嘉实超短债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

重要提示

本基金基金合同于2006年4月26日正式生效,本基金类型为契约型开放式。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2012年4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3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

(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。

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

魏莉女士,金融硕士,CFA,CPA,具有基金从业资格,9年证券从业经历。曾任职于国家开发银行国际金融局,中国银行澳门分行资金部经理。2008年7月加盟嘉实基金管理有限公司,从事固定收益投资研究工作。2009年1月16日至今任嘉实货币基金经理、本基金基金经理。

(2)历任基金经理

2006年4月26日至2007年12月28日,郭林军先生任本基金基金经理职务。

2006年10月28日至2010年3月11日,吴洪坚先生任本基金基金经理职务。

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
变更注册登记日期:2004年8月26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

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、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	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) 中国建设银行股份有限公司

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	王洪章		
网址	www.ccb.com	客服电话	95533

5) 交通银行股份有限公司

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

6) 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

(7)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	www.spdb.com.cn	客服电话	95528

(8)兴业银行股份有限公司

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

(9)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

(10)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

(11)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

(12)北京银行股份有限公司

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		
法定代表人	闫冰竹	联系人	谢小华
电话	(010)66223587	传真	(010)66226045
网址	www.bankofbeijing.com.cn	客服电话	95526

(13)平安银行股份有限公司

住所、办公地址	深圳市深南中路1099		
法定代表人	孙建一	联系人	芮蕊
电话	(0755)25841098	传真	(0755)25879756
网址	http://bank.pingan.com	客服电话	95511-3

(14)宁波银行股份有限公司

住所	宁波市鄞州区宁南南路700号		
办公地址	宁波市鄞州区宁南南路700号		
法定代表人	陆华裕	联系人	胡技勋
电话	(0574)89068340	传真	(0574)87050024
网址	www.nbcb.com.cn	客服电话	96528,962528上海、北京地区

(15)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	www.qdccb.com		
客服电话	96588(青岛)、4006696588(全国)		

(16)中国光大银行股份有限公司

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	朱红
电话	(010)63636153	传真	010-683636157
网址	www.cebbank.com	客服电话	95595

(17)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
网址	www.dongguanbank.cn	客服电话	(0769)96228

(18)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	www.hsbank.com.cn		
客服电话	4008896588(安徽省外)、96588(安徽省内)		

(19)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

20)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

(21)江苏银行股份有限公司

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)58587018	传真	(025)58587038
网址	www.jsbchina.cn	客服电话	(025)96098、4008696098

(22)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

(23)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

(24)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

(25)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

(26)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

(27)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

(28)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		
办公地址	浙江省杭州市延安路128号		
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

(29)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	www.hrbb.com.cn	客服电话	95537

(30)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

(31)中信银行股份有限公司

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	田国立	联系人	丰靖
网址	bank.ecitic.com	客服电话	95558

(32)南京银行股份有限公司

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	翁俊
电话	(025)84544021	传真	(025)84544129
网址	www.njcb.com.cn	客服电话	4008896400

(33)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	詹全鑫、张扬眉
电话	(020)38322256	传真	(020)87310955
网址	www.gdb.com.cn		
客服电话	800-830-8003、400-830-8003		

(34)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
网址	www.hzbank.com.cn	客服电话	400-888-8508

(35)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
网址	www.wzbank.cn	客服电话	(0577)96699

(36)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

(37)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

(38)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

(39)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

(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	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

(41)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

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)84183389	传真	(010) 84183311-3389
网址	www.guodu.com	客服电话	400-818-8118

43)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

44)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

45)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

46)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

47)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

48)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

49)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

50)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

51)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

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)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

54)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.mszq.com	客服电话	400-619-8888

55)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	天津市南开区宾水西道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

56)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

57)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	许嘉行
电话	(0571)87901912	传真	(0571)87901913
网址	www.stocke.com.cn	客服电话	(0571)967777

58)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

59)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

60)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

61)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

62)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

63)广发证券股份有限公司

住所	广州天河北路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

64)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		

65)国海证券有限责任公司

住所、办公地址	广西桂林市辅星路13号		
法定代表人	张雅锋	联系人	牛孟宇
电话	0755-83709350	传真	0755-83700205
网址	www.ghzq.com.cn	客服电话	95563(全国)

66)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

67)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

68)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

69)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

70)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.csco.com.cn	客服电话	(0755)83199511

