法股票型证券投资基金更新招募说

	=	لرجيا		† /1.1	
	ヺ	品当	卡 直	責化	则 牙
		其全科管人,由国	实基金管理有限公	公司	住所、办公地址
		票型证券投资基金(以下 比阿尔法股票型证券投 于2009年3月20日起生效	简称"本基金")根据 资基金募集的批复 ,自该日起基金管理 重要提示	公司 2008年12月18日中国证券监督管 《证监许可 2008 1424号)核准进 人正式开始管理本基金。	理 法定代表人 电话 网址 (18) 廠商银行股份看
基金的过行	王业绩开	申购本基金时应认真阅 不预示其未来表现。 司和基金招募说明书编写 (件。基金投资人自依基 (金份额的行为本身即表	7 并仅由国际协会	核准。基金合同是约定基金当事 新,即成为基金份额持有人和本基 承认和接受,并按照《征券投资基 金投资人欲了解基金份额持有人!	住所、办公地址
权利和义务,应 基金管理/ 完盈利 也不保	、详知宣院 人承诺依明 证是任的	雑五日回。 照恪尽职守、诚实信用、i rtd	M慎勤勉的原则管理	即运用基金资产,但不保证基金	网址
本摘要已经 财务数据和净值 (一)基金管 1.基本情况	育理人概?	_	N容献止日万2013年 ₹经审计)。 • 、基金管理人	59月20日 特别事项注明除外),有	关 09 临商银行股份有 住所、办公地址 法定代表人 电话
名称 注册地址 办公地址	嘉实基 上海市 北京市	金管理有限公司 浦东新区世纪大道8号 建国门北大街8号华游		期23楼01-03单元	网址 20)杭州银行股份和 住所、办公地址
法定代表人 总经理 成立日期		3月25日			法定代表人 电话 网址 21 温州银行股份看
注册资本 股权结构 存续期间		托有限责任公司40%。 责任公司30%。	德意志资产管理	(亚洲)有限公司30%,立信投	住所 办公地址 法定代表人
电话 传真 联系人	(010)6 (010)6 胡勇钦	5215588 5185678			电话 网址 (22)上海农村商业等 全
嘉实基金管理公司获得首批全国 高获得首批全国	7 A THE	公司经中国证监会证监禁 注册地上海,总部在北京 金、企业年金投资管理人 公司无任何受处罚记录。	語字 [1999] 5号文批》 并设深圳、成都、杭州、QDII资格和特定资	作,于1999年3月25日成立,是中外 州、青岛、南京、福州、广州分公司。 济产管理业务资格。	合 住所 办公地址 法定代表人 电话
1.基金管理 安奎先生, 处处长、香港吉 投资公司总经理	E人董事、 董事长, 信有限公 里;中诚信	监事、总经理及其他高级 大学本科,中共党员,曾代 、司总经理;吉林省证券 ;托有限责任公司副总经	管理人员基本情况 E吉林农业机械研究 公司总经理;东北证 理。2011年8月5日	:所主任;吉林省信托投资公司外 :券有限责任公司监事长;吉林天 已任嘉实基金管理有限公司董事也	
赵学军先生 器进出口总公司、大成基金管 高方先生。	生,董事、后司、北京商 理有限公 董事,大	总经理,中共党员,经济等品交易所、天津纺织原、司。2000年10月至今任 学本科,中共党员,高级经	学博士。曾就职于天 材料交易所、商鼎期 嘉实基金管理有限。 圣济师。曾任中国建	所主任:吉林省信托投资公司外 券有限责任公司选事长:吉林天 已比离实基金曾拥有限公司或事件 请她信行"都公司、外交贸部中国 投资经有限公司、北京证券有限 公司董弟。总经现4、分企服务运 投银行总行副处长、分企服务运 公司总裁助理、副总裁、现任中城 专业、Frankfurt Business School	次 法定代表人 电话 の址 6 24 紅苏银行股份名
Economics)	任徳意志	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	路 由任
? Mark Cu Oarlington Con 全球股票投资的 韩家乐先生	illen先生, mmodities 彩首席运 生,董事。1	董事,澳大利亚籍,澳大)商品交易主管,贝恩 Ba 官官、MD。现任德意志的 1990年毕业于清华大学经	利亚莫纳什大学经 in&Company 期货与 客产管理(纽约)全球 经济管理学院,硕士	济政治专业学士。曾任达灵顿商 商品部负责人、德意志银行(纽约 首席运营官、MD。 研究生。1990年2月至2000年5月任 公司总经理;2001年11月至今任立	品 図址 25 写鲁木齐商业領
				公司总经理;2001年11月至今任立 社。曾任职于中国建设银行辽宁 分析师、美国世界银行顾问,中国 任万盟并购集团董事长。 大学商学院博士。曾任上海交通	
子切刀が「大阪工人	宝宗敦师	,上海父理人子百理子》	定的 叙坛、的凡坛。	1997年王学世中队国际工间学院:	\$X
任中国证监会; 任清华大学商; 朱蕾女士, 员,国都证券有	年购重组 去研究中 监事,中与 限责任公	事核委员会第一、二届委 心副主任、法学院副教授 块党员,硕士研究生。曾 、司高级经理,中欧基金	员,2000年至今历日 任首都医科大学教则 管理有限公司发展	学院博士后研究人员、授课教育,清学大学法学院讲师、副教授。 请学大学法学院讲师、副教授。 市,中国保险监督管理委员会主任 战略官、北京代表处首席代表、董 组。 助教、长安信息产业、展团 职份有 6年公司投资有限公司财务总监 金管理有限公司财务总监	法定代表人 科 电话 网址
会秘书。2007年 穆群先生, 公司董事会秘 王利刚先生 逐源郊 压压人	F10月至4 监事,经治 持,北京德 住,监事,结	今任中诚信托有限责任么 齐师,硕士研究生。曾任 地有限责任公司财务主 圣济学学士。2001年2月 国口时、白的	公司国际业务部总经 西安电子科技大学E 管。2001年11月至《 至今,就职于嘉实基	·理。 助教,长安信息产业 (集团)股份有 今任立信投资有限公司财务总监。 f金管理有限公司综合管理部、人	限 27 路阳银行股份和 住所、办公地址 2 法定代表人
宋振茹女 局。1996年11月 理公司总经理即	上,副总经 至1998年 切理。199	理,中共党员,硕士研究 57月于中国银行海外行的 9年3月至今任职于部实	生,经济师。1981年 等理部任副处长。19 基金管理有限公司。	6月至1996年10月任职于中办警 998年7月至1999年3月任博时基金 历任督察员和公司副总经理。 東京其全際明春県公司研究領國	型
监、市场部总监 戴京焦女 投资银行部总统 集团投资审批。	、公司督 上,副总经 圣理、平安 委员会委	聚长。 ·理,武汉大学经济学硕士 ·保险集团公司资产管理 ·景。2004年3月加盟嘉实	上,加拿大大不列颠 部副总经理兼负责 部副总经理兼负责	新來雜並自理有限公司可先申明 時伦比亚大学MBA。历任平安证 人;平安证券公司助理总经理,平 曾任公司总经理助理。 学法学院、北京市陆通联合律师事 ,管理有限公司法律部总监。	法定代表人 等安 电话
王炜女士, 所、北京市智浩 2、基金经廷 () 现任基 陶羽,高级	ロ祭长,「 律师事务 里 金経理 定量分析	一不元以,法字顿士。曾 所、新华保险股份有限公 师,硕士。9年证券以业约	公司。曾任嘉实基金 经历。2004—2005年尚	学法学院、北京市陆通联合律师事 管理有限公司法律部总监。 在美国高盛公司定量分析师,200 2009年3月20日至今任本基金基金	9 加 (29)北京农村商业等 住所 か公地址
理。	全经理.2	2000年3日20日至2010年6	日17日王永安朱生	任木材全材全经理	由话
投资决策。 生、总经理助理 理陈勤先生。 上述人员。	受员会的)角凌崩先 之间均不在	存在近亲属关系。	区学军先生、副总经 张自力先生、机构书 、基金托管人	理戴京焦女士、总经理助理邵健 资资部总监党开宇女士、资深基金	法定代表人
←)基金抄 名称:中国 注册地址: 成立时间:	工商银行 北京市西 1984年1月	本情况 F股份有限公司 i城区复兴门内大街55号 目1日	、差並代官人		电话 网址 (31)斯江稠州商业领住所
法定代表/	√:要建清 √:要建清	0 018 545 827⊞			办公地址
截至2013年 学本科以上学师 任)基金打	への何の F6月末、F 万、高管人 七管业务約 と時4年等	中国工商银行资产托管; 员均拥有研究生以上学 经营情况 服务的先行表 中国工商	都共有员工163人, 历或高级技术职称 銀行自1998年在同	平均年龄30岁,95%以上员工拥有。	大 网址 62 哈尔滨银行股份
实信用、勤勉尽 统和专业的服务 提供安全、高效 熟的产品线。	赛"的景 务团队,严 、专业的护 用有包括证	后,依靠严密科学的风险 格履行资产托管人职责 毛管服务,展现优异的市 正券投资基金、信托资产	管理和内部控制体 ,为境内外广大投资 场形象和影响力。 、保险资产、社会保	平均年齡30岁,95%以上员工拥有 内育家條件杆體服务以来,重求 與海的質關原文。先結的效益 後,通線於一體關係之一。 起了「国内托曾縣行中提手茲,最 環接金、安克斯子協金、企业全 近對公司定的於一質照上划,應 SEGROW等)是交合的民管的 提供了一個化的任實服务。 32、千度区31以、自2003年以 21、美國 各球金融入內地 征停 大獎,提供來與 企业保 大獎,是數科獎頭最多的国內托	望然 住所、办公地址 注定代表人 电话
金、OFII资产、O 银行信贷资产的 系,同时在国内 至2013年6月,中	DII资产、 正券化、排 率先开展 中国工商销	股权投资基金、证券公司 基金公司特定客户资产等 是债效评估、风险管理等地 银行共托管证券投资基金	集合资产管理计划 育理、QDII专户资产 曾值服务,可以为各 2314只,其中封闭式	、证券公司定向资产管理计划、商 ESCROW等门类齐全的托管产品 类客户提供个性化的托管服务。 3只,开放式311只。自2003 年以3	业 阿址 (33) 床莞农村商业管 住所 办公地址
本行建築丁平 报》、《上海证券 银行,优良的服	次(等質) 报)等境) () 务品质获 () 網 发 售材	を	化百八人百港 制度 940项最佳托管银行 续认可和广泛好评 相关服务机构	(大美国 怀珠玉献人内地 证券 大奖;是获得奖项最多的国内托。	管 法定代表人 电话
1.直销机构	金管理有 北京	限公司直销中心 市朝阳区建国路91号)65215588	号金地中心A座6		(34)上海银行 住所、办公地址 法定代表人
联系人 2 鷹宝基 办公地址	赵虹 金管理有	限公司上海直销中心		心二期23楼01-03单元	电话 网址 05 阿北银行股份和 住所、办公地址
电话 联系人 (3)腐实基	鲍东 金管理有	限公司成都分公司		(021)68880023	法定代表人 电话 网址
办公地址 电话 联系人	(028 王启		号城市之心30H 传真	(028)86202100	96) 短商银行股份看住所、办公地址 法定代表人 电话
4)磨实基 办公地址 电话 联系人	深圳	限公司深圳分公司 市福田区中心四路 5)25870686	号嘉里建设广场 传真	7T1-1202 (0755)25870663	网址
5 處实是 办公地址 电话	金管理有 青岛	限公司青岛分公司 市市南区香港中路1 2)66777766	0号颐和国际大 传真	夏A座3502室 (0532)66777676	97)嘉实财富管理在 住所
联系人 6)屬实基 办公地址	陈建 金管理有 杭州	林 限公司杭州分公司 市西湖区杭大路15 ^長			办公地址 法定代表人
电话 联系人 φ)腐实基金管 办公地址	徐莉 理有限公	1)87759328 莉 司福州分公司 市鼓楼区五四路158	传真 号环球广场25层	(0571)87759331	电话 网址 (88)杭州联合农村港
地话 联系人 8)磨实基		1)88013673 锋	传真	04早元 (0591)88013670	住所、办公地址 法定代表人 电话
办公地址 电话 联系人	南京	(市白下区中山东路2 5)66671118	288号新世纪广场 传真	6A座4202室 (025)66671100	网址 69)万银财富 (北京 办公地址 注册地址
