

丰和价值证券投资基金 2010 年年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|------------------------|
| 基金简称 | 嘉实丰和价值封闭（深交所上市简称：基金丰和） |
| 基金主代码 | 184721 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 2002 年 3 月 22 日 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,000,000,000.00 份 |
| 基金合同存续期 | 15 年 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2002 年 4 月 4 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金为价值型证券投资基金，主要投资于依照有关区分股票价值、成长特征的指标所界定的价值型股票，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用“自上而下”与“自下而上”相结合的投资方法，在综合宏观经济发展情况、政策取向、证券市场走势等多种因素的基础上，确定基金在股票、国债上的投资比例。坚持价值型投资理念，确立以相对价值判断为核心，兼顾对公司内在价值评估的选股思路；同时，以基本分析为基础，重视数量分析，系统考察上市公司的投资价值，最终确定所投资的股票，并以技术分析辅助个股投资的时机选择。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|-------------------|-----------------------|
| 名称 | | 嘉实基金管理有限公司 | 中国农业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 胡勇钦 | 李芳菲 |
| | 联系电话 | (010) 65215588 | (010) 68424199 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | lifangfei@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-600-8800 | 95599 |
| 传真 | | (010) 65182266 | (010) 68424181 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.jsfund.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层 嘉实基金管理有限公司 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2010 年 | 2009 年 | 2008 年 |
|---------------|----------------|-----------------|-------------------|
| 本期已实现收益 | 364,296,524.96 | 774,200,127.81 | -1,482,954,989.52 |
| 本期利润 | 748,236,933.56 | 916,696,598.03 | -2,183,678,595.19 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2494 | 0.3056 | -0.7279 |
| 本期加权平均净值利润率 | 23.69% | 35.19% | -56.08% |
| 本期基金份额净值增长率 | 24.89% | 43.85% | -34.52% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2010 年末 | 2009 年末 | 2008 年末 |
| 期末可供分配利润 | 146,144,363.58 | -218,152,161.38 | -992,352,289.19 |

| | | | |
|--------------|------------------|------------------|------------------|
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0487 | -0.0727 | -0.3308 |
| 期末基金资产净值 | 3,754,933,095.57 | 3,006,696,162.01 | 2,089,999,563.98 |
| 期末基金份额净值 | 1.2516 | 1.0022 | 0.6967 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 2010 年末 | 2009 年末 | 2008 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 469.07% | 355.68% | 216.85% |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

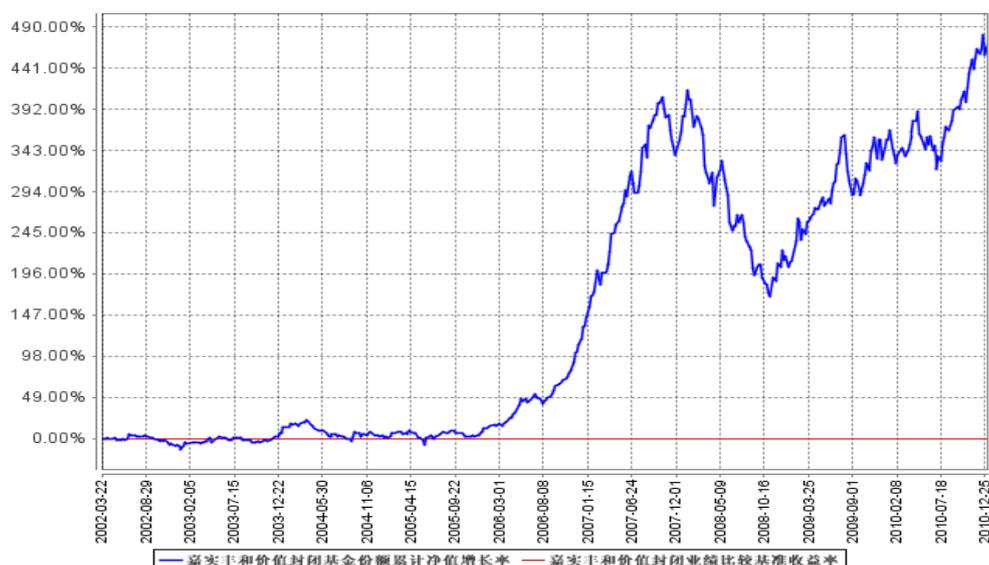
3.2 基金净值表现

3.2.1 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 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| 过去三个月 | 13.01% | 2.53% | | | | |
| 过去六个月 | 31.73% | 2.20% | | | | |
| 过去一年 | 24.89% | 2.42% | | | | |
| 过去三年 | 17.63% | 3.31% | | | | |
| 过去五年 | 426.10% | 3.16% | | | | |
| 自基金合同生效起至今 | 469.07% | 2.74% | | | | |