71)西部证券股份有限公司

住所、办公地址	陕西省西安市东新街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

72)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

73)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

74)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	www.bigsun.com.cn	客服电话	(0571)96598

75)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		

76)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

77)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

78)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

79)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

80)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

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)8784656	传真	(0931)4890628
网址	www.hlzqgs.com	客服电话	(0931)4890208、(0931)4890619

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)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

84)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

85)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

86)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

87)财通证券有限责任公司

住所、办公地址	杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心		
法定代表人	沈继宁	联系人	乔骏
电话	(0571)87925129	传真	0571-87818329
网址	www.ctsec.com	客服电话	(0571)96336,962336(上海地区)

88)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

89)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

90)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

91)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		

92)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

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
网址	www.e5618.com	客服电话	400-889-5618

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)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

96)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

97)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	www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

98)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
网址	www.foundersc.com	客服电话	95571

99)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	刘晓章
电话	(0755)83007069	传真	(0755)83007167
网址	www.ydsc.com.cn	客服电话	4008-698-698

(100)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	陈诚
电话	(023)63786464	传真	(023)63786311
网址	www.swsc.com.cn	客服电话	4008096096

(101)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	www.rxzq.com.cn	客服电话	(010)83991888

(102)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	www.hfzq.com.cn	客服电话	(0591)96326

(103)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	www.cindasc.com	客服电话	400-800-8899

(104)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	徐勇力	联系人	汤漫川
电话	(010)66555316	传真	(010)66555246
网址	www.dxzq.net.cn	客服电话	400-8888-993

(105)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	www.hrsec.com.cn	客服电话	(010)58568118

(106)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

(107)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

(108)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

(109)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	马强
电话	(010)65051166	传真	(010)85679535
网址	www.ciccs.com.cn		
客服电话	(010)85679238;(010)85679169		

(110)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)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		

(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	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:嘉实超短债证券投资基金

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

本基金通过控制投资组合的久期不超过一年,力求本金稳妥,保持资产较高的流动性,降低基金净值波动风险,取得超过比较基准的稳定回报。

七、基金的投资方向

本基金投资范围为固定收益类金融工具,具体包括国债、金融债、信用等级为投资级及以上的企业债和次级债券等;债券回购;央行票据、银行存款、资产支持证券以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金不投资于可转换债券。

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

本基金主要目标是在保持传统货币市场基金的本金稳妥、高流动性特点的同时,通过适当延长基金投资组合的久期,投资于期限稍长的固定收益工具,获取更高的投资收益。因此本基金的投资策略也是在货币市场基金投资策略基础上的增强型投资策略,一方面将基金的大部分资产投资于货币市场工具,保持基金资产的高流动性,同时提供稳定的收益;另一方面,通过价值挖掘,将一小部分资产投资于收益率较高的固定收益类投资工具,比如投资级的企业债、金融债、次级债、浮动利率债等,为基金资产提供超额收益。本基金的投资策略主要包括:

1、久期策略

为了保持本基金明显的收益-风险特征,本基金的久期保持大于0.5年,小于1年。在分析宏观经济指标(主要包括:市场资金供求、利率水平和市场预期、通货膨胀率、GDP增长率、货币供应量、就业率水平、国际市场利率水平、汇率)和财政货币政策等的基础上,对未来较长的一段时间内的市场利率变化趋势进行预测,决定组合的久期,并通过不同债券剩余期限的合理分布,有效地控制利率波动对基金净值波动的影响,并尽可能提高基金收益率。

2、收益率曲线策略

收益率曲线策略是基于对收益率曲线变化特征的分析,预测收益率曲线的变化趋势,并据此进行投资组合的构建。收益率曲线策略有两方面的内容,一是收益率曲线本身的变化,根据收益率曲线可能向上移动或向下移动,降低或加长整个投资组合的平均剩余期限。二是根据收益率曲线上不同年限收益率的息差特征,通过骑乘策略,投资于最有投资价值的债券。

3、买入持有策略

本基金的投资对象主要是短期的固定收益类投资工具,一般情况下,本基金对这些短期固定收益投资工具,采取买入持有策略,以便降低基金净值的波动性。

4、相对价值挖掘策略

本基金在主要投资于货币市场工具的同时,深入挖掘市场上各类固定收益型投资产品由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级意外变化等情况造成的短期内市场失衡;新股、新债发行以及节日效应等因素导致的市场资金供求发生短时失衡等。这种失衡将带来一定投资机会。通过分析短期市场机会发生的动因,研究其中的规律,据此调整组合配置,改进操作方法,积极利用市场机会获得超额收益。

