



# 嘉实优化红利股票型证券投资基金 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

嘉实优化红利股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2012年5月22日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实优化红利股票型证券投资基金募集的批复》(证监许可【2012】684号)和2012年5月24日《关于嘉实优化红利股票型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函【2012】348号)的核准进行募集。本基金基金合同于2012年6月26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。

本摘要已经基金托管人复核。本摘要所载内容截止日为2012年12月26日(特别事项注明除外),有关财务数据和净值表现截止日为2012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%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司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、南京、福州、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

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，经济学博士，中共党员。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、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总经理。

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。

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2月至2000年5月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。

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。

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。

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责任公司财务总监。

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有限公司，历任督察员和公司副总经理。

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

郭志喜先生，特许金融分析师（CFA），加拿大多伦多大学金融经济（MFE）硕士，8年证券、基金从业经历。2007年4月-2007年9月，任加拿大安省教师退休金计划（Ontario Teachers' Pension Plan）金融分析师；2008年1月至2010年1月，任加拿大道明资产管理公司（TD Asset Management）助理基金经理、基金经理，负责量化市场中性基金、量化130/30基金和量化增强型指数基金管理工作；2010年1月加入嘉实基金，先后担任机构投资部投资经理、量化投资部投资经理，负责年金和专户管理工作。具备基金从业资格。

### (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，公司总经理助理邵健先生、总经理助理詹凌蔚先生、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

注册资本：人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

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：李爱华

托管部门信息披露联系人：唐州徽

电话：(010) 66594855

传真：(010) 66594942

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，现有员工 120 余人。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、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险基金、QFII、QDII、券商资产管理计划、信托计划、年金基金、理财产品、私募基金、资金托管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，托管资产规模居同业前列。

### 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) 65185577
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	王启明		

## (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	(07 55) 25870686	传真	(0755) 2 5870663
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	(05 32) 66777766	传真	(0532) 6 6777676
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 31 3 室		
电话	(05 71) 87759328	传真	(0571) 8 7759331
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	(05 91) 88013673	传真	(0591) 8 8013670
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	章文雷		

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

**(4) 招商银行股份有限公司**

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	傅育宁	联系人	邓炯鹏
电话	(0755) 83198888	传真	(0755) 83195050
网址	www.cmbchina.com	客服电话	95555

**(5) 上海浦东发展银行股份有限公司**

注册地址	上海市浦东新区浦东南路 500 号		
办公地址	上海市中山东一路 12 号		
法定代表人	吉晓辉	联系人	倪苏云、虞谷云
电话	(021) 61618888	传真	(021) 63604199
网址	<a href="http://www.spdb.com.cn">www.spdb.com.cn</a>	客服电话	95528

**(6) 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

**(7) 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
网址	<a href="http://www.qdccb.com">www.qdccb.com</a>		
客服电话	96588 (青岛)、4006696588 (全国)		

**(8) 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
网址	<a href="http://www.hsbank.com.cn">www.hsbank.com.cn</a>		
客服电话	4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)		



**(9) 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
网址	www.lsbchina.com	客服电话	400-699-6588

**(10) 浙商银行股份有限公司**

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	毛真海
电话	(0571) 87659546	传真	(0571) 87659188
网址	www.czbank.com	客服电话	95527

**(11) 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	<a href="http://www.cbhb.com.cn">www.cbhb.com.cn</a>	客服电话	400-888-8811

**(12) 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

**(13) 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	<a href="http://www.961200.net">www.961200.net</a> <a href="http://www.4001961200.net">www.4001961200.net</a>	客服电话	4001961200

**(14) 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	<a href="http://www.bjrcb.com">www.bjrcb.com</a>	客服电话	96198
----	--	------	-------

## (15) 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	<a href="http://www.yantaibank.net">www.yantaibank.net</a>	客服电话	4008-311-777

## (16) 哈尔滨银行股份有限公司

住所、办公地址	哈尔滨市道里区尚志大街 160 号		
法定代表人	郭志文	联系人	王超
电话	0451-86779007	传真	0451-86779218
网址	<a href="http://www.hrbb.com.cn">www.hrbb.com.cn</a>	客服电话	95537