3.2.2 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

嘉实丰和价值封闭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

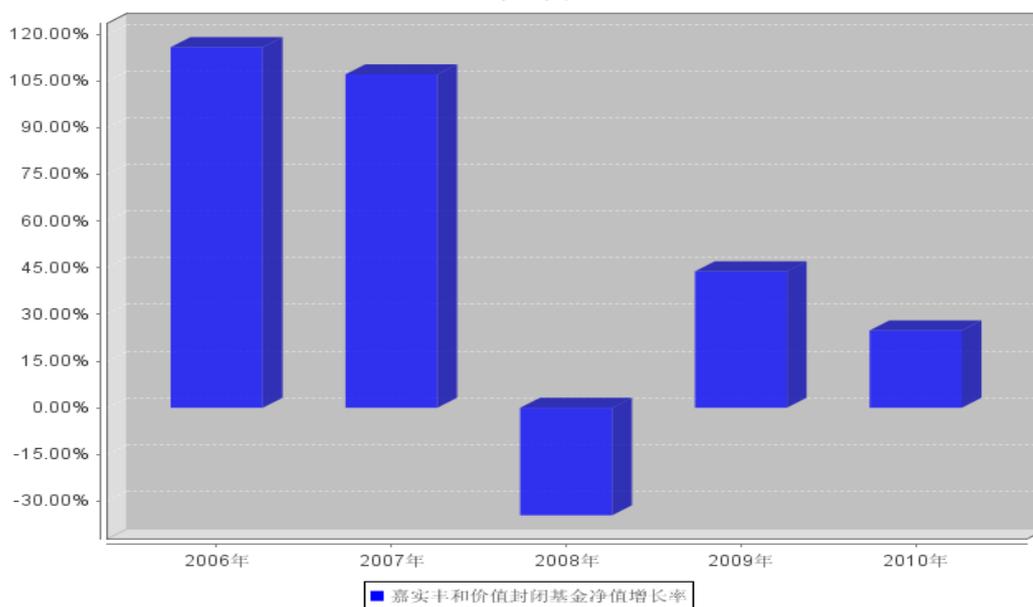


注：按基金合同约定，本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项

项投资比例符合基金合同（七、（四）投资组合）的有关约定：（1）本基金投资于股票、债券的比重不低于基金资产总值的 80%，投资于国债的比重不低于基金资产净值的 20%；（2）本基金投资于一家上市公司的股票，不超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与由本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%；（4）本基金股票投资组合的平均 B/P 值高于沪深 A 股市场的平均 B/P 值；（5）遵守中国证监会规定的其他比例限制。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实丰和价值封闭过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

| 年度 | 每10份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|-------------|------------------|-----------|------------------|----|
| 2010年 | - | - | - | - | |
| 2009年 | - | - | - | - | |
| 2008年 | 15.700 | 4,710,000,000.00 | - | 4,710,000,000.00 | |
| 合计 | 15.700 | 4,710,000,000.00 | - | 4,710,000,000.00 | |

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地在上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截至 2010 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、21 只开放式基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、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、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实价值优势股票、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金基金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 顾义河 | 本基金基金经理 | 2009 年 6 月 17 日 | - | 10 年 | 曾任职于中银国际控股有限公司，2002 年 9 月加盟嘉实基金管理有限公司，先后任分析师、高级分析师。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。 |

注：（1）任职日期、离任日期是指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《丰和价值证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运

作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与其他投资组合的投资风格不同，未与其他投资组合进行业绩比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中国经济表现出强劲的增长，企业利润保持了较好的增长，而房价、CPI 走高引发政府“有形之手”的强力调控，经济政策逐步收紧，为对冲欧债危机、中美贸易摩擦等影响外需的因素，政府先后出台了国内新兴行业及部分区域的振兴规划，希冀实现经济的战略转型。经济结构的转变带来的资本市场的相对力量的转变：第一，全年 300 多家代表新经济的中小市值公司登陆资本市场，而代表传统经济的房地产公司融资渠道几近萎缩。第二，全年沪深 300 指数全年大幅度跑输中证 500 指数。

报告期内，本基金并没有将仓位选择作为超额收益的来源，而是力图通过行业结构和个股的选择来获取超额收益，因此报告期内本基金仓位稳定在中高水平。本基金主要超配了代表经济转型的新材料、电力设备、软件、建筑装饰、医药、食品等行业，并适度参与了周期性品种的的阶段投资机会，低配了金融、地产、钢铁、水泥等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2516 元，本报告期基金份额净值增长率为 24.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年中国经济将面临艰巨的国际国内形势：一方面，全球宽松流动性带来的通胀压力始终困扰中国；另一方面，如何实现经济成功转型和社会和谐的平衡考验管理层的智慧，这意味着经济转型过程是长期而曲折的。我们认为，中国今年的经济政策将始终在收、放之间寻求平衡，资本市场也将随之而波动。鉴于市场整体估值水平处于历史上中低位置，我们认为市场向下的空间不大；而新公司的密集上市将为市场提供较好的备选投资池，我们将继续坚持深挖个股，在代表中国经济转型的行业和公司中寻找机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配。