9 處实是 办公地址 电话	金管理有	限公司厂州分公司 市天河区天河北路)87555163	183号大都会广场	が2415-2416室 (020)81552120	法定代表人电话
联系人 2.代销机构 (1) 中国 住所、办公地	庄文 J 国工商银行 地	胜 行股份有限公司 北京市西城区复兴(口内大街55号		40)上海好买基金管 办公地址 注册地址
法定代表人电话	Alla	姜建清 95588 www.icbe.com.cn	联系人 传真 客服电话	刘业伟 (010)66107914 95588	法定代表人 - 电话 网址
(g) 中国 住所、办公地 法定代表人		了股份有限公司 北京市东城区建国(蒋超良	门内大街 69 号 联系人	滕涛	(#1) 沖信证券股份看 住所、办公地址 法定代表人 电话
电话 网址 (3) 中 办公地址	国银行股份	(010)85108227 www.abchina.com 分有限公司 北京市西城区复兴门	传真 客服电话	(010)85109219 95599 銀行草行办公士楼	网址 42 》厂发证券股份和 住所
注册地址法定代表人电话		北京市西城区复兴门田国立 (010)66596688		(010)66594946	办公地址 法定代表人 电话
网址 (4) 中国 住所	国建设银行	www.boc.en 可股份有限公司 北京市西城区金融	客服电话 大街25号	95566	网址 (43)中信建投证券服 住所
办公地址 法定代表人 网址	~81Z~81Z	北京市西城区闹市口 王洪章 www.ceb.com	口大街1号院1号楼 客服电话	95533	办公地址 法定代表人 电话
(5) 招紹 住所、办公地 法定代表人 电话	智银行股位 址	分有限公司 深圳市深南大道7088 傅育宁 (0755)83198888	号招商银行大厦 联系人 传真	邓炯鹏 (0755)83195050	网址 (44)海通证券股份和 住所
网址 (6) 交迫 办公地址	重银行股份	www.cmbchina.com 分有限公司 上海市银城中路188	客服电话	95555	办公地址 法定代表人 电话
注册地址 法定代表人 电话		上海市银城中路188 牛锡明 021-58781234	联系人 传真	曹榕 021-58408483	网址 45 X申银万国证券形 住所、办公地址
内址 り 上記 办公地址 注册地址	阿浦东发展	www.bankcomm.com 展银行股份有限公司 上海市中山东一路1: 上海市浦东新区浦东		95559	法定代表人 电话 网址
法定代表人 电话 网址		吉晓辉 (021)61618888 www.spdb.com.cn	联系人 传真 客服电话	高天、虞谷云 (021)63604199 95528	46 国泰君安证券服 住所 办公地址 法定代表人
住所、办公地 法定代表人	国民生银行 址	行股份有限公司 北京市西城区复兴 董文标 (010)58560666	门内大街2号 联系人 传真	董云巍	住住 (表代 电话 网址 (47)中国银河证券服
电话 网址 9) 中信 住所、办公地	言银行股份	www.embc.com.en	客服电话	(010)57092611 95568 大厦C座	住所、办公地址 法定代表人 电话
法定代表人 网址 (10)华夏银	見行股份不	常振明 bank.ecitic.com 有限公司	联系人 客服电话	丰靖 95558	网址 (48)兴业证券股份有 住所 办公地址
住所、办公地 法定代表人 电话	址	北京市东城区建国门 吴建 010-85238667	联系人 传真	郑鹏 010-85238680	法定代表人 电话 网址
网址 (11)北京領 住所 办公地址	7	www.hxb.com.en 有限公司 比京市西城区金融大街 比京市西城区金融大街	丙17号	95577	(49) 招商证券股份和 住所、办公地址 法定代表人
法定代表人 电话 网址	(v	司冰竹 (010)66223587 www.bankofbeijing.com.c	联系人 传真	谢小华 (010)66226045 95526	电话 网址 (80) 华泰证券股份有
(12)半安银 住所、办公地 法定代表人 电话		写限公司 广东省深圳市深南充 肖遂宁 0755-22166118	联系人 传真	展银行大厦 张青 0755-82080406	住所 办公地址
网址 (13)宁波银 住所、办公地		www.bank.pingan.con 有限公司 宁波市鄞州区宁南西	客服电话 南路700号	95511-3成95501	法定代表人 电话
法定代表人 电话 网址		陆华裕 (0574)89068340 www.nbcb.com.cn	联系人 传真 客服电话	胡技助 (0574)87050024 96528,962528 上海、 北京地区	网址 61 长城证券有限责 住所 办公地址
(4)青岛領住所、办公地 法定代表人	限行股份? 址			北京地区	住所、办公地址 法定代表人 电话
电话 网址		68602127 www.qdccb.com	传真 客服电话	85709799 96588 (青岛)、 4006696588(全国)	网址 62 粗都证券有限责 住所、办公地址
(15)中国》 注册地址 法定代表人	光大银行	股份有限公司 北京市西城区复兴[唐双宁	联系人	大厦	法定代表人 电话 网址
电话 网址 (16)南京银 住所、办公地	見行股份不 計	(010)63636153 www.cebbank.com 限公司 南京市白下区淮海區	传真 客服电话	010–683636157 95595	63)华福证券有限责 住所 办公地址
住所、办公地 法定代表人	-CIL	南京市日下区准海道 林复 (025)84544021	路50号 联系人 佐吉	翁俊 (025)84544129	法定代表人 电话

住所、办公地址 法定代表人 电话	东莞市城区运河东- 廖玉林 (0769)22119061	一路193号 联系人 传真	巫渝峰 (0769)22117730
网址 (18)徽商银行股份 主所、办公地址	www.dongguanbank.e 分有限公司 安徽省合肥市安庆国 王晓昕	各 79 号天徽大厦A座	
法定代表人 电话 网址	主時刊 (0551)2667635 www.hsbank.com.cn	联系人 传真 客服电话	叶卓伟 (0551)2667684 4008896588 (安徽省 外)、96588 (安徽省
(19)临商银行股份 住所、办公地址	山东省临沂市沂蒙趵	8336号 联系人	内)
法定代表人 电话 网址	王嫁玉 (0539)8304657 www.lsbchina.com	快系人 传真 客服电话	寇廷柱 (0539)8051127 400-699-6588
20)杭州银行股份 住所、办公地址 法定代表人 电话	杭州市庆春路46号标 吴太普 (0571)85108309	於系人 (本) (本)	严峻 (0571)85108309
双址	www.hzbank.com.cn 分有限公司 温州市车站大道华海	客服电话	400-888-8508
办公地址 法定代表人 电话	温州市车站大道196 邢増福 (0577)88990082	野系人 传真	林波 (0577) 88995217
网址 (22)上海农村商》 注所	www.wzbank.cn 业银行股份有限公司 上海市浦东新区浦茲		(0577)96699
办公地址 法定代表人 电话	上海市银城中路8号 胡平西 (021)38576977	联系人 传真	吴海平 (021)50105124
网址 23 断商银行股份 住所、办公地址 法定代表人	www.srcb.com 分有限公司 浙江省杭州市庆春日 张达洋	客服电话 8288号 联系人	(021)962999
去走代表人 电话 网址 24 紅苏银行股份	(0571)87659546 www.czbank.com	传真 客服电话	毛真海 (0571)87659188 95527
生所、办公地址 法定代表人 电话	南京市洪武北路55 ⁻¹ 黄志伟 (025)58587018	野系人 传真	田春慧 (025)58587038
型店 网址 25 冯智木齐商》	www.jsbchina.cn 世银行股份有限公司	客服电话	(025)96098 (026)96098 (026)96098
住所 か公地址 法定代表人	乌鲁木齐市新华北路 乌鲁木齐市新华北路 农惠臣	88号 88号商业银行大厦 联系人	何佳
电话 网址	(0991)8824667 www.uccb.com.cn	传真 客服电话	(0991)8824667 (0991)96518
26)渤海银行股份 住所、办公地址 法定代表人 电话	分有限公司 天津市河西区马场边 刘宝凤 (022)58316666	首201-205号 联系人 传真	王宏 (022)58316569
型	www.cbhb.com.cn	客服电话	400-888-8811
法定代表人 电话 网址	王建甫 (0379)65921977 www.bankofluoyang.com	联系人 传真	胡艳丽 (0379)65920155 (0379)96699
28 深圳农村商\ 住所、办公地址 法定代表人	上银行股份有限公司 广东省深圳市罗湖区 李伟	区深南东路3038号台 联系人	
电话	(0755)25188064 (0755)25188263 www.4001961200.com	传真	(0755)25188785 4001961200
29)北京农村商) 住所 办公地址	业银行股份有限公司 北京市西城区阜成门 北京市西城区金融:]内大街410号 大街9号金融街中心	B壁
法定代表人 电话 网址	乔瑞 (010)63229475 www.bjrcb.com	联系人 传真 客服电话	王薇娜 (010)63229478 96198
60)期台银行股份 住所、办公地址 法定代表人	分有限公司 山东省烟台市芝罘 叶文君	区海港路25号 联系人	王淑华
电话 网址 (31)断江稠州商)	0535-6699660 www.yantaibank.net 世银行股份有限公司	传真 客服电话	0535-6699884 4008-311-777
住所 办公地址 法定代表人	浙江省义乌市江滨路 浙江省杭州市延安路 金子军	将128号 联系人	董晓岚、邵利兵
电话 网址	(0571)87117616 www.czcb.com.cn	传真 客服电话	(0571)87117607 (0571)96527 4008096527
62 赔尔滨银行 住所、办公地址 法定代表人	哈尔滨市道里区尚記 郭志文	联系人	王超
电话 网址 (33) 床壳农村商》 注所	0451-86779007 www.hrbb.com.cn 世银行股份有限公司	传真 客服电话	0451-86779218 95537
办公地址 法定代表人	E服行股份有限公司 东莞市东城区鸿福 东莞市东城区鸿福 何沛良	联系人	谭少筠
电话 网址 64)上海银行 住所、办公地址	(0769)22118343 www.drebank.com? 上海市浦东新区银城。	传真 客服电话	(0769)22320896 (0769)961122
法定代表人 电话 网址	宁黎明 021-68475888 www.bankofshanghai.co	联系人 传真	张萍 021-68476111 021-962888
65)河北银行股份 住所、办公地址 法定代表人	6有限公司 石家庄市平安北大征 乔志强		王娟
电话 网址 66 /包商银行股份	0311-88627587 www.hebbank.com	传真 客服电话	0311-88627027 4006129999
生所、办公地址 法定代表人 电话	内蒙古包头市钢铁大 李镇西 (0472)5109729	街6号 联系人 传真	张晶 刘芳 (0472)5176541
网址	http://www.bsb.com.c	n 客服电话	0472 -96016 010 - 96016 0574 -967210 0755 -967210 028 -
97 腐买财富管5 注所	上海市浦东新区世纪		
