761616	传真	(021) 68767981
网址	www.tebon.com.cn	客服电话	4008888128

**(55) 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、27 层		
法定代表人	周晖	联系人	郭磊
电话	(0731) 4403319	传真	(0731) 4403439



网址	www.cfzq.com	客服电话	(0731) 4403319
----	--------------	------	----------------

**(56) 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	青岛市东海西路 28 号		
法定代表人	张智河	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

**(57) 中航证券有限公司**

住所、办公地址	江西省南昌市抚河北路 291 号		
法定代表人	杜航	联系人	余雅娜
电话	(0791) 6768763	传真	(0791) 6789414
网址	www.avicsec.com	客服电话	400-8866-567

**(58) 中信金通证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江省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	刘军	联系人	王垚艺
电话	(0571) 85783750	传真	(0571) 85783771
网址	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571) 96598

**(59) 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	4008-888-999 或 (027) 85808318		
网址	www.95579.com		

**(60) 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	金春
电话	(0755) 83025695	传真	(0755) 83025625
网址	www.jyzq.cn	客服电话	400-8888-228

**(61) 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	联系人	覃清芳
电话	(0771) 5539262	传真	(0771) 5539033
网址	www.ghzq.com.cn	客服电话	4008888100、96100 (广西)

**(62) 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	江西省南昌市北京西路 88 号江信国际金融大厦 4 楼		
法定代表人	裘强	联系人	刘方
电话	(0791) 6273972	传真	(0791) 6288690
网址	www.gsstock.com	客服电话	(0791) 6285337、6283827

**(63) 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	张治国
电话	(0351) 8686703	传真	(0351) 8686619
网址	www.i618.com.cn	客服电话	400-666-1618

**(64) 西部证券股份有限公司**

住所、办公地址	陕西省西安市东大街 232 号信托大厦 16-17 楼		
法定代表人	刘建武	联系人	冯萍
电话	(029) 87406488	传真	(029) 87406387
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

**(65) 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 17 楼		
法定代表人	吴志明	联系人	林洁茹
电话	(020) 87322668	传真	(020) 87325036
网址	www.gzs.com.cn	客服电话	(020) 961303

**(66) 国联证券股份有限公司**

住所、办公地址	江苏省无锡市县前东街 168 号		
法定代表人	雷建辉	联系人	徐欣
电话	(0510) 82831662	传真	(0510) 82830162
网址	www.glsc.com.cn	客服电话	4008885288

**(67) 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 号商旅大厦		
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

**(68) 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	水晨
电话	(025) 83367888	传真	(025) 83320066
网址	www.njzq.com.cn	客服电话	4008285888

**(69) 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	联系人	吴颖
电话	(0571) 87902080	传真	(0571) 87901913
网址	<a href="http://www.stocke.com.cn">www.stocke.com.cn</a>	客服电话	(0571) 967777

**(70) 恒泰证券股份有限公司**

住所、办公地址	内蒙古自治区呼和浩特市新城区东风路 111 号		
法定代表人	鞠瑾	联系人	常向东
电话	(0471) 4913998	传真	(0471) 4930707
网址	<a href="http://www.cnht.com.cn">www.cnht.com.cn</a>	客服电话	(0471) 4961259

**(71) 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	李涛
电话	(0519) 88157761	传真	(0519) 88157761
网址	<a href="http://www.longone.com.cn">www.longone.com.cn</a>	客服电话	400-888-8588

**(72) 东方证券股份有限公司**

住所	上海市中山南路 318 号 2 号楼 22-29 层		
办公地址	上海市中山南路 318 号 2 号楼 21-29 层		
法定代表人	潘鑫军	联系人	吴宇
电话	(021) 63325888	传真	(021) 63326173
网址	<a href="http://www.dfzq.com.cn">www.dfzq.com.cn</a>	客服电话	95503

**(73) 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	魏颖
电话	(0755) 25832852	传真	(0755) 82485081
网址	<a href="http://www.fcsc.cn">www.fcsc.cn</a>	客服电话	4008881888

**(74) 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) 88085240
网址	<a href="http://www.hysec.com">www.hysec.com</a>	客服电话	4008-000-562

**(75) 民生证券有限责任公司**

住所	北京市朝阳区门外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室		
办公地址	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 16-18 层		
法定代表人	岳献春	联系人	赵明
电话	(010) 85127622	传真	(010) 85127917
网址	<a href="http://www.msza.com">www.msza.com</a>	客服电话	400-619-8888