5、无风险套利策略

本基金将充分利用投资范围广泛的特点,寻找各类可投资工具之间存在的无风险套利机会,比如跨市场套利、跨品种套利等。

本基金在投资过程中,将综合运用多种投资策略,使投资组合产生持续稳定的回报,而不是仅仅依赖某一种投资策略。在投资的过程中,即使通过价值挖掘发现某只债券具有较高的投资价值,也不在单只债券上暴露过多的风险,而是将风险分散到多只债券上,每只债券只承担较小的风险。同时我们还将通过数量模型,分析个券、类属债券直至整个投资组合的风险-收益特征,并在二者之间做到有效平衡。

九、基金的业绩比较基准

一年期银行定期储蓄存款的税后利率。

十、基金的风险收益特征

本基金预期的风险水平和预期收益率高于货币市场基金,低于中长期债券基金、混合基金、股票基金。

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2012年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2012年3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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,168,810,980.40	85.07
	其中:债券	1,168,810,980.40	85.07
	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	182,682,104.39	13.30
6	其他资产	22,517,375.34	1.64
	合计	1,374,010,460.13	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金禁止投资于股票。

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

本基金禁止投资于股票。

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	48,350,000.00	4.54
3	金融债券	222,032,000.00	20.86
	其中:政策性金融债	222,032,000.00	20.86
4	企业债券	161,756,980.40	15.20
5	企业短期融资券	736,672,000.00	69.21
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
	合计	1,168,810,980.40	109.80

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	100236	10国开36	1,000,000	100,910,000.00	9.48
2	041151002	11中石油CP002	500,000	50,700,000.00	4.76
3	1181358	11中广核CP03	500,000	50,580,000.00	4.75
4	041151011	11中石油CP003	500,000	50,380,000.00	4.73
5	041253005	12中粮CP001	500,000	50,240,000.00	4.72

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)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	22,285,575.34
5	应收申购款	231,800.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,517,375.34

(3)投资组合报告附注的其他文字描述部分

①本基金的基金份额净值的计算,精确到0.0001元,小数点第五位四舍五入。

②基金估值:在证券交易所市场,实行净价交易的债券按估值日收盘净价估值,未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;未上市债券采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量的情况下按成本估值;在银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种,采用估值技术确定公允价值;同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值;其他资产按照国家有关规定或行业约定进行估值。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2012年3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
2006年4月26日至2006年12月31日	1.22%	0.01%	1.30%	0.00%	-0.08%	0.01%
2007年	4.01%	0.03%	2.78%	0.01%	1.23%	0.02%
2008年	5.41%	0.11%	3.77%	0.01%	1.64%	0.10%
2009年	0.65%	0.02%	2.25%	0.01%	-1.60%	0.01%
2010年	1.57%	0.03%	2.30%	0.01%	-0.73%	0.02%
2011年	3.56%	0.04%	3.28%	0.01%	0.28%	0.03%

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

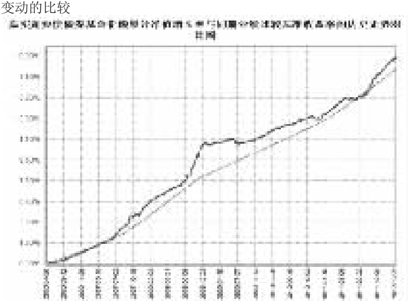

图:嘉实超短债债券基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006年4月26日至2012年3月31日)

注:按基金合同规定,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十三(八)投资组合限制的约定:(1)基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;(2)在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不展期;(3)在银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%;(4)投资组合的久期在每个交易日均不得超过一年;(5)持有的剩余期限在397天以内的债券、现金、剩余期限在14天以内的回购余额不低于基金资产净值的20%;(6)投资于除国债、政策性金融债之外的其他债券的规模不得超过该债券发行总量的5%,投资于同一公司发行的债券、短期融资券等的比例合计不得超过基金资产净值的10%;(7)中国证监会规定的其他比例限制。

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

基金管理费按基金资产净值的0.41%年费率计提,计算方法:

H=E×0.41%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后于次月前十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0.14%年费率计提,计算方法:

H=E×0.14%÷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

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月前十个工作日内从基金财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

主要包括证券交易费用、基金合同生效后的基金信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费。该等费用由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

(1)申购费:本基金的申购费率为零

(2)赎回费:本基金的赎回费率为零

(3)基金转换费率

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。本基金的转换费率按照如下方式收取:

①由嘉实超短债债券转出至嘉实成长收益混合、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、嘉实主题混合、嘉实策略混合,嘉实优质企业股票、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、嘉实主题新动力股票、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实领先成长股票、嘉实信用债券A、嘉实周期优选股票、嘉实中创400ETF联接基金,转换费为转入基金适用的申购费。

基金转换份额的计算方式如下:

净转入金额=(转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值)/(1+转换费率)

转换费用=(转出份额×转出当日转出基金的基金份额净值)×转换费率/(1+转换费率)

转入份额=净转入金额/转入当日转入基金的基金份额净值

②由嘉实成长收益混合、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、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实优质企业股票、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、嘉实领先成长股票、嘉实信用债券A/C、嘉实周期优选股票、嘉实中创400ETF联接基金转出至嘉实超短债债券,转换费=转出金额×转出基金的适用赎回费率,该等转换费的25%计入转出基金的基金资产,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)。

③嘉实超短债债券与嘉实货币、嘉实多元债券B、嘉实安心货币互换时,嘉实超短债债券转入嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券C时无转换费用。

注:自2010年5月26日起,暂停嘉实主题混合的转入业务;自2011年1月7日起暂停嘉实增长混合的转入业务;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。

(4)基金的销售服务费

基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提,计算方法:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金销售服务费
E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月的前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,由基金管理人相应支付给基金销售机构。

(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,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(三)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费、基金托管费、销售服务费,经中国证监会核准后公告;此项调整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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对基金管理人于2006年3月27日刊登的本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金合同生效之日后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新。

主要更新内容如下:

1. 在“重要提示”部分:明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2.在“三、基金管理人”部分:更新了基金管理人的相关信息。

3.在“四、基金托管人”部分:更新了托管人的相关信息。

4.在“五、相关服务机构”部分:增加华夏银行、财富里昂证券2家代销机构为本基金代销机构,并更新相关代销机构信息。

5.在“十一、基金的投资”部分:增加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2006年4月26日至2006年12月31日、2007年度、2008年度、2009年度、2010年度、2011年基金业绩。

7.在“二十五、其他应披露事项”部分:增加2011年10月26日至2012年4月26日本基金的相关临时公告事项。

嘉实基金管理有限公司
2012年6月27日

嘉实优化红利股票型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2012年6月27日

1 公告基本信息

基金名称	嘉实优化红利股票型证券投资基金
基金简称	嘉实优化红利股票
基金主代码	070032
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年6月26日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《嘉实优化红利股票型证券投资基金基金合同》、《嘉实优化红利股票型证券投资基金招募说明书》

2 基金募集情况

基金名称	证监许可[2012]684号	
基金募集期间		自2012年5月28日至2012年6月21日止
验资机构名称		普华永道中天会计师事务所有限公司
募集资金划入基金托管专户的日期		2012年6月26日
募集有效认购总户数(单位:户)		3,228
募集期间净认购金额(单位:元)		588,539,419.72
认购资金在募集期间产生的利息(单位:元)		76,891.19
募集份额(单位:份)	有效认购份额	588,539,419.72
	利息结转的份额	76,891.19
	合计	588,616,310.91
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	0
	占基金总份额比例	0%
	其他需要说明的事项	无
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	6,920.78
	占基金总份额比例	0.0012%
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2012年6月26日

注:本基金基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由本基金管理人承担,不从基金资产中支付。

3 其他需要提示的事项

根据嘉实优化红利股票型证券投资基金招募说明书、基金合同的有关规定,嘉实优化红利股票(基金代码:070032)的申购、赎回自基金合同生效后不超过3个月的时间内开始办理,基金管理人应在开始办理申购、赎回的具体日期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

销售机构受理投资人认购申请并不代表该申请成功,申请的成功与否须以本基金注册登记人的确认结果为准。基金份额持有人可以到本基金销售机构的网点查询交易确认情况,也可以通过本基金管理人的网站(www.jsfund.cn)或客户服务电话400-600-8800查询交易确认情况。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2012年6月27日