办公地址 法定代表人	国路91号金地中心A 赵学军	№6层 联系人	96-10单元、北京市朝阳区建 景琪
电话 网址	021-20289890 www.harvestwm.cn www.hwmfund.cn	传真 / 客服电话	021-20280110 010-85572999
(38)杭州联合农村 住所、办公地址 法定代表人	杭州市建国中路99号 张晨	联系人	胡莹
电话 网址 39)万银财富 (比 办公地址	0571—87923324 www.urcb.com 京 基金销售有限公司 北京市朝阳区北四距	传真 客服电话	0571—87923214 96592
注册地址 法定代表人	北京市朝阳区北四3 李招弟	不中路27号院5号楼 联系人	3201内3201单元 高晓芳
电话 网址 (40)上海好买基金 办公地址	010-59393923 www.wy-fund.com 全销售有限公司 上海市浦东南路111	传真 客服电话 8号繁尔多斯国际	010-59393074 400-808-0069
注册地址 法定代表人 电话	上海市虹口区场中的 杨文斌 021-58870011		49室 张茹
电话 网址 (41)中信证券股份 住所、办公地址	www.ehowbuy.com	客服电话	021-68596916 4007009665
法定代表人 电话	王东明 (010)60833722	联系人 传真 客服电话	陈忠 (010)60833739
网址 42 》 发证券股份 住所 办公地址	www.cs.ecitic.com 分有限公司 广州天河区天河北省 广东省广州天河北省		95558 二场43楼(4301-4316房) 36、38、41和42楼
法定代表人 电话	孙树明 (020)87555888	联系人 传真	黄岚 (020)87555305 95575或致电各地营
网址 (43)中信建投证》 注所	北京市朝阳区安立路		业网点
か公地址 法定代表人 电话	北京市朝阳门内大街 王常青 (010)65183880		权唐 (010)65182261
□ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □ □	www.csc108.com	客服电话	400-8888-108
办公地址 法定代表人 电话	上海市广东路689号 王开国 (021)23219000	联系人 传真	金芸、李笑鸣 (021)23219100
网址 45)申银万国证务	www.htsec.com 学股份有限公司	客服电话	95553或拨打各城市 营业网点咨询电话
住所、办公地址 法定代表人 电话	上海市常熟路171号 储晓明 (021)54033888	联系人 传真	李清怡 (021)54030294
双址 (46)国泰君安证∮ 注所	www.sywg.com 学股份有限公司 上海市浦东新区商均	客服电话 或路618号	(021)962505
办公地址 法定代表人 电话	上海市浦东新区银地 万建华 (021)38676666	联系人 传真	芮敏祺 (021)38670666
网址 47)中国银河证统 住所、办公地址	www.gtja.com 学股份有限公司 北京市西城区金融大	客服电话 街35号国际企业大	4008888666 夏C座
法定代表人 电话 Mtr	陈有安 (010)66568430 www.chinastock.com.c	联系人 传真	田徽 010-66568990 400-8888-888
48)兴业证券股份 主所 办公地址 土完代事 A	份有限公司 福州市湖东路268号 上海市浦东新区民生	路1199弄证大五道口	
法定代表人 电话 网址	兰荣 (0591)38507679 http://www.xyzq.com.	联系人 传真 cn 客服电话	雷宇钦 (021)38565955 95562
(49) 招商证券股份 住所、办公地址 法定代表人 由话	深圳市福田区益田路 官少林	联系人	林生迎
电话 双址 (50)华泰证券股份			(0755)82943636 4008888111、95565 大厦、深圳市深南大道4011
住所 办公地址	号港中旅大厦24楼 江苏省南京市中山东	东路90号华泰证券为	大厦、深圳市深南大道4011 大厦、深圳市深南大道
法定代表人	4011号港中旅大厦2 吴万善	联系人	庞晓芸 025-51863323(南京)
电话	0755-82492193 www.htsc.com.cn	传真 客服电话	0755 -82492962 (深 圳) 95597
	HERGT / Y		小上屋14.16.15日
网址 61)长城证券有序 住所、办公地址 法定代表人	深圳市福田区深南 黄耀华	联系人	刘阳
61) 长城证券有际 主所、办公地址 法定代表人 电话 网址	深圳市福田区深南 黄耀华 (0755)83516289 www.cgws.com	大道6008号特区报业 联系人 传真 客服电话	
61 K城证券有所 住所、办公地址 法定代表人 电话 网址 62 四都证券有所 住所、办公地址 法定代表人	深圳市福田区深南/ 黄耀华 (0755)83516289 www.cgws.com 限實性公司 北京市东城区东直[常結	联系人 传真 客服电话]南大街3号国华投 联系人	刘阳 (0755)83515567 400666888、(0755) 33680000 簽大厦9层10层 黄静
61 K城证券有序 主所、办公地址 去定代表人 电话 网址 62 烟都证券有序 主所、办公地址	深圳市福田区深南; 黄耀华 (0755)83516289 www.cgws.com 限實社公司 北京市东城区东直「常喆 (010)84183389 www.guodu.com	联系人 传真 客服电话]南大街3号国华投 联系人 传真 客服电话	刘阳 (0755)83515567 4006666888、(0755) 33680000 资大厦9层10层

法定代表人 电话	徐浩明 (021)22169999	路1508号 联系人 传真	刘晨、李芳芳 (021)22169134
网址 65)渤海证券股 住所	www.ebscn.com 份有限公司 天津经济技术开发	客服电话	4008888788 10108998
办公地址 法定代表人 电话 网址	天津市南开区宾力 杜庆平 (022)28451861 www.bhzq.com		王兆权 (022)28451892 4006515988
66)安信证券股付主所	份有限公司 深圳市福田区金田	路4018号安联大厦 路4018号安联大厦 風大厦1栋9层	[35层、28层A02单元 [35层、28层A02单元 泛
法定代表人 包话 网址 67)东北证券股	牛冠兴 (0755)82825551 www.essence.com.ci	联系人 传真	陈剑虹 (0755)82558355 4008001001
b7 所心证券成 上所、办公地址 法定代表人 且话	长春市自由大路11 矫正中 (0431)85096709	38 号 联系人 传真	潘锴 (0431)85096795
列址 58)平安证券有 E所	www.nesc.cn 限责任公司 深圳市福田区金田	客服电话 路大中华国际交易广	4006000686、(0 85096733 一场8楼
D公地址 法定代表人 担话 阿址	深圳市福田区金田 杨宇翔 0755-22626391 http://www.pingan.e	路大中华国际交易广 联系人 传真 com 客服电话	「场8楼(518048) 郑舒丽 (0755)8240086: 955118
59) 国元证券股 注所、办公地址 法定代表人 且话	份有限公司 安徽省合肥市寿春 凤良志 (0551)2246273	•	陈玲玲 (0551)2272100
址 60)中国中投证:	www.gyzq.com.cn 券有限责任公司 深圳市福田区益田	客服电话 路与福中路交界处	95578 荣超商务中心A栋第18周
○ 所○ 公地址○ 定代表人	元		中心A栋第04、18层至21 刘毅
话 址 61)湘财证券有 所、办公地址	0755-82023442 www.china-invs.cn 限责任公司 湖南省长沙市天心	传真 客服电话 区湘府中路198号新	0755-82026539 400 600 8008 折南城商务中心A栋11楼
定代表人 话 址 62)中银国际证	林俊波 (021)68634518 www.xcsc.com 券有限责任公司	联系人 传真 客服电话	钟康莺 (021)68865680 400-888-1551
所 公地址 定代表人	上海市浦东新区银 上海市浦东新区银 许刚	成中路200号中银大 成中路200号中银大 联系人	
真 址 63 /總邦证券有i 所	(021)50372474 www.bocichina.com.c 限责任公司 上海市普陀区曹阳	路510号南半幢9楼	4006208888
公地址 定代表人 话	上海市浦东新区福 姚文平 (021)68761616	山路500号"城建国际 联系人 传真 客服电话	示中心"26楼 罗芳 (021)68767981 4008888128
址 64 附富证券旬 所、办公地址 定代表人	湖南省长沙市芙蓉 周晖	中路二段80号顺天 联系人	国际财富中心26楼
话 址 65) 中信万通证 所	(0731)84403319 www.cfzq.com 券有限责任公司 青岛市崂山区苗岭	传真 客服电话	(0731)84403439 (0731)84403360 15层(1507-1510室)
公地址 定代表人 话	青岛市崂山区深圳 杨宝林 (0532)85022326	路222号青岛国际金 联系人 传真	を融广场20层 吴忠超 (0532)85022605
址 66)中航证券有 所、办公地址 定代表人	www.zxwt.com.cn 限公司	客服电话 红谷中大道1619号 联系人	(0532)96577 号国际金融大厦A座41楼 戴蕾
活 址 67)中信证券 (#	(0791)86768681 www.avicsec.com 江)有限责任公司	传真 客服电话	(0791)8677017 400-8866-567
所、办公地址 定代表人 话 址	浙江省杭州市滨江 沈强 (0571)87112507 www.bigsun.com.cn	区江南大道588号恒 联系人 传真 客服电话	<u> </u>
68 胀江证券股 所、办公地址 定代表人	份有限公司 湖北省武汉市新华 胡运钊	路特8号长江证券力 联系人	大厦 李良
话 址 	(027)65799999 www.95579.com 份有限公司	传真 客服电话	(027)85481900 95579 或 4008 - 999
所 公地址 定代表人 话	海南省海口市南宝 深圳市深南大道40 陆涛	路36号证券大厦45 01号时代金融中心 联系人 毎直	17层 马贤清
址 70 国盛证券有 折	(0755)83025022 www.jyzq.en 限责任公司 江西省南昌市北京	传真 客服电话 西路88 号江信国际	(0755)83025625 400-8888-228 示金融大厦
公地址 定代表人 话	曾小普 (0791)86285337	(西路88号江信国际 联系人 传真	徐美云 (0791)86282293
址 61 加西证券股 所、办公地址 定代表人		客服电话 -山西国际贸易中心 联系人	4008222111 - 东塔楼 郭熠
话 址 \$2)四部证券股 所、办公地址	(0351)8686659 www.i618.com.cn 份有限公司 陕西省西安市东新	传真 客服电话 術在232号信托大厦	(0351)8686619 400-666-1618
定代表人 话 址	刘建武 (029)87416787 www.westsecu.com	联系人 传真 客服电话	刘莹 (029)87417012 95582
(73)广州证券有 所、办公地址 定代表人 话	限责任公司 广州市天河区珠江 刘东 020-88836999	联系人 传真	一州国际金融中心19、20 林洁茹 020-88836654