**(76) 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	王伟力
电话	(021) 53519888	传真	(021) 53519888
网址	www.962518.com	客服电话	(021) 962518

**(77) 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	张婷
电话	(0755) 83199511	传真	(0755) 83199545
网址	www.csc.com.cn	客服电话	(0755) 83199509

**(78) 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/(028) 86150035	传真	(0755) 83025991/(028) 86155733
网址	www.hx168.com.cn	客服电话	4008-888-818

**(79) 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

**(80) 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	游锦辉	联系人	罗绍辉
电话	(0769) 22119351	传真	(0769) 22119423
网址	www.dgzq.com.cn	客服电话	(0769) 961130

**(81) 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) 4890208	传真	(0931) 4890628
客服电话	(0931) 4890208、 (0931) 4890619	网址	www.hlzqgs.com

**(82) 万联证券有限责任公司**

住所、办公地址	广州市中山二路 18 号广东电信广场 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

**(83) 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.gjzq.com.cn	客服电话	4006600109

**(84) 财通证券有限责任公司**

住所、办公地址	浙江杭州市解放路 111 号金钱大厦		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571) 87925129	传真	(0571) 87828042
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571) 96336、962336 (上海地区)

**(85) 齐鲁证券有限公司**

住所	山东省济南市经十路 20518 号		
办公地址	山东省济南市经十路 17703 号华特广场		
法定代表人	李玮	联系人	吴阳
电话	(0531) 81283938	传真	(0531) 81283900
网址	www.qlzq.com.cn	客服电话	95538

**(86) 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	山西省太原市青年路 8 号		
法定代表人	董祥	联系人	薛津
电话	(0351) 4167056	传真	(0351) 4192803
网址	www.dtsbc.com.cn	客服电话	(0351) 4167056

**(87) 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	谢亚凡、田文健
电话	(010) 58328752、58328725	传真	(010) 58328748
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

**(88) 华鑫证券有限责任公司**

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

**(89) 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	刘军
电话	(0755) 83734659	传真	(0755) 82960582
网址	www.zszq.com.cn	客服电话	(0755) 82943750

**(90) 中国国际金融有限公司**

住所	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层		
办公地址	北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层		
法定代表人	李剑阁	联系人	王雪筠
电话	(010) 65051166	传真	(010) 85679535
网址	www.ciccs.com.cn		
客服电话	(010) 85679238; (010) 85679169		

**(91) 天相投资顾问有限公司**

住所	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	潘鸿
电话	(010) 66045446	传真	(010) 66045500
客服电话	(010) 66045678		
网址	www.txjijin.com		

**(92) 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	徐世旺
电话	(0451) 82336863	传真	(0451) 82287211
客服电话	400-666-2288	网址	www.jhzq.com.cn

**(93) 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

**(94) 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

**(95) 爱建证券有限责任公司**

住所、办公地址	上海市南京西路 758 号 24 楼		
---------	--------------------	--	--



法定代表人	郭林	联系人	陈敏
电话	(021) 32229888-3121	传真	(021) 62878783
客服电话	(021) 63340678	网址	www.ajzq.com

**(96) 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 37 层		
法定代表人	陈林	联系人	楼斯佳
电话	(021) 50122222	传真	(021) 50122200
客服电话	4008209898	网址	<a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>

**(97) 方正证券有限责任公司**

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	彭博
电话	(0731) 85832343	传真	(0731) 85832214
客服电话	95571	网址	www.foundersc.com

**(98) 英大证券有限责任公司**

住所、办公地址	深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层		
法定代表人	赵文安	联系人	王睿
电话	(0755) 83007069	传真	(0755) 83007167
客服电话	(0755) 26982993	网址	www.ydsc.com.cn

**(99) 西南证券股份有限公司**

住所、办公地址	重庆市渝中区临江支路 2 号合景国际大厦 A 幢		
法定代表人	王珠林	联系人	米兵
电话	(023) 63786922	传真	(023) 63810422
客服电话	4008096096	网址	www.swsc.com.cn

**(100) 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	陈韦杉
电话	(010)88086830-730	传真	(010)66412537
网址	www.rxzq.com.cn		
客服电话	(010) 88086830		