(2) 根据本报告 3.1.1 “本期已实现收益”为 364,296,524.96 元，3.1.2 “期末可供分配利润”为 146,144,363.58 元，期末可供分配基金份额利润为 0.0487 元，本基金管理人拟在 2011 年 3 月 28 日发布本基金收益分配公告，向本基金份额持有人分配利润 0.044 元/份，符合本基金基金合同和法律法规的规定。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管丰和价值证券投资基金的过程中，本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《丰和价值证券投资基金基金合同》、《丰和价值证券投资基金托管协议》的约定，对丰和价值证券投资基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在丰和价值证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支、利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，丰和价值证券投资基金的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的丰和价值证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

丰和价值证券投资基金 2010 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司审计、注册会计师汪棣、陈宇签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2011)第 20635 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：丰和价值证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2010 年 12 月 31 日 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 7.4.7.1 | 64,572,178.55 | 178,278,309.12 |
| 结算备付金 | | 8,153,242.85 | 6,376,954.12 |
| 存出保证金 | | 1,160,000.00 | 1,160,000.00 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 3,726,226,543.32 | 2,780,653,713.73 |
| 其中：股票投资 | | 2,950,065,943.32 | 2,157,970,577.73 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 776,160,600.00 | 622,683,136.00 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 7.4.7.3 | - | 2,356,380.75 |
| 买入返售金融资产 | 7.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 886,352.99 | 41,556,916.22 |
| 应收利息 | 7.4.7.5 | 19,233,400.33 | 5,938,943.50 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 7.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 3,820,231,718.04 | 3,016,321,217.44 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2010 年 12 月 31 日 | 上年度末 2009 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 7.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 53,713,663.19 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 4,747,315.02 | 3,776,299.12 |
| 应付托管费 | | 791,219.15 | 629,383.18 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 7.4.7.7 | 3,856,349.09 | 3,029,297.11 |
| 应交税费 | | 1,340,076.02 | 1,340,076.02 |
| 应付利息 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.8 | 850,000.00 | 850,000.00 |
| 负债合计 | | 65,298,622.47 | 9,625,055.43 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.9 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | 7.4.7.10 | 754,933,095.57 | 6,696,162.01 |
| 所有者权益合计 | | 3,754,933,095.57 | 3,006,696,162.01 |
| 负债和所有者权益总计 | | 3,820,231,718.04 | 3,016,321,217.44 |

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2516 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：丰和价值证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日 |
|---------------|----------|---|--|
| 一、收入 | | 828,188,618.40 | 1,006,052,544.58 |
| 1. 利息收入 | | 21,575,335.23 | 21,337,148.09 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.11 | 1,503,268.55 | 917,610.28 |
| 债券利息收入 | | 20,072,066.68 | 20,419,537.81 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益 | | 422,604,376.04 | 842,178,926.27 |
| 其中：股票投资收益 | 7.4.7.12 | 407,410,673.27 | 818,869,965.93 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 7.4.7.13 | 209,115.94 | 7,840,773.33 |
| 资产支持证券投资 | 7.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 7.4.7.15 | 819,046.55 | - |
| 股利收益 | 7.4.7.16 | 14,165,540.28 | 15,468,187.01 |
| 3. 公允价值变动收益 | 7.4.7.17 | 383,940,408.60 | 142,496,470.22 |
| 4. 汇兑收益 | | - | - |
| 5. 其他收入 | 7.4.7.18 | 68,498.53 | 40,000.00 |
| 减：二、费用 | | 79,951,684.84 | 89,355,946.55 |
| 1. 管理人报酬 | | 47,406,773.60 | 38,881,414.92 |
| 2. 托管费 | | 7,901,128.93 | 6,480,235.89 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 7.4.7.19 | 22,715,123.87 | 42,795,387.48 |

| | | | |
|---------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| 5. 利息支出 | | 1,450,388.44 | 720,758.26 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 1,450,388.44 | 720,758.26 |
| 6. 其他费用 | 7.4.7.20 | 478,270.00 | 478,150.00 |
| 三、利润总额 | | 748,236,933.56 | 916,696,598.03 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 | | 748,236,933.56 | 916,696,598.03 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：丰和价值证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日 | | |
|---------------------------|---|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 3,000,000,000.00 | 6,696,162.01 | 3,006,696,162.01 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 748,236,933.56 | 748,236,933.56 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,000,000,000.00 | 754,933,095.57 | 3,754,933,095.57 |
| 项目 | 上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 3,000,000,000.00 | -910,000,436.02 | 2,089,999,563.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 916,696,598.03 | 916,696,598.03 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 四、本期向基金份额持有 | - | - | - |

| | | | |
|-----------------|------------------|--------------|------------------|
| 人分配利润产生的基金净值变动 | | | |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 3,000,000,000.00 | 6,696,162.01 | 3,006,696,162.01 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|-----------------|-----------------|----------------|
| _____ 赵学军 _____ | _____ 李松林 _____ | _____ 王红 _____ |
| 基金管理公司负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 差错更正的说明