址 74 国联证券股 公地址 册地址	www.gzs.com.cn 份有限公司 江苏省无锡市太湖	客服电话 新城金融一街8号目 东街168号国联大厦	(020)961303 国联金融大厦702
定代表人 活 址	雷建辉 0510-82831662 www.glsc.com.cn	东街168号国联大胆 联系人 传真 客服电话	之
(75)东吴证券股 所、办公地址 定代表人	份有限公司 苏州工业园区翠园 吴永敏		方晓丹
话 址 76)南京证券有 所、办公地址	江苏省南京市大钟	客服电话 字8号	(0512)6558802 4008601555
定代表人 话 址 07 断商证券有	张华东 (025)83367888 www.njzq.com.cn	联系人 传真 客服电话	李铮 (025)83320066 4008285888
所、办公地址 定代表人 话	浙江省杭州市杭大 吴承根 (0571)87901912	路1号黄龙世纪广场 联系人 传真	许嘉行 (0571)87901913
址 (78)恒泰证券股 所、办公地址 定代表人	www.stocke.com.cn 份有限公司	客服电话 新城区新华大街11 联系人	(0571)967777 1号 王旭华
话 址 79)东海证券股	(010)66297386 www.cnht.com.cn 份有限公司	传真 客服电话	(0471)4961259 (0471)4972343
所、办公地址 定代表人 话 址	江苏省常州市延隊 刘化军 (021)20333910 www.longone.com.c	医西路23号投资广场联系人 传真客服电话	が18层 王一彦 (021)50498825 95531;400-888
80	份有限公司 上海市中山南路31 上海市中山南路31	8号2号楼22-29层 8号2号楼21-29层	
定代表人 话 址 81)第一创业证	潘鑫军 (021)63325888 www.dfzq.com.cn 券股份有限公司	联系人 传真 客服电话	吴宇 (021)63326173 95503
所、办公地址 定代表人 话 址	广东省深圳罗湖区 刘学民 (0755)25832852 www.fcsc.cn	等岗路12号中民时 联系人 传真 客服电话	代广场B座25、26层 崔国良 (0755)82485081 4008881888
82)宏源证券股 :所 公地址	份有限公司 新疆乌鲁木齐市文 北京西城区太平桥	艺路233号宏源大厦 大街19号宏源证券	Į.
定代表人 L话 [址 83]民生证券有]	冯戎 (010)88085858 www.hysec.com 限责任公司	联系人 传真 客服电话	李巍 (010) 88085195 4008-000-562
所、办公地址 定代表人 话	北京市东城区建国 余政 (010)85127622	联系人 传真	金融中心A座16-18层 赵明 (010)85127917
址 84 新时代证券 所、办公地址 定代表人	刘汝军	客服电话 环西路99号院1号楼 联系人	孙恺
活 址 85)上海证券有 所、办公地址	(010)83561149 www.xsdzq.cn	传真 客服电话	(010)83561094 4006989898
定代表人 话	郁忠民 (021)53519888	联系人 传真	张瑾 (021)53519888 (021) 962
址 86)世纪证券有 所、办公地址 定代表人	www.962518.com 限责任公司 深圳深南大道7088 卢长才	客服电话 号招商银行大厦40 畔系人	4008918918 -42层
话 址 87)华西证券有	(0755)83199599 www.csco.com.cn 限责任公司	联系人 传真 客服电话	方文 (0755)83199545 (0755)83199511
所 公地址 定代表人	四川省成都市陝西 深圳市深南大道40 杨炯洋	901 号时代金融中心 联系人	金达勇
活 址 68)中原证券股 新、办公地址	郑州市郑东新区商		(0755)83025991 4008-888-818
定代表人话	菅明军 (0371)65585287 www.ccnew.com	联系人 传真 客服电话	陈利民 耿铭 (0371)65585665 (0371)967218、
89 东莞证券有 所、办公地址 定代表人	限责任公司 东莞市莞城区可园 张运勇	南路1号金源中心30 联系人	苏卓仁
に 址 90)	(0769)22112062 www.dgzq.com.cn 限责任公司 甘肃省兰州市静宁	传真 客服电话	(0769)22119423 (0769)961130
定代表人话	中院安 (0931)8784656 www.hlzqgs.com	联系人 传真 客服电话	李昕田 (0931)4890628 (0931)4890208、
型 91)万联证券有 三所、办公地址 定代表人	限责任公司	等服电话 号电信广场36、37层 联系人	(0931)4890619
话	(020)37865070	快点 传真 客服电话	020-22373718-1 4008888133
止 92 国金证券股	www.wlzq.com.cn 份有限公司		
1Ŀ	www.wlzq.com.en 份有限公司 成都市东城根上街 冉云 (028)86690126 www.gjzq.com.cn		金結 (028)86690126 4006600109

たフ	C 亦	1111	多	
所、办公地址 定代表人 话	山东省济南市市中李玮 (0531)68889155	联系人 传真	吴阳 (0531)68889752	
址		8111 号山西世贸中心		
E代表人 括 止 96 端银证券有限 所、办公地址	董祥 (0351)4130322 www.dtsbc.com.cn 责任公司 北京市西城区金融	联系人 传真 客服电话 大街7号英蓝国际金融	藤津 (0351)4130322 4007121212 中心12屋 15屋	_
E代表人 5 上	程宜荪 (010)58328112 www.ubssecurities.co 责任公司	联系人 传真	年冲 (010)58328748 400-887-8827	
7. 办公地址 2代表人	洪家新? (0755)82083788	路4018号安联大厦28 联系人 传真 客服电话	展A01、B01(b)単元 孔泉 (0755)82083408 (021)32109999,	
98)中山证券有限	深圳市福田区益E 吴永良	田路6009号新世界中/ 联系人	李珍	
代表人		传真 客服电话 51号国贸大厦2座27层	(0755)82960582 4001022011 及28层]
代表人	李剑阁 (010)65051166	所1号国贸大厦2座28层 联系人 传真 客服电话	廉赵峰 (010)85679535 (010)85679238;	
000)天相投资顺门 地址	北京市西城区金融	街19号富凯大厦B座76大街5号新盛大厦B座	4层 邮编:100033	_
代表人	林义相 (010)66045608 http://www.jjm.com 核公司	•	林爽 (010)66045500 (010)66045678	
大办公地址 代表人	孙名扬 (0451)82336863 www.jhzq.com.cn	方香坊区赣水路56号 联系人 传真 客服电话	张宇宏 (0451)82287211 400-666-2288	_
002 中国民族证 、办公地址 代表人	赵大建 (010)59355941	融街5号新盛大厦A座 联系人 传真	李微 (010)66553791	
003 厦门证券有际 、办公地址 代表人	厦门市莲前西路2 傅毅辉	客服电话 号莲富大厦十七楼 联系人	卢金文	_
(104)爱建证券有限 、办公地址	(0592)5161642 www.xmzq.cn 表责任公司 上海市浦东新区世		(0592)5161140 (0592)5163588	_
代表人 105 坪宝证券有印	郭林 (021)32229888 www.ajzq.com 長責任公司	联系人 传真 客服电话	陈敏 021- 68728782 (021)63340678	
、办公地址 代表人	陈林 (021)68777222 www.cnhbstock.co	世纪大道100号环球金 联系人 传真 m 客服电话	度元 夏元 (021)68777822 4008209898	
(06)方正证券股份 、办公地址 代表人	份有限公司 湖南长沙芙蓉中 雷杰 (0731)85832503	各二段华侨国际大厦2 联系人 传真	2-24层 郭军瑞? (0731)85832214	J
(107)英大证券有限 、办公地址 代表人	www.foundersc.com 表责任公司 深圳市福田区深南 吴骏	n 客服电话 有中路华能大厦三十、 联系人	95571 三十一层 吴尔晖]
(108)西南证券股份 、办公地址	重庆市江北区桥北	传真 客服电话 比苑8号西南证券大厦	(0755)83007167 4008-698-698	1
代表人	余维佳 (023)63786141 www.swsc.com.cn 表责任公司	联系人 传真 客服电话	张煜 (023)6378212 4008096096	
地址 代表人	呼和浩特市新城区	市口大街1号长安兴融 联系人 传真	中心西楼11层 冯杰 (010)66412537	1
(110)信达证券股付,办公地址 代表人	www.rxzq.com.cn 分有限公司 北京市西城区闹口 高冠江	客服电话 打口大街9号院1号楼 联系人	4006609839 唐靜	1
) 东兴证券股份 、办公地址	(010)63081000 www.cindasc.com 分有限公司	传真 客服电话 放大街5号新盛大厦B	(010)63080978 400-800-8899 至12-15层	=
代表人	徐勇力 (010)66555316 www.dxzq.net.cn 份有限公司	联系人 传真 客服电话	汤漫川 (010)66555246 400-8888-993	_
地址 代表人	北京市西城区金融	独大街8号 独大街8号中国华融A 联系人 传真	至3层、5层 黄恒 010-58568062	
013 国海证券股份 、办公地址 代表人	www.hrsec.com.cn 分有限公司 广西桂林市辅星 张雅锋	客服电话	(010)58568118	_ _
114 烟信证券股份地址	0755-83709350 www.ghzq.com.cn 分有限公司	传真 客服电话	0755-83700205 95563(全国)	Ξ
代表人	何如 0755-82130833 www.guosen.com.cr 富里昂证券有限责任公	联系人 传真 2 客服电话	齐晓燕 0755-82133952 95536	_
地址 代表人	上海市浦东新区世 罗浩 021-38784818?	世纪大道100号环球金 联系人 传真 客服电话	倪丹 021-68775878	
C 注册登记机构 嘉实基金管理有限 E 注师事务所和	www.cf-clsa.com		68777877	_
、办公地址 人 律师	北京市朝阳区东三 王卫东 (010)65890661 黄伟民		法大厦9层 作民 010)65176801	
四)会计师事务所	和经办注册会计师 普华永道中天会计 上海市浦东新区陆	师事务所(特殊普通 家嘴环路1318号星局		
地址 代表人 注册会计师	大海市真相区砌织 杨绍信 (021)23238888 许康玮、金毅	联系人 金 传真 ((ラ接音学水道中心11接 変数 021)23238800	_
本基金名称:嘉实 本基金类型:契约	量化阿尔法股票型证券 型开放式	五、基金的类型 、基金的投资目标		-
	[高于业绩比较基准的]	殳资回报。	以及监管机构允许投资的其 公司/债、次级债、可转换债; 购、以及法律、法规或中国证	他学监生