## (17) 杭州银行股份有限公司

(一) 住所、办公地址	(二) 杭州市庆春路 46 号杭州银行大厦		
(三) 法定代表人	(四) 吴太普	(五) 联系人	(六) 严峻
(七) 电话	(八) (0571) 85108309	(九) 传真	(十) (0571) 85108309
网址	<a href="http://www.hzbank.com.cn">www.hzbank.com.cn</a>	客服电话	400-888-8508

## (18) 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
网址	www.srcb.com	客服电话	(021) 962999

**(19) 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

**(20) 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	4008886666

**(21) 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

**(22) 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

**(23) 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

**(24) 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

**(25) 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

**(26) 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

**(27) 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	www.dfzq.com.cn	客服电话	95503

**(28) 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

**(29) 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	4008888111、95565

**(30) 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

**(31) 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

**(32) 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

**(33) 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

**(34) 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

**(35) 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.mszz.com	客服电话	400-619-8888

**(36) 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

**(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) 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

**(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) 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	4006666888 (0755) 33680000

**(41) 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

**(42) 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

**(43) 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	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 或致电各地营业网点

**(44) 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
网址	www.95579.com		
客服电话	95579 或 4008-888-999		

**(45) 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

**(46) 湘财证券有限责任公司**

住所、办公地址	湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11		
---------	-----------------------------------	--	--



	楼		
法定代表人	林俊波	联系人	钟康莺
电话	(021) 68634518	传真	(021) 68865680
网址	www.xcsc.com	客服电话	400-888-1551

**(47) 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

**(48) 中航证券有限公司**

住所、办公地址	南昌市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

**(49) 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
网址	www.csc.com.cn	客服电话	(0755) 83199511

**(50) 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	刘莹
电话	(029) 87416787	传真	(029) 87417012
网址	www.westsecu.com	客服电话	95582

**(51) 中信证券(浙江)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	沈强	联系人	周妍
电话	(0571) 96598	传真	(0571) 85783771
网址	<a href="http://www.bigsun.com.cn">www.bigsun.com.cn</a>	客服电话	(0571) 96598

**(52) 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	许刚	联系人	李丹
传真	(021) 50372474	客服电话	4006208888
网址	www.bocichina.com.cn		

**(53) 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

**(54) 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

**(55) 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

**(56) 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

**(57) 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

**(58) 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

**(59) 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

**(60) 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

**(61) 第一创业证券股份有限公司**

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

**(62) 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	<a href="http://www.china-invs.cn">www.china-invs.cn</a>	客服电话	400 600 8008

**(63) 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)	传真	(010) 58328748



	58328722		
网址	www.ubssecurities.com	客服电话	400-887-8827

**(64) 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
网址	www.cfsc.com.cn		
客服电话	(021) 32109999, (029) 68918888		

**(65) 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

**(66) 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

**(67) 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
网址	www.jhzq.com.cn	客服电话	400-666-2288

**(68) 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
网址	www.ajzq.com	客服电话	(021) 63340678

**(69) 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
网址	<a href="http://www.cnhbstock.com">www.cnhbstock.com</a>	客服电话	4008209898

**(70) 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
网址	<a href="http://www.rxzq.com.cn">www.rxzq.com.cn</a>	客服电话	(010) 83991888

**(71) 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
网址	<a href="http://www.hfzq.com.cn">www.hfzq.com.cn</a>	客服电话	(0591) 96326

**(72) 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		
法定代表人	高冠江	联系人	唐静
电话	(010) 63081000	传真	(010) 63080978
网址	<a href="http://www.cindasc.com">www.cindasc.com</a>	客服电话	400-800-8899

**(73) 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	联系人	梁宇
电话	(010) 58568007	传真	(010) 58568062
网址	<a href="http://www.hrsec.com.cn">www.hrsec.com.cn</a>	客服电话	(010) 58568118

**(74) 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	<a href="http://www.cf-clsa.com">www.cf-clsa.com</a>	客服电话	68777877

**(75) 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

**(76) 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
天相投顾网址	http://www.txsec.com		
天相基金网网址	http://jijin.txsec.com		
客服电话	(010) 66045678		