**(101) 信达证券股份有限公司**

住所	北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层		
办公地址	北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼信达金融中心		
法定代表人	张志刚	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

**(102) 东兴证券股份有限公司**

住所、办公地址	北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 12-15 层		
法定代表人	崔海涛	联系人	黄英



电话	(010) 66555835	传真	(010) 66555246
客服电话	400-8888-993	网址	www.dxzq.net

**(103) 华融证券股份有限公司**

住所	北京市西城区月坛北街 26 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	联系人	梁宇
电话	(010) 58568007	传真	(010) 58568062
客服电话	(010) 58568118	网址	www.hrsec.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、办公地址	北京市朝阳区东三环北路 38 号泰康金融大厦 9 层		
负责人	王卫东	联系人	黄伟民
电话	(010) 65890661	传真	(010) 65176801
经办律师	黄伟民、陈周		

**(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	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼		
法定代表人	杨绍信	联系人	陈宇
电话	(021) 61238888	传真	(021) 61238800
经办注册会计师	许康伟、陈宇		

**四、基金的名称**

本基金名称：嘉实回报灵活配置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**

力争每年获得较高的绝对回报。





## 七、基金的投资方向

本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，具体包括：股票、衍生工具（权证等）、债券（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）、资产支持证券、央行票据、短期融资券等）、债券回购、银行存款等以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资股票指数期货等金融衍生产品或其它品种，可以根据有关规定将其纳入投资范围，并报证监会备案。

本基金投资组合的资产配置范围为：股票等权益类资产占基金资产的比例为 30-80%；债券等固定收益类资产以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5-70%，其中，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过 3%。

若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定，适用新的规定。

## 八、基金的投资策略

本基金强调自上而下、从大类资产到个券选择的配置策略。灵活的大类资产配置、多策略的行业及主题配置以及精选个股个券是获得持续稳定回报的主要来源，而纪律性的风险管理策略是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用大类资产配置模型、行业选择和个券选择三个层次的投资策略，并综合运用风险管理策略实现基金的投资目标。

### 1. 资产配置策略

在大类资产配置上，依据自主开发的战术资产配置模型（Tactical Asset Allocation, TAA Model），在遵守有关投资限制规定的前提下，合理分配各类资产投资比例。本基金的大类资产配置 TAA 模型综合考虑了以下几方面因素：

（1）宏观因素：宏观面关注基本面的重要经济数据以及货币和财政政策的变化。经济基本面我们特别关注 GDP 增长、工业增加值等各种国民生产统计指标，从而分析对股票市场的影响。而货币和财政政策主要分析利率、CPI、信贷等的影响。

（2）市场因素：市场方面我们关注流动性的变化对市场的影响。同时通过反映投资者情绪和信息的技术和统计指标预测未来的市场变化趋势。

（3）估值因素：估值方面我们不仅关注股票市场的绝对估值因素，同时也比较不同市场之间的相对估值变化，以在大类资产间寻找相对的估值洼地。



在预期股票市场处于高风险区域或预期股票市场趋于下跌时，本基金将大幅减少股票投资比例，而主要投资于债券市场，以回避股票市场下跌的系统性风险，避免组合损失，从而实现组合的稳健增值。

## 2. 股票投资策略

本基金秉持自上而下的投资理念，在股票投资策略中，优先进行行业配置，然后在行业内精选个股。同时，本基金也着力发掘有价值的主题性投资机会。

### (1) 行业及主题选择策略

基金经理通过分析行业赢利能力、发展前景、周期性，并综合考虑政策影响和市场认同度等因素，确定各行业以及主题的投资比例，并根据市场情况动态调整。

### (2) 个股选择策略

在个股选择上，采用对基本面的深度研究为主、数量分析为辅的选股策略，并积极寻找各类主题型机会，从多层次多角度发掘有价值的股票。本基金运用数量方法，根据宏观经济和市场的最新情况，对全市场股票按照给定条件进行初步筛选，得到初级股票池。在此基础上，对于初级股票池中的个股从多角度进行深度研究，寻找价值被低估或者有良好成长性的股票形成投资股票池。同时，本基金积极发掘有价值的投资主题，通过细致的市场调研和分析，寻找相关的优良投资品种。