重	京概工具。如法律法规。 期有关规定且和基金托 的资产配置范围为:股票 基金投资的其他证券 基金投资产净值的5%,权证	X血官机构以后允许基金管人进行协商后将其纳 等权益类资产占基金资 品种占基金资产的比例; E市值占基金资产净值的	以及监管机构允许投资的其 经司 / 版,次级债,可转换债 款,以及法律。注题或中国证 投资股票指数期货等金融行 入投资抢期,并报证监会各套 行的上例为60-95%,现金 约5-40%,现金及到期日在 1比例不超过3%。 用新的规定。	生。券年
一投资策略	,	((坐量17)及风水闸		
与类和现金类等大 的是要投资策略 本基金以 定量技 ment Approach)。	以時代組举民好的技术 大类资产上。 投资"为主 Quantitat 力争实现稳定超额回报	ive Investment Approach	全分析,根据市场情况灵活配 要类资产的配置,剩余资产将), 辅以 "定性投资" (Tradi	tions
□ · · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	五字 (1950年) (1950400000000000000000000000000000000000	審实Alpha多因素模型以及 复核,并做相应调整,以),輔以 "定性投资" (Tradi 及强大的数据库系统,构建投 及原实组合优化器,数量小组 不断改善模型的适用性。 预期、市场认同度等因素,拥 要形数的相对值度度 場高	将相提具
了高的行业配置, 2)嘉实Alpha多因 通过嘉实行业选择	降低投资吸引另低的名 素模型 序模型筛选的行业进入	业配置。 个股筛选程序。本基金在	个股选择层面,采用 嘉实Al _l	ha3
图实基金根据对明的) 盈利趋势 () 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2 2	中国证券市场运行特 perating),分析师情绪(立 嘉实Alpha多因素模 目基本面研究成果,对相 全日素實现除选出的原	征的长期研究,选取作 Sentiment)、市场因素(M. 型",并使该模型成为股 型型自动选股的结果进行	古值因子 (Valuation)、成长 arket) 五大类对A股股价波动 票选择的重要依据。 亏复核,剔除掉满足某些特殊 定性研究成果,剔除掉限制买	因具有
从而进行定性优 需要考虑的定性因 () 上市公司治理	选。 3素包括: 里结构存在问题:			
本基金通过量化抗 益的最佳匹配。定 运作风险最小化 可报的最坏条件下 急定,更加分散化	及术,对上述定量模型和 量投资方法以科学性和 ,并力争取得较高收益。 、,计算最优组合。与其 ,交易成本和换手率更	定性因素筛选的结果进 口系统性著称,将在严格 在现阶段,本基金使用 他优化方法相比,使用 低。	行优化,以确定个股权重,实 的纪律化模型制约下,精准职 稳健优化"的方法,在所有可 稳健优化"方法获得的最优组	现踪能合
.债券投资策略 本基金的债券组合 货券投资采取 自 收益率水平、流动 发策略、收益率利	主要作为基金流动性 上而下"的策略,深入分 性和信用风险等因素, 差策略等,确定和构造	曾理的工具。 } 析宏观经济、货币政策 以价值发现为基础,采明 能够提供稳定收益、较高	行优化,以确定个股权重实的的纪律化模型制约下、帮准联 稳健优化"的方法,在所有问 稳健优化"方法获得的最优。 和利率变化趋势以及不同债 以以入期管理策略为主,辅以 流动性的债券和货币市场工	券 松 具 紅
权证投资策略 (基金在权证投资	\$由鄉村权证标的证券(的基本面进行研究,结合 路包括:杠杆策略、价值 路、买入保护性的认洁权		场的差罪
放気伏鬼 、決策依据 -) 法律法抑和基:	金合同。本基金的投资	* 将严格遵守国家有关法	律、法规和基金合同的有关规 受适度风险的范围内,选择预	定.
			成果,形成宏观、政策、投资等 依据。 和对市场的判断决定基金的 基本面研究成果,由基金经理	
时,甲核开批准;)在既定的投资 资策略的品种进)独立的交易执行 保证基金经理的;)动本的中心	等型工程提出的资产的目标与原则下,根据定 1行投资。 行:基金管理人设置独立 投资指令在合法、合规的 理,基金经理经验。	是7条以里天投资决定 量投资模型以及分析师。 立的中央交易室,通过严 的前提下得到高效地执行 经市场和上市公司统证。	基本面研究成果,由基金经理格的交易制度和实时的一线 了。 要变化,结合基金中购和赎回	选打監打
流量情况,以及 5)风险管理部根 5,出具风险分析	组合风险和流动性的1 据市场变化对基金投资 报告。监察稽核部对基	平估结果,对投资组合进	行切念的调整,使之不断得 5控,并授权风险控制小组进 督。	到17 行E
出调整 。	九、 +上证国债指数×25% 十、	基金的业绩比较基准 基金的风险收益特征	境变化和实际需要对上述投	紅棺
		·、基金投资组合报告 所载资料不存在虚假记 ·连带责任。 银据本基金合同规定, · · 保证复核内容不存在。	载、误导性陈述或重大遗漏, 于2013年7月16日复核了本报 显假记载、误导性陈述或者重	井坪 告中
k扣容细会据生E			妥告所列财务数据未经审计。 占基金总资产的比例(%)]
权益投资 其中:股票 固定收益投资 其中:债券 资产支持证券		581,939,784.78 581,939,784.78 38,376,299.30 38,376,299.30	87.9	9
金融衍生品投资 买人返售金融资 其中:买断式回 融资产	打产 购的买人返售金	23,000,000.00		
	万业分类的股票投资组	10,875,273.09 7,164,216.94 661,355,574.11	1.0	8
次、林、牧、渔业	业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	1

已初		多り		火		才問	女	
山东省济南市市中区 李玮 (0531)68889155 www.qlzq.com.cn	经七路 86 号 联系人 传真 客服电话	吴阳 (0531)68889752 95538	H I J K L	住宿和餐饮业 信息传输、软件 金融业 房地产业 租赁和商务服务	和信息技术服务业	35,92 36,88	- 6,452.50 3,723.94 6,628.90 9,707.10	1.7 5.4 5.6 1.4
	1号山西世贸中心A 联系人	薛津	M N O P	科学研究和技术 水利、环境和公 居民服务、修理 教育	版务业 共设施管理业 和其他服务业	4,92	2,756.64 2,400.00 - -	0.7
www.dtsbc.com.cn 表责任公司 北京市西城区金融大街			Q R S	卫生和社会工作 文化、体育和娱 综合	乐业 合计	2,94 581,93	- 3,663.49 7,104.00 9,784.78	1.8 0.4 88.5
程宜荪 (010)58328112 www.ubssecurities.com 表责任公司	联系人 传真 客服电话	牟冲 (010)58328748 400-887-8827	7 序号	股票代码 600887	公允价值占基金资产 股票名称 伊利股份	数量(股) 公	16,519,687.44	組 基金资产净值 比例(%) 2.:
深圳市福田区金田路4 洪家新? (0755)82083788	联系人 传真	系A01、B01(b)単元 孔泉 (0755)82083408 (021)32109999,	2 3 4 5	000527 600422 000651 000895	美的电器 昆明制药 格力电器 双汇发展	446,383 463,431	12,908,590.38 11,829,149.50 11,613,580.86 10,741,519.84	1.5 1.3 1.7
www.cfsc.com.cn 長责任公司 深圳市福田区益田路		(029)68918888	6 7 8	600085 600309 600563 601933	同仁堂 万华化学 法拉电子 永辉紹市	439,600 585,660 487,320 706,271	9,618,448.00 9,382,273.20 8,606,071.20 8,242,182.57	1.4 1.4 1.3 1.3
吴永良 (0755)82570586 www.zszq.com 眼有限公司	联系人 传真 客服电话	李珍 (0755)82960582 4001022011	10 4 序号	600518 报告期末按信	水料 起巾 康美药业 费券品种分类的债务	706,271 424,100 投资组合 公允价值(元)	8,155,443.00	1. 1. *净值比例(%)
李剑阁	号国贸大厦2座28层 联系人	廉赵峰	3	央行票据 金融债券 其中;政策性金)	独债	29,888 29,888		4
(010)65051166 www.ciccs.com.en	传真 客服电话	(010)85679535 (010)85679238; (010)85679169	4 5 6 7	企业债券 企业短期融资为 中期票据 可转债	è	8,488	299.30	1.3
北京市西城区金融街1 北京市西城区金融大行 林义相	封5号新盛大厦B座4 联系人	层 邮編:100033 林爽	8 5 序号	其他 合计 报告期末按2 债券代码			前五名债券投资明:	5.i 细 !:金资产净值
(010)66045608 http://www.jjm.com.cn 限公司 黑龙江省哈尔滨市香		(010)66045500 (010)66045678	1 2 3	120238 120318 110022	12国开38 12进出18 同仁转债	200,000 1 100,000	9,932,000.00 9,956,000.00 5,185,200.00	例(%) 3.6 1.: 0.*
孙名扬 (0451)82336863 www.jhzq.com.cn 券有限责任公司	联系人 传真 客服电话	张宇宏 (0451)82287211 400-666-2288	4 5 6 計	110003 110015 报告期末按公	新钢转债 石化转债 公允价值占基金资产 去结有资产支持证券	10,280 10,000 净值比例大小排名的	1,070,662.00 998,200.00 削十名资产支持证	0. 0. 券投资明细
北京市西城区金融往 赵大建 (010)59355941	所5号新盛大厦A座6 联系人 传真	李微 (010)66553791	7	报告期末按2 设告期末,本基金 报告期末本3 设告期内,本基金	公允价值占基金资产 未持有权证。 is金投资的股指期货 未参与股指期货交易	净值比例大小排名的	前五名权证投资明:	細
www.e5618.com 限公司 厦门市莲前西路2号章 傅毅辉	客服电话 室富大厦十七楼 联系人	400-889-5618 卢金文	年内2	1)服告期内本基 这基金投资的前十 2)本基金投资的 3)其他资产构成	金投资的前十名证 一名证券的发行主体 前十名股票中,没有	等的发行主体未被监信 未受到公开谴责、处罚 超出基金合同规定的行]。 备选股票库之外的服	
(0592)5161642 www.xmzq.cn 限责仕公司	传真 客服电话	(0592)5161140 (0592)5163588	序号 1 2 3	存出保证金 应收证券清算 应收股利	名称		金額(元)	237,120.4 5,334,117.0 598,600.9
上海市浦东新区世纪 郭林 (021)32229888 www.ajzq.com	で 週1600 亏 32 楼 联系人 传真 客服电话	陈敏 021- 68728782 (021)63340678	4 5 6	应收利息 应收申购款 其他应收款				782,322.2 212,056.2
程责任公司 上海市浦东新区世纪 陈林	已大道100号环球金 联系人		8	待摊费用 其他 合计 # 服告期末持有	的处于转股期的可靠	F换债券明细		7,164,216.9
	传真 客服电话 段华侨国际大厦22	4008209898 2-24层	序号 1 2	债券代码 110022 110003	引 债券名 同仁转 新钢转	债 5,1	直(元) 占基金 85,200.00 70,662.00	·资产净值比例 (%) 0.