**(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	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	金毅
电话	(021) 61238888	传真	(021) 61238800
经办注册会计师	许康玮、金毅		

**四、基金的名称**

本基金名称：嘉实优化红利股票型证券投资基金

**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**



本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。

## 七、基金的投资范围

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），权证，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）、央行票据、短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具等固定收益类资产，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（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金资产配置范围：股票资产占基金资产的比例为60-95%；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5-40%，其中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的5%；权证市值占基金资产净值的比例不超过3%。本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的红利股票。

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

红利是投资者进行股票投资并获得投资收益的重要组成部分，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，通过严格执行投资风险管理固化和明晰基金的风格特征，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值；同时以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险；并且严格执行投资风险管理，主要通过对股票资产相对于业绩基准的跟踪误差及行业分布的偏离进行严格控制来固化和明晰基金的风格特征。

## 1、大类资产配置策略

在大类资产配置上，本基金首先参考公司投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，投资决策委员会将重点评估以下几个因素：宏观因素——包含重要经济数据以及货币和财政政策的变化；市场因素——包含货币供给指标以及流动性的变化对资本市场的影响；估值因素——包含不同市场之间的相对估值变化；同时，本基金作为主动管理的股票基金，也将参考宏观策略部门提供的研究分析建议，并结合投资组合的长期收益获取能力综合考虑作出大类资产配置决策。

在控制风险的前提下，本基金将优先配置股票资产，同时以债券和短期金融工具作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的资产配置来降低组合的系统性风险。本基金股票资产占基金资产的比例为60-95%，本基金将80%以上的股票资产投资于过去两年连续现金分红的股票。

## 2、红利股票投资策略

本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票。在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。

股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票，稳定的股息收入是当期收益的重要组成部分，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。市场的波动也为投资者进行红利再投资以获得高额复利回报提供了机会。红利策略在牛市中是锦上添花，在熊市中提供复利回报，这是红利策略能够穿越牛熊市，实现长期价值投资回报的基本逻辑。监管层提出的要求上市公司树立牢固的分红意识，上市公司采取措施完善分红政策及其决策机制，进一步加强对上市公司利润分配决策过程和执行情况监管，以及要求在公司招股说明书中细化回报规划、分红政策和分红计划是对分红理念的肯定。

本基金在股票池的选取上突出对红利股票的侧重，本基金的股票池由市场上高股息率的股票组成，不分红或低分红的股票被自动排除在股票池外。本基金根据上市公司的分红历史，选取在过去两年连续分红，过去两年累积净利润大于0的公司组成备选股票池，本基金按照股息率对备选股票池的股票进行排序，选取排名前50%的股票构成最终的红利股票池。

高红利的股票提供了高的当期回报，而红利的稳定增长决定了未来的资本利得。在一个偏重价值属性的股票库中挑选具有成长性的股票是本基金投资策略的核心。本基金通过





运用嘉实优化红利股票模型，通过选取能够体现公司的竞争优势、盈利能力、内生增长能力的因子和能够体现公司财务状况、抗周期波动能力、和分红持续性的因子，寻找基本面健康、具有技术优势、品牌优势和市场优势、内生增长能力好、财务健康、经营风险小、抗周期能力强，且能够实现稳定增长的高红利股票进行投资。

具体的，本基金主要运用下列量化指标分析上市公司的基本面特征，具体包括：

(1) 毛利率。高毛利率的公司具有一定的技术优势，品牌优势和市场优势，主要集中在壁垒较高的行业或掌握核心技术，具有技术优势，品牌优势和市场优势的细分行业龙头；

(2) ROE，即净资产收益率。高ROE公司具有较高的资本的利用效率，在没有外来融资的情况下，高ROE的公司具有高的内生增长的潜力；

(3) 业绩波动。低业绩波动的公司经营稳定，抗周期能力强，分红的持续性好；

(4) 负债率和流通比率。低负债率和高流通比率的公司财务健康、流通性好、经营风险小。

本基金将充分利用基金管理人强大的研究平台及有关团队的成果，对高红利的公司股票进行深入分析，尽力降低陷入价值陷阱的概率，从而降低投资的非系统性风险，力争提高长期的投资回报。本基金在充分考虑交易成本后，对股票组合进行优化分析，以实现风险收益的最佳匹配。