## 3. 债券投资策略

本基金在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

## 4. 衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会，并帮助基金实现保值和锁定收益的目的。

## 5. 风险管理策略

风险管理策略是本基金实现稳定增值目标的重要保障。本基金将运用风险预算模型（Risk Budgeting Model, RB Model）技术，根据基金资产的变化和外部市场环境的变化，动态调整本基金的持仓，以锁定收益、减少亏损，达到稳定升值的目的

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为同期人民币一年期定期存款利率（税前）。



## 十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于债券基金及货币市场基金。

## 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。

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2010年7月19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2010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

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,522,864,016.38	59.36
	其中：股票	2,522,864,016.38	59.36
2	固定收益投资	1,026,926,349.40	24.16
	其中：债券	1,026,926,349.40	24.16
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	683,159,057.94	16.07
6	其他资产	17,289,540.84	0.41
	合计	4,250,238,964.56	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	-	-
B	采掘业	60,364,306.50	1.45
C	制造业	1,735,597,801.49	41.61
C0	食品、饮料	425,411,293.16	10.20
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	23,033,266.40	0.55
C4	石油、化学、塑胶、塑料	268,875,822.87	6.45



C5	电子	60,306,292.77	1.45
C6	金属、非金属	198,955,202.32	4.77
C7	机械、设备、仪表	429,409,460.43	10.29
C8	医药、生物制品	329,606,463.54	7.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	49,987,548.00	1.20
E	建筑业	32,364,892.02	0.78
F	交通运输、仓储业	56,592,548.79	1.36
G	信息技术业	113,268,652.37	2.72
H	批发和零售贸易	146,321,477.60	3.51
I	金融、保险业	296,754,241.98	7.11
J	房地产业	3,477,121.25	0.08
K	社会服务业	7,915,426.38	0.19
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	20,220,000.00	0.48
	合计	2,522,864,016.38	60.48

### 3.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股票投资明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600887	伊利股份	7,137,169.00	209,690,025.22	5.03
2	000858	五粮液	4,930,381.00	119,463,131.63	2.86
3	000887	中鼎股份	6,699,974.00	102,174,603.50	2.45
4	600036	招商银行	7,499,991.00	97,574,882.91	2.34
5	002384	东山精密	1,436,305.00	82,831,709.35	1.99
6	601169	北京银行	6,724,899.00	81,573,024.87	1.96
7	600312	平高电气	7,646,086.00	77,760,694.62	1.86
8	600267	海正药业	3,031,782.00	76,249,317.30	1.83
9	600000	浦发银行	5,499,771.00	74,796,885.60	1.79
10	000423	东阿阿胶	2,098,193.00	72,933,188.68	1.75

### 4.报告期末按券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	489,350,000.00	11.73
3	金融债券	524,901,000.00	12.58
	其中：政策性金融债	524,901,000.00	12.58
4	企业债券	9,773,979.90	0.23
5	企业短期融资券	-	-
6	可转换债券	2,901,369.50	0.07
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-



合计	1,026,926,349.40	24.62
----	------------------	-------

### 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	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1001015	10 央行票据 15	5,000,000	489,350,000.00	11.73
2	090223	09 国开 23	3,000,000	299,460,000.00	7.18
3	100401	10 农发 01	1,000,000	102,510,000.00	2.46
4	080215	08 国开 15	500,000	52,915,000.00	1.27
5	080311	08 进出 11	500,000	49,510,000.00	1.19

### 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.投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查情况,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受到公开谴责、处罚情况。

①根据 2009 年 9 月 9 日《宜宾五粮液股份有限公司第四届董事会公告》,该公司接到中国证监会调查通知书,因涉嫌违反证券法律法规,根据《中华人民共和国证券法》的有关规定,证监会决定立案调查。

本基金投资于“五粮液”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) 报告期末其他资产构成

序号	项目	金额(元)
1	存出保证金	3,950,014.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	120,018.82
4	应收利息	11,719,060.43
5	应收申购款	1,500,447.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-



8	其他	-
合计		17,289,540.84

## (4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110004	厦工转债	2,126,689.50	0.05
2	110007	博汇转债	774,680.00	0.02

## (5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票简称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002384	东山精密	2,983,211.43	0.07	IPO 网下锁定三个月