雷杰 (0731)85832503 www.foundersc.com 装置任公司	联系人 传真 客服电话	郭军瑞? (0731)85832214 95571	3	110015 110020	石化转 南山转 宮股票中存在流通受 名股票中不存在流通	债 9 债 4 限情况的说明 通受限情况。	98 ,200.00 02 ,637.30	0.
深圳市福田区深南中 吴骏 (0755)83007159	联系人 传真	三十一层 吴尔晖 (0755)83007167	利。也	法金管理人依照偿 不保证最低收益	 	#安保育化。 十二、基金的业绩 谨慎勤勉的原则管理 并不代表其未来表现。 与同期业绩比较基准时	和运用基金财产,但 投资有风险,投资者	日不保证基金ー 首在做出投资と
www.ydsc.com.cn 份有限公司 重庆市江北区桥北苑 余维佳	客服电话	4008-698-698 张煜		阶段	瀬净值增长率及其 净值 净值增长率① 本 标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准)-3 2-4
(023)63786141 www.swsc.com.cn 表责任公司	传真 客服电话	98:882 (023)6378212 4008096096	金合	9年3月20日(基 同生效日)起至 9年12月31日 2010年	29.90% 1.80 2.41% 1.49	36.95%	1.46% -	7.05% 0.40 0.70% 0.30
呼和浩特市新城区锡 北京市西城区闹市口 孔佑杰 (010)83991743	林南路18号 大街1号长安兴融中 联系人 传真	中心西楼11层 冯杰 (010)66412537		2011年 2012年 13年上半年	-34.27% 1.35 1.10% 1.25 -6.39% 1.35	5% -18.30% 5% 6.88% 3% -9.14%	0.97% -1 0.96% - 1.12%	5.97% 0.38 5.78% 0.29 2.75% 0.2
www.rxzq.com.cn 份有限公司 北京市西城区闹市口	客服电话 大街9号院1号楼	4006609839			以来基金累计净值》	曾长率変动及其与同則 ・	用业绩比较基准收益 ▶蛹比較基准收益	
高冠江 (010)63081000 www.cindasc.com	联系人 传真 客服电话	店静 (010)63080978 400-800-8899	101		AL.	Mi no		
北京市西城区金融大 徐勇力 (010)66555316	联系人 传真	汤漫川 (010)66555246	11.1	11 100	My W	My Ma		b
www.dxzq.net.cn 分有限公司 北京市西城区金融大 北京市西城区金融大		400-8888-993 3屋、5层		1	W	700	MA	144
宋德清 010-58568235 www.hrsec.com.cn	联系人 传真 客服电话	黄恒 010-58568062 (010)58568118		178		9	M	M
分有限公司 广西桂林市辅星路13 张雅锋 0755-83709350	联系人 传真	牛孟宇 0755-83700205	1014				I W	γ.,
www.ghzq.com.cn 份有限公司 深圳市罗湖区红岭中 何如	客服电话	95563(全国)		111	2000	0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0		2 N N N N N N N N N N N N N N N N N N N
0755-82130833 www.guosen.com.cn 富里昂证券有限责任公司	传真 客服电话	0755-82133952 95536	2009 注 时本基	日:嘉实量化阿尔 年3月20日至2013 E:按基金合同和 法金的各项投资出	去股票累计份额净值 年6月30日) 招募说明书的约定 比例符合基金合同策	[增长率与同期业绩比本基金自基金合同生 (十一部分 C、投资若	. 较基准收益率的历 : 数日起6个月内为 : 围和五、C.)投资	史走势对比图 建仓期,建仓期 组合限制 的存
上海市浦东新区世纪 罗浩 021-38784818? www.cf-clsa.com	大道100号环球金融 联系人 传真 客服电话	e中心9楼 倪丹 021-68775878 68777877	定。 1	一)与基金运作有 、基金费用的种类	关的费用	十三、费用概览		
日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日 日		00777077		2)居金托管人的 3)儲金合同注 4)儲金合同注 5.居金份而共	托管费: 效后与基金相关的信 效后与基金相关的会 发后与基金相关的会	高息披露费用; 注计师费和律师费;		
北京市朝阳区东三环: 王卫东 (010)65890661	北路38号泰康金融 联系人 黄	大厦9层 伟民 10)65176801	2 2	7)基金的银行汇 8 按照国家有关 基金终止清算时 基金费用计提了	则费用: 规定和《锰金合同》 的形发生费用.按实际 方法、计提标准和支付	思起數數用: 計師费和律师费; 即定,可以在基金财产; 示支出额从基金财产完 方式 值的1.5%年费率计提	中列支的其他费用。 (值中扣除。	
黄伟民 和经办注册会计师 普华永道中天会计师 上海市浦东新区陆家			H	EE×1.5%+当年天	数 は全管用弗			
上海市黄浦区湖滨路2 杨绍信 (021)23238888	202号企业天地2号 联系人 金	楼普华永道中心11楼	费划款 定节们	基金管理费每日计 次指令,基金托管 段日、公休假等,或 2)基金托管人的:	・算、逐日累け至毎月 人复核后于次月前2 で付日期順延。 ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・ ・	月月末,按月支付,由基 个工作日内从基金財 值的2.5%的年费率计	金管理人向基金托 空中一次性支付给! 坦 乒弯曲的计算	管人发送基金 基金管理人。老 车法加下,
量化阿尔法股票型证券投资	、基金的名称		E	为前一目的基金 基金托管费每日计	资产净值™ ∵算,逐日累计至每月	月末,按月支付,由基	金管理人向基金托	曾人发送基金
全高于业绩比较基准的投资 ・ 基	1.全的投资方向	以及监管机构允许投资的其他市	休日等 額列2	序,支付日期順延 二述一、基金费用 、当期费用,由基 、不列入基金费用	へを核石」(大月前2 。 的种类中第 6)	个工作日内从基金财)项费用,根据有关法的 "中支付。 行或未完全履行义务与 建金运作无关的事项发 组不限于整路费,会计 完全的有关规定不得列	见及相应协议规定,	按费用实际支
上工具 収证等)、债券资产	国债、金融债、企业 《 明融资券等)、债券回顺 管机构以后允许基金: 人进行协商后将其纳) 以经米资产上其全资。	以及监管机构允许投资的其他市公司 / 储、次级债、可转换债券 / 含 均,以及法律、法规或中国证监会 投资股票指数期货等金融价生产 人投资范围,并报证监会备案。 2011/401/260.05%。加全、债券资	4	1 基金管理人相。 2 基金管理人和。 3 基金合同生效 4 其他根据相关。 、费用调整	层金托官人因木腹7 层金托管人处理与5 前的相关费用,包括 法律法规及中国证监	了或未完至腹行义务与 基金运作无关的事项发 但不限于验资费、会计 适会的有关规定不得列	致的费用文出或是 生的费用; 师和律师费、信息担]入基金费用的项目	弦财产的损失 按露费用等费用
F基金投资的其他证券品料 基金资产净值的5%,权证市 国证监会对基金投资权证的 八、基	义益美资产占基金资产 中占基金资产的比例为 值占基金资产净值的 即比例有新的规定,适用 是金的投资策略	以以成录自数判员等基础的工厂 人投资范围,并报证监会省案。 产的比例为60-95%;现金、债券资 5-40%,现金及到期日在一年以 比例不超过3%。 用新的规定。	相关领导	#茲官埋入和基金 數率。週高基金管 召开基金份额持 等费率,无须召开 逐指定媒体公告:	注代官人协商一致后 注理费率、基金托管集 有人大会审议:在第 基金份额持有人大会 并极中国证监会各案	可根据基金发展情况 可根据基金发展情况 身率等至本基金合同等 (←)条规定的费率外 会。基金管理人必须最	調整基金管理费率 计四部分第二款规 平以内,调整基金 迟于新的费率实施	或基金托管费 是的费率水平 管理费率、基金 日前2个工作日
		分析,根据市场情况灵活配置大 类资产的配置,剩余资产将配置		1)申购费 《基金申购费率报 「多笔申购,适用	7天印贺州 7照申购金额递减,8 费率按单笔分别计算	p申购金额越大,所适 以本基金申购费率最	用的申购费率越低。 设高不超过申购金额	
		,辅以 "定性投资" (Traditional 强大的数据库系统, 构建投资组 豪实组合优化器。数量小组将根 环断改善模型的适用性。	M<10	申购金额 00万元 「元≪M<200万方	i(含申购费)		申购费率 1.5% 1.2%	
候型 型,通过定量分析行业赢利:	能力、分析师的盈利系	页期、市场认同度等因素,捕捉具	M≥5	「元 ≤ M < 500 万 ラ 600 万 元 <基金的申购费用 対 产。	DH-0180 1 5240 -43	要用于本基金的市场!	0.8% 单笔1000元 值广、销售、注册登i	记等各项费用