### 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，合理利用权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

### 5、风险管理策略



本基金严格执行投资风险管理,主要通过通过对股票资产相对于业绩基准的跟踪误差及行业分布的偏离进行严格控制来固化和明晰基金的风格特征。本基金将借鉴国外风险管理的成功经验如Barra多因子模型、风险预算模型等,并结合公司现有的风险管理流程,在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险,并通过调整投资组合的风险结构,来优化基金的风险收益匹配。

具体而言,在大类资产配置策略的风险控制上,由投资决策委员会及宏观策略研究小组进行监控;在行业配置策略的风险控制上,风险管理部除了监控本基金的行业偏离风险外,也会根据不同市场情况监控本基金的投资风格如大中小盘等的偏离风险并及时预警。在个股投资的风险控制上,本基金将严格遵守公司的内部规章制度,控制单一个股投资风险。

## 九、基金的业绩比较基准

中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%

## 十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,本基金属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、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。

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2013年1月15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2012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	129,587,351.33	91.35



	其中：股票	129,587,351.33	91.35
2	固定收益投资	7,024,500.00	4.95
	其中：债券	7,024,500.00	4.95
	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	4,859,256.21	3.43
6	其他资产	385,290.39	0.27
	合计	141,856,397.93	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	2,133,480.00	1.51
B	采掘业	9,388,850.05	6.66
C	制造业	57,884,936.42	41.09
C0	食品、饮料	4,236,000.00	3.01
C1	纺织、服装、皮毛	7,131,533.90	5.06
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,096,700.00	1.49
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,070,938.24	2.89
C5	电子	1,380,585.60	0.98
C6	金属、非金属	1,193,000.00	0.85
C7	机械、设备、仪表	22,505,804.00	15.97
C8	医药、生物制品	15,270,374.68	10.84
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,532,646.84	4.64
E	建筑业	1,560,000.00	1.11
F	交通运输、仓储业	8,160,426.90	5.79
G	信息技术业	1,008,900.00	0.72
H	批发和零售贸易	17,979,847.42	12.76
I	金融、保险业	16,370,663.70	11.62
J	房地产业	4,196,000.00	2.98
K	社会服务业	2,865,600.00	2.03
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	1,506,000.00	1.07
	合计	129,587,351.33	91.98

## 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	000527	美的电器	500,000	4,845,000.00	3.44
2	600859	王府井	200,000	4,792,000.00	3.40
3	600827	友谊股份	552,600	4,741,308.00	3.37
4	600221	海南航空	1,100,000	4,653,000.00	3.30
5	601918	国投新集	470,465	4,502,350.05	3.20
6	600196	复星医药	418,000	4,384,820.00	3.11
7	601607	上海医药	350,000	3,888,500.00	2.76
8	601601	中国太保	160,000	3,600,000.00	2.56
9	000417	合肥百货	500,000	3,495,000.00	2.48
10	600376	首开股份	250,000	3,280,000.00	2.33

#### 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	7,024,500.00	4.99
2	央行票据	-	-
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	-	-
	合计	7,024,500.00	4.99

#### 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	010308	03 国债(8)	70,000	7,024,500.00	4.99

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.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、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	81,280.42
2	应收证券清算款	165,221.05
3	应收股利	-
4	应收利息	62,257.81
5	应收申购款	76,531.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	385,290.39

### (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

序号	股票代码	股票名称	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	000527	美的电器	4,845,000.00	3.44	重大事项停牌