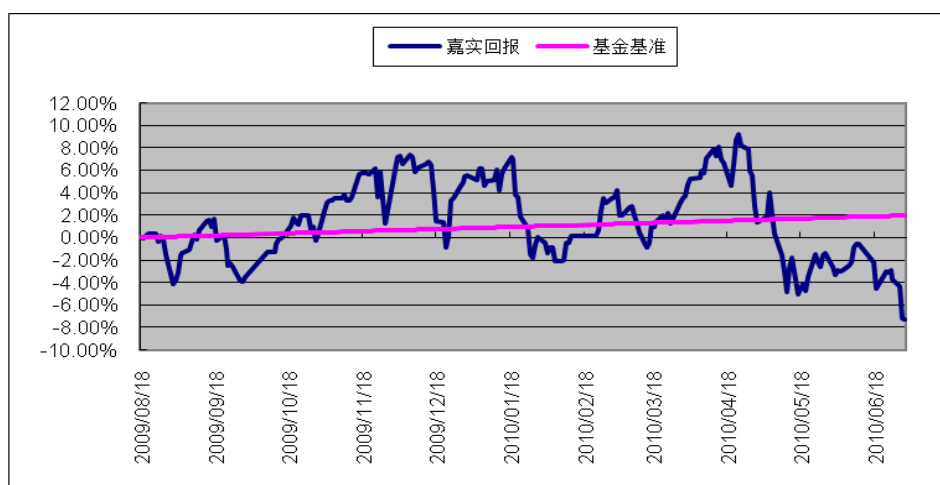
## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2010年6月30日。

## 1. 本基金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
自基金合同生效起至 2010年6月30日	-7.24%	1.14%	1.97%	0.01%	-9.21%	1.13%
2010年上半年	-12.15%	1.16%	1.12%	0.01%	-13.27%	1.15%

## 2. 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



图：嘉实回报混合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

(2009年8月18日至2010年6月30日)

注：本基金基金合同生效日2009年8月18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6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（二）投资范围和（七）2、基金投资组合比例限制）的有关约定。

### 十三、费用概览

#### （一）与基金运作有关的费用

##### 1、基金费用的种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）；
- （4）基金合同生效以后的信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金合同生效以后的会计师费和律师费；
- （7）基金的资金汇划费用；
- （8）按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

##### 2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### （1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费





E 为前一日基金资产净值

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个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

上述1、基金费用的种类中第(3)–(8)项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。

### 3、不列入基金费用的项目

本条第1款约定以外的其他费用，以及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财产的损失等不列入基金费用。处理与基金运作无关的事项发生的费用等不得列入基金费用。

### 4、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。

## (二) 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	1.5%
50 万元 ≤ M < 200 万元	1.2%
200 万元 ≤ M < 500 万元	0.8%
M ≥ 500 万元	单笔 1,000 元

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，不列入基金财产。

个人投资者通过本基金管理人直销网上交易和电话交易系统申购本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、中国建设银行龙卡、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。优惠后费率如果低于0.6%，则按0.6%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本基金，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%。

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。

## 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

(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 转换为嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金时，转换费率均为转入基金适用的申购费率，计算公式如下：

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

$$\text{转换费用} = (\text{转出份额} \times \text{转出当日转出基金的基金份额净值}) \times \text{转换费率} / (1 + \text{转换费率})$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / \text{转入当日转入基金的基金份额净值}$$

其中 M 为嘉实货币市场基金全部转出时账户当前累计未付收益

(2) 嘉实回报灵活配置混合型证券投资基金与嘉实公司旗下其他 12 只开放式基金（包括：嘉实成长收益证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式证券投资基金、嘉实服务增值行业证券投资基金、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、嘉实优质企业股票型证券投资基金、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、嘉实价值优势股票型证券投资基金）之间互转，以及嘉实回报灵活配置混合型证券投资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 时，均采用“赎回费 + 申购费率补差”算法，计算公式如下：

$$\text{净转入金额} = B \times C \times (1 - D) / (1 + G)$$

$$\text{转换补差费用} = [B \times C \times (1 - D) / (1 + G)] \times G$$

$$\text{转入份额} = \text{净转入金额} / E$$

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。

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。

### （三）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 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：增加乌鲁木齐市商业银行、渤海银行、中国光大银行、洛阳银行、华融证券为本基金代销机构，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：说明了自 2009 年 8 月 18 日本基金合同生效日至 2009 年 12 月 31 日、2010 年上半年的基金业绩。
7. 在“二十五、其他应披露事项”部分：列示了本基金自 2010 年 2 月 18 日至 2010 年 8 月 18 日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2010年10月27日