素模型 B模型筛选的行业进入个股	 	要指數的相对偏离度。提高投资 个股选择层面,采用 鬻实Alpha多	会細的	父勿永年中则4 10.6%。 优惠后费	率加里低于0.6%。即	上交易、电话交易系约 时中购金额的0.6%。但 时上的安全, 时中购金额的0.6%。但 时关公告规定的费率 1要率优惠,其中购费 按0.6%执行。基金招募	华小汉中则击侧刀1	日・5元 一 ルボス
中国证券市场运行特征的 perating),分析师情绪 Sent 立 嘉实Alpha多因素模型" 引基本面研究成果,对模型 1多因素档型能速山色型型	的长期研究,选取估 iment)市场因素(Man ,并使该模型成为股票 自动选股的结果进行 名单由,相照公共宣码	值因子 Waluation)、成长因子 ket 五大类对A股股价波动具有 设选择的重要依据。 复核、剔除掉调足某些特殊条件 定性研究成果,剔除掉限制买入类	率低于	-0.6%时,按实际 2.)赎回费 这基金的赎回费等 5.赎回费率最高不	费率收取申购费。 坚按照持有时间递减 超过赎回金额的59	按0.6%执行。基金招募	有时间越长,所适用 而递减。具体如下:	
型素包括: 理结构存在问题; 自负面影响的潜在事件;				持 <	有期限 365天 ≤M<730天		赎回费率 0.50% 0.25%	
所的其它非基本面因素。 技术、对上述定量模型和定性量投资方法以科学性和系,并力争取得较高收益。在 ,并力争取得较高收益。在 ,并算最优组合。与其他位	生因素筛选的结果进行 统性著称,将在严格的 现阶段,本基金使用。 尤化方法相比。使用。	宁优化.以确定个股权重,实现风 均纪律化模型制约下,精准跟踪策 稳健优化"的方法,在所有可能的 急健优化"方法获得的最优组合,			730天	承担,其中25%的部分	0	常分用于支付
主要作为基金流动性管理	的工具。		下方:	3 转换费 基金转换费由基金 EWW,		日于支付有关手续费和 等投资基金、嘉实多元 型证券投资基金时,		
		1利率变化趋势以及不同债券品以久期管理策略为主,辅以收益 允动性的债券和货币市场工具组 明权定价模型和我国证券市场的	率,计	算公式如卜:				
		朋权定价模型和我国证券市场的 逻辑策略、获利保护策略、价差策 正策略等。 出、法规和基金合同的有关规定。	非 分投 基金、 投资	*中M/月嘉实货币 沪嘉实量化阿尔洁 登基金、嘉实稳健 嘉实服务增值行 括金、嘉实优居企	中勿禁金、嘉实安心 法股票型证券投资基 开放式证券投资基金、嘉 业证券投资基金、嘉 业股票型证券投资	東ロロッチ金全部等 金与嘉实旗下其他2: 金、嘉实增长开放式证 实主題精选混合型证 ま金、嘉实研究結准即	山內無尸当前累计 ,只开放式基金 包括 券投资基金、嘉实债 券投资基金、嘉实策 票型证券投资基金、	本刊収益 括:嘉实成长收 资券开放式证券 該略增长混合型 、嘉实多元的名
)进行投资。		未、法规和基金合同的有关规定。是适度风险的范围内,选择预期收战果,形成宏观、政策、投资策略、	型 超 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型 型	学投资基金 A、嘉 文益债券型证券报 E券投资基金联报 1选股票型证券报	实回报灵活配置混合 设基金、嘉实主题编 设基金、嘉实领先成计 设备全金、嘉实中创4 高家统统	法基金的基金份额净值 基金的基金份额净值 该货市市场基金全部基 该货市市场基金全部等 金与嘉家康 其他2: 3. 嘉实增长开放式证 5. 惠实增长开放式证 5. 墨文牌长开放式证 5. 墨文牌长开放式证 5. 墨文牌长用放工证 5. 墨文牌长用放工资 5. 是工工学经验基金 5. 是工工学经验基金 5. 是工工学经验基金 5. 是工工学经验基金 5. 是工工学经验基金	实价值优势股票型 金、嘉实深证基本 、嘉实信用债券型 正嘉实信用债券型 正嘉安信用债券型	正券投资基金 面120交易型开 正券投资基金 基金、嘉实优化
所报告,为投资决策委员会和 会定期和不定期召开会议 基金经理提出的资产配置) 目标上原则下,根据字景机	和基金经理提供决策的 ,根据基金投资目标和 方案或重大投资决定。	衣据。 17对市场的判断决定基金的总体 太而研究成果 由其全经现法权	投资基投资基实安心	#金联接基金、嘉 #金转入嘉实货币 边货币市场基金时 #转入金额 = Bx	实研究阿尔法股票型 可市场基金、嘉实超 1,均采用 「	型证券投资基金。之间 豆债证券投资基金、嘉 申购费率补差"算法	互转,以及嘉实量化 实多元收益债券型	阿尔法股票
[行投资。 行:基金管理人设置独立的 投资指令在合法、合规的前 里:基金经理将跟踪证券市	中央交易室,通过严格 提下得到高效地执行 场和上市公司的发展	各的交易制度和实时的一线监控 。 变化,结合基金申购和赎回导致	444	ち換补差费用 = ち入份额 = 净转 は中.B 为转出的	(BxCx (1-D) (1+G) 入金額 / E 基金份額; 转出基金的基金份 対应赎回费率;	ixG 额净值;		
		行动态的调整,使之不断得到优 控,并授权风险控制小组进行日 等。 竞变化和实际需要对上述投资程	34.000 G	为对应的甲购*	ト 差费率, 当转出基金	x 的中胸费率 ≥ 转 / 额净值。 屬实稳固收益债券基 可费全部归入该基金 券型发起式证券投资		
九、基金 6+上证国债指数×25% 十、基金 益。	的业绩比较基准 的风险收益特征		固收益 不同的 于30日 谷・~	a 假券基金合同的方式收取赎回费目的C类基金份额 E1:自2011年1月7	191定,该基金的赎 19):根据嘉实纯债债 所收取的赎回费全额 1日起嘉实增长混合 喜实货币单口单个	可费全部归入该基金 券型发起式证券投资 时入基金财产。 哲停转入业务;自201 经金账户单笔申购 戗 单个基金账户单笔申	8户(田:在运作期 基金基金合同的约算 1年1月7日起嘉实策 专入、定投)不超过	和间歇期,该基定,对于持有期 部混合暂停单 亿元:白2012
十一、基 事会及董事保证本报告所報 性和完整性承担个别及连持 作商银行股份有限公司根据	特责任。 {本基金合同规定,干	改、误导性陈述或重大遗漏,并对 -2013年7月16日复核了本报告中 	自起, 自参加 公告)	嘉实信用债券A、 嘉实基金网站平 2:2013年4月9日 ,自2013年4月12	嘉实信用债券C单日]载的相关公告。],本基金管理人发布]。起,在本公司基金]完新办法。	第一个基金账户单笔中 第一个基金账户单笔中 第一个基金账户单笔中 第一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	胸 (或转入、定投) 不 種金后端收费模式 交易) 开通旗下部分	超过100万元 代并实施费率位 分基金产品的原
和投资组合报告等内容,保 斤载数据截至2013年6月30日 金资产组合情况 页目	让复核内容不存在虚	假记载、误导性陈述或者重大遗						
	新規(元) 581,939,784.78 581,939,784.78 38,376,299.30 38,376,299.30	白藤亜紅質/門印印(%) 87.99 87.99 5.80 5.80	平.	a vistaleatis EE		定及基金合同约定的 放在特定时间段等进行 基金管理人可以对促销		
哲 哲产 购的买人返售金	38,376,299.30 - - - 23,000,000.00	5.80 - - 3.48	拉	以照国家有关规定	可以列入的其他费 沙	用根据相关法律及中 ,其纳税义务按国家形 ,打势说明书更新部分	国证监会相关规定 的法律、法规执行。	列支。
享备付金合计	- 10,875,273.09 7,164,216.94	- 1.64 1.08	法》、《 生效尼	→111号记明书依据 证券投资基金信息 日对本基金实施的 在 重要提示"音	。 wc 安投资基金法》 息披露管理办法》及 的投资经营情况,对2 8分:明确了更新招。 人"部公、再等"之	.其纳税义务按国家形 对招募说明书更新部分 、证券投资基金运作 其它有关法律法规的 。基金原招募的明书进 等说明书内容的截止臣 企管理人的相关信息	ョ理小法》、征券投 更求,结合本基金管 持了更新。主要更]期及有关财务数据	2.50 基金销售管理人在本基金 新内容如下: 新的截止日期。
行业分类的股票投资组合 _{了业类别}	661,355,574.11 公允价值(元)	100.00 占基金资产净值比例(%)	2 3 4 行为才	正 二、基金管理 在 四、基金托管 在 五、相关服务 《基金代销机构》	八 mzf:更新了基: 人"部分:更新了基: 机构"部分:增加包i 并更新了相关代销	《基金原招募说明书进 專说明书内容的截止E 金管理人的相关信息。 金托管人的相关信息。 写银行、杭州联合农村 1构信息。	商业银行、万银财富	「、好买基金、河

主宿和餐饮业 言息传输、软件 运融业	和信息技术	大服务业		11,6	66,452.50			1.78 5.47
号地产业				36,8	86,628.90)		5.62
H货和商务服务 科学研究和技术	·业 :服务业			9,3	39,707.10 22,756.64			1.42 0.75
(利、环境和公 民服务、修理	共设施官组	F/IIV			72,400.00			0.59
185		7.32.						