## 十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2012年12月31日。

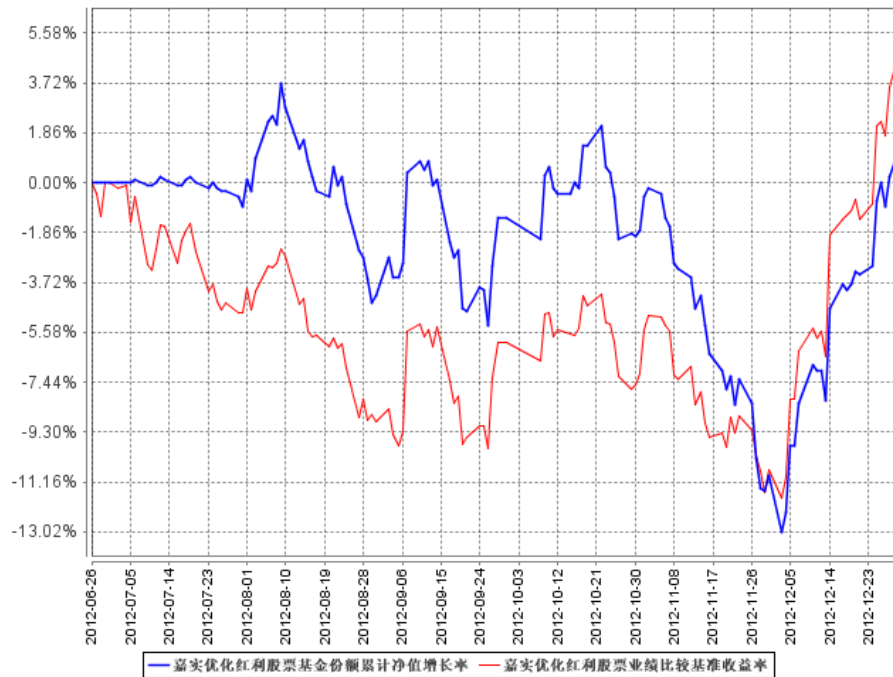
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 1. 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 (2012年6月26日)起至2012年 12月31日	1.70%	1.04%	5.56%	1.13%	-3.86%	-0.09%

### 2. 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实优化红利股票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：嘉实优化红利股票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

(2012年6月26日至2012年12月31日)

注：本基金基金合同生效日2012年6月26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“第十二部分 二、投资范围和 四、投资限制”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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

### （2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### （3）与基金运作有关的其他费用

主要包括基金合同生效以后的信息披露费用、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。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5%，具体如下：

申购金额（含申购费）	申购费率
M < 100万元	1.5%
100万元 ≤ M < 200万元	1.0%
200万元 ≤ M < 500万元	0.6%
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和电话交易系统申购开放式基金业务，其中申购费率不按申购金额分档，统一优惠为申购金额的0.6%，但中国银行长城借记卡、招商银





行借记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%。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。

投资者在一天之内如有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。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
M < 365 天	0.50%
365 天 ≤ M < 730 天	0.25%
M ≥ 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、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币、转换为嘉实优化红利股票时，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、嘉实安心货币全部转出时账户当前累计未付收益

（2）嘉实优化红利股票与嘉实公司旗下原有其他20只开放式基金（包括：嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券A、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实信用债券、嘉实领先成长股票、嘉实周期优选股票、嘉实

中创400联接)之间互转,以及嘉实优化红利股票转入嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实多元债券B、嘉实安心货币时,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(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2011年1月7日起嘉实增长混合暂停转入业务;自2011年1月7日起嘉实策略混合暂停转入业务;自2012年3月16日起,嘉实信用债券A、嘉实信用债券C单日单个基金账户单笔申购(或转入、定投)不超过500万元;2012年6月8日起,嘉实货币单日单个基金账户单笔申购(或转入、定投)不超过1亿元。具体请参见嘉实基金网站刊载的相关公告。

## (二) 不列入基金费用的项目

1、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;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露

露费用等费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### （三）费用调整

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，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：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12月26日止新增的代销机构，列示在本招募说明书，包括中国银行等家银行，中信证券等家代销机构，并更新相关代销机构信息。（待渠道部更新后填空）
5. 在“九、基金转换”部分：增加了基金转换的相关内容。
6. 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。
7. 增加“十二、基金的业绩”：说明了自2012年6月26日本基金合同生效日至2012年12月31日的基金业绩。
8. 在“二十四、其他应披露事项”部分：列示了本基金自2012年5月25日首次刊登招募说明书至2012年12月26日相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司

2013年2月8日