2生和社会工作 (化、体育和娱	: 乐业				63,663.49			1.84
合	合计			581,9	47,104.00			0.45 88.59
报告期末按公	公允价值占		净值比例大小		的前十名E		管明细 占基金资	产净值
股票代码	股票名		数量(股)		允价值(比例	(%)
600887 000527	伊利股美的电		528,123		16,519, 12,908,			2.51
600422	昆明制		446,383	3	11,829,	149.50		1.80
000651 000895	格力电 双汇发	展	463,431 279,436	5	11,613, 10,741,	580.86 519.84		1.77
600085 600309	双汇发 同仁3 万华化	堂 学	439,600 585,660)	9,618,	448.00		1.46
600563	法拉电	上子	487,320)	8,606,	071.20		1.31
601933 600518	永辉超 康美药	isk	706,271 424,100)	8,242,	182.57 443.00		1.25
报告期末按价	资券品种分 %品种	类的债券	投资组合 公允价(占基金	资产净值比	
家债券	V 10111		24,70011	ac () u)	-	1.1111111111111111111111111111111111111	,547 - F JALE	-
行票据 :融债券					3,000.00			4.55
业债券	融债			29,88	3,000.00			4.55
·业短期融资为 期票据	l.				-			
转债 :他				8,48	3,299.30			1.29
rit				38,376	5,299.30			5.84
报告期末按2	公允价值占				的前五名的		20月细 占基金资产	·净值比
债券代码	债券名		200,000	公	允价值(元 19,932,0		例(9	
120238 120318	12进出	18	200,000 100,000		9,956,0	00.00		3.03 1.52
110022	同仁转	借	40,000 10,280		5,185,2	62.00		0.79
110003 110015 报告期末按2 期末,本基金 报告期末按2	新钢转 石化转 公允价值占 未持有资产	债 债 基金资产 "支持证券 基金资产	10,280 10,000 浄値比例大小 漁値比例大小	非名的	1,070,6 998,2 内前十名第	62.00 200.00 6产支持	等证券投资(等明细	0.16
110003 110015 期日期末期日期末,本基金 报告期末本基金 报告期末本基本本 期度的期间的的的的 设备,本基位 投资期份的的的 设备,是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。 是一个。	新纲化值等的有效的指数 有价值的 有效的 化价值的 有效的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化分子	债 债 基金资产 主基金资产 基金资产 E。 服指期货交易	10,280 10,000 净值比例大小 净值比例大小 交易情况说明	排名的	1,070,6 998,2 可削十名的	662.00 200.00 6产支持 以证投並 公案调查	管明细 在,在本报告 的股票。 237 5,334	0.16 0.15 明细 存編制日前 7,120.49 4,117.03
110003 110015 110015 期未期未按分 期末,本基金分 期末,本基金校分 期末,本期末基金 投资期内,本基本金 投资期内,本组内本的 设态投资投资的格成 是一个人。 是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	新纲化值等的有效的指数 有价值的 有效的 化价值的 有效的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化分子	债 债 基金资产 主基金资产 基金资产 E。 服指期货交易	10,280 10,000 净值比例大小 净值比例大小 交易情况说明	排名的	1,070,6 998,2 內前十名記 內前五名相 管部门立 同。 日本选股票	662.00 200.00 6产支持 以证投並 公案调查	所知 至 在本报告 的股票。 237 5,334 598 782	0.16 0.15 明细 行,120.49 1,117.03 3,600.94 2,322.22
110003 110015 被	新纲化值等的有效的指数 有价值的 有效的 化价值的 有效的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化分子	债 债 基金资产 主基金资产 基金资产 E。 服指期货交易	10,280 10,000 净值比例大小 净值比例大小 交易情况说明	排名的	1,070,6 998,2 內前十名記 內前五名相 管部门立 同。 日本选股票	662.00 200.00 6产支持 以证投並 公案调查	所知 至 在本报告 的股票。 237 5,334 598 782	0.16 0.15 明細 行,120.49 1,117.03 3,600.94
110003 110015 按公司 报告期末基份期末的期期在当期报告期末基份 期末法期本经营和工作。 1100000000000000000000000000000000000	新纲化值等的有效的指数 有价值的 有效的 化价值的 有效的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化价值的 有效的 化分子	债 债 基金资产 主基金资产 基金资产 E。 服指期货交易	10,280 10,000 净值比例大小 净值比例大小 交易情况说明	排名的	1,070,6 998,2 內前十名記 內前五名相 管部门立 同。 日本选股票	662.00 200.00 6产支持 以证投並 公案调查	所知 至 在本报告 的股票。 237 5,334 598 782	0.16 0.15 明细 行,120.49 1,117.03 3,600.94 2,322.22
110003 110015 安运 招告期末告期末后期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期末年期	新紀 经转记 经	债债 债基金均证券产产。 基金特证券产产,则是有证券产产。 是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,是一个。 是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,是一个,	10,280 10,000 9 值比例大小 单值比例大小 交易情况说明 9 的发行主体 未受到公开罐 超出基金合同	排名的	1,070,6 998,2 內前十名記 內前五名相 管部门立 同。 日本选股票	662.00 200.00 6产支持 以证投並 公案调查	管明细 6,在本报告 的股票。 237 5,334 598 782 212	0.16 0.15 明细 行,120.49 1,117.03 3,600.94 2,322.22
110003 110015 程合 报告期末活致活用的 110015 程 报告期末活射末活射 110015 期末告期末结射末结射末结射末结射末结射末结射末结射末结射 期内统组合基 超级的现象的 11000 存起收取利 11000 证收收利 11000 取收收利 11000 放收收利 11000 放收收利 11000 放收性费用 后计 程等即来持有	新紀 转音 经	债债 债基金的产产。 一支持金资产 E. 服 明货交还 E. 服 明货交还 所以, 任子主体有关。 是一个, 是一个, 是一个, 是一个, 是一个, 是一个, 是一个, 是一个,	10,280 10,000 即值比例大小 争值比例大小 交易情况说明 。 幹的发行主体 未受到公开疆 组出基金台同	排名的 未被监监 责处处 则定的	1,070,6 998,2 998,2 97国十名6 9前五名杜 管部门立 96选股票 金額(5	662.00 200.00 7 文章 200.00 200	育明細 237 5,334 598 782 212	0.16 0.15 明细 7,120.49 4,117.03 3,600.94 2,322.22 2,056.26 ———————————————————————————————————
110003 110015 110015 担当即天安全 期末、标准和天安全 期报告期末规定 报告期末本基本全 是有期内本制度 报告期末基本 经有期内本制度 股企程是是 股企程是 股企程是 股份 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收 取收	新紀 转音 经	债债 债益金的产产。 一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个	10,280 10,000 10,000 淨值比例大小 交易情况说明 今的发行主体 来受到公开疆 出出縣金台同	排名的 未被监狱 未被监狱 人 允价	1,070,6 998,2 998,2 97雨十名 8 97雨十名 8 97雨十名 8 97雨十名 8 97雨十名 8 970 978 金額(2 978 金額(2 978 金額(2 978 金額(2 978) 金額(2 978) 金額(2 978) 金額(2 978) 金額(2 978) 金額(2 978) 金額(2 978) 金 978) 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 金 978 978	662.00 200.00 60 元 60 元 60 元 60 元 60 元 61 元 61 元 61 元 61 元 61 元 61 元 61 元 61	育明細 至,在本报告 的股票。 237 5,334 598 782 212	0.16 0.15 明细 7,120.49 4,117.03 3,600.94 2,322.22 2,056.26 ———————————————————————————————————
110003 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015	新紀 转音 经	借 情 情 一 文 持 所 等 方 等 方 等 方 等 方 等 方 等 方 等 方 等 方 等 后 等 间 等 后 等 后 等 后 等 一 行 一 行 入 没 后 行 一 行 入 没 后 行 。 没 合 后 合 后 合 后 一 后 一 后 一 后 一 后 一 后 一 后 一 后	10,280 10,000 即值比例大小 。 。 。 。 。 。 单值比例大小 交易情况说明 。 。 等的发行主体 。 多的发行主体 。 多的发行主体 。 多的发行主体 。 多的发行主体 。 多的发 。 一 。 多种。	排名的 未被监处处 完价 5,1,	1,070,6 998,2 57町十名店 竹前五名店 竹前五名店 管部门立 金額(2 6 6 6 7 7 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	662.00 (200.00) (200	育明細 237 5,334 598 782 212	0.16 0.15 列邦明 7.7,120.49 5,117.03 6,600.94 4,322.22 2,056.26
110003 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015	新納較時 石化矿 经工程 化二甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基	借 借	10,280 10,000 钟恒比例大小 空場情况说明 空前投行主体 表型到公开主体 超出基础会合同。	排名的 未被监监 放处 分允价 5,1,1	1,070,6 998,2 7月前十名 6 7月前五名 7月前五 7月前五 7月前五 7月前五 7月前五 7月前五 7月前五 7月前五	662.00 100.0	育明細 237 5,334 598 782 212	0.16 0.15 明细 7,120.49 1,117.03 8,600.94 1,322.22 2,056.26
110003 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015 110015	新納較時 石化矿 经工程 化二甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基甲基	借 借	10,280 10,000 钟恒比例大小 空場情况说明 空前投行主体 表型到公开主体 超出基础会合同。	排名的 未被监监 放处 分允价 5,1,1	1,070,6 998,2 998,2 998,2 998,200,0 185,200,0 070,662,2 998,200,0	662.00 100.0	育明細 237 5,334 598 782 212	0.160 0.15 9.17 9.17 9.17 9.17 9.05 9.05 9.05 9.05 9.05 9.05 9.05 9.05
110003 110015 110015 招告期末按公司 报告期末按知末按据 报告期末按据 报告期末按据 报告期末按据 报告期末按据 报告期末按据 报告期末按据 经期末,本基本 经验股份的 成本基金是投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金投货的的, 在基金基金是投货的的。 110022 2倍期末的十一个	新報及於 五化社直大 大学の作用作的 大学の作用作的 大学の作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用作用	(情)	10,280 10,280 10,200	排名的 未费规 分允价 5, 1, 1 9 數 1 9 数 1 9 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	1,070.4 998.5 998.5 998.5 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 999.7 9998.7 999	62.00 662.00 67 67 67 67 67 67 67 67	答明細 237,在本报告 6的股票。 237,5,334 598 78.2 21.2 7,164 基金资产消 (%)	0.16 0.15 0.15 0.15 0.15 0.15 0.15 0.15 0.15
110003 110015 1	新祖生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产生产	(情) 情情 图	10,280 10,280 10,200	非名的 未被监监 外介价 5, 1, 9 9 9 9 9 9 9 9 9 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8	1,070.4 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 999	662.00 662.00 662.00 667.00 67.0	深明細 233-24 5,3343 5,994 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 6 7,164 7,1	0.161 0.15 0.15 0.15 0.15 0.17
110003 110015 1	新爾林夫 在化转点 大学的時代 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的	(情) 情情 图	10,280 10,280 10,200	排名的 未被监狱之际的 5,介价 5,1, 9则表表述 20基本 30。	1,070.4 998.5 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 999	662.00 66	78 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元	0.161年 0.15 0.15 0.15 0.15 0.12 0.12 0.12 0.12 0.12 0.12 0.12 0.13 0.14 0.14 0.14 0.14 0.15 0.1
110003 110015 110015 和沒術則未按述金 和沒術則未被全 相沒術則未被全 相沒術則未被 相沒術則未來 程信則未來 是信期以本基 是信期、 是信的、 是	新爾林 经分配	(情)	10,280 10,280 10,200	非名的 未被监狱之际的 5, 1, 95% 29%	1,070.4 998.5 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 998.7 999	662.00 662.00 67	新報報 23.在本報と 23.59 5.33-35 5.33-35 7.16-6 (第) 7.16-7 (第) ①一③ -7.05%	0.161 0.15
110003 110015 110015 和沒術則未按查 排沒術則未按查 排沒術則未被 排沒術則未被 經濟別表。 「一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一個一	新爾林夫 在化转点 大学的時代 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的 大学的	(情) 情情 图	10,280 10,280 10,200	排名的 未被监狱之际的 5,介价 5,1, 9则表表述 20基本 30。	1,070.4 988.3 998.3 998.3 約前五名柱 (第一月)	662.00 66	78 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元本報告 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元元 (元	0.161年 0.15 0.15 0.15 0.15 0.12 0.12 0.12 0.12 0.12 0.12 0.12 0.13 0.14 0.14 0.14 0.14 0.15 0.1