报告期内本基金无涉及重大会计差错事项。

7.4.3 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|-----------------|
| 嘉实基金管理有限公司 | 基金发起人、基金管理人 |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人 |
| 中诚信托有限责任公司 | 基金发起人、基金管理人的股东 |
| 立信投资有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 德意志资产管理(亚洲)有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 国都证券有限责任公司 | 与基金管理人同受重大影响的公司 |
| 吉林省信托投资有限责任公司 | 基金发起人 |
| 广发证券股份有限公司 | 基金发起人 |
| 北京证券有限责任公司 | 基金发起人 |

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|
| | | |

| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) |
|------------|----------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 国都证券有限责任公司 | 3, 718, 179, 418. 64 | 24. 87 | 3, 291, 533, 151. 76 | 11. 81 |

7.4.4.1.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 | |
|------------|-----------------------------|----------------------|----------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的比例 (%) |
| 国都证券有限责任公司 | 6, 323, 971. 70 | 85. 29 | 43, 955, 860. 50 | 21. 65 |

7.4.4.1.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 | |
|------------|-----------------------------|------------------------|----------------------------------|------------------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交 总额的比例 (%) |
| 国都证券有限责任公司 | 100, 000, 000. 00 | 100. 00 | - | - |

7.4.4.1.2 权证交易

本期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | | | |
|------------|----------------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的 比例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总 额的比例 (%) |
| 国都证券有限责任公司 | 3, 160, 448. 51 | 25. 43 | 174, 814. 09 | 4. 54 |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 | | | |
| | 当期佣金 | 占当期佣金总量的比 例 (%) | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总 额的比例 (%) |
| 国都证券有限责任公司 | 2, 797, 776. 88 | 11. 99 | 282, 455. 93 | 9. 34 |

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究

成果和市场信息服务等。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 47,406,773.60 | 38,881,414.92 |
| 其中：支付给销售机构的客户维护费 | - | - |

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理人报酬。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 7,901,128.93 | 6,480,235.89 |

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期 | | | | | | |
|-----------------------|---------------|---------------|-------|------|---------------|-----------|
| 2010年1月1日至2010年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国农业银行 | 10,381,712.33 | 10,387,487.26 | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 | | | | | | |
| 2009年1月1日至2009年12月31日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 中国农业银行 | 49,883,282.31 | - | - | - | 60,040,000.00 | 14,718.36 |

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| | 2010年1月1日至2010年12月31日 | 2009年1月1日至2009年12月31日 |
| 基金合同生效日（2002年3月22日）持有的基金份额 | - | - |
| 期初持有的基金份额 | 12,010,000.00 | 12,010,000.00 |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 12,010,000.00 | 12,010,000.00 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.40% | 0.40% |

注：基金管理人作为本基金发起人，于本基金发行期间 2002 年 3 月 15 日至 2002 年 3 月 18 日通过网下配售认购本基金份额 6,000,000 份，每份发行价格为 1.01 元，其中：面值为 1.00 元；发行费用为 0.01 元；通过二级市场买入本基金基金份额 6,010,000 份，交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2010年12月31日 | | 上年度末 2009年12月31日 | |
|------------|--------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份 额占基金总份 额的比例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份 额占基金总份 额的比例（%） |
| 中诚信托有限责任公司 | 6,000,000.00 | 0.20 | 6,000,000.00 | 0.20 |
| 立信投资有限责任公司 | 3,000,000.00 | 0.10 | 3,000,000.00 | 0.10 |
| 广发证券股份有限公司 | 3,000,000.00 | 0.10 | 3,000,000.00 | 0.10 |

注：（1）中诚信托有限责任公司（原中煤信托投资有限责任公司）、吉林省信托投资有限责任公司、广发证券股份有限公司作为本基金发起人，均于本基金发行期间 2002 年 3 月 15 日至 2002 年 3 月 18 日通过网下配售各认购本基金份额 6,000,000 份，每份发行价格为 1.01 元，其中：面值为 1.00 元；发行费用为 0.01 元。基金合同生效一年以后的存续期间，各基金发起人持有的基金份额不得低于其认购基金份额的 50%。

（2）吉林省信托投资有限责任公司作为本基金发起人，其持有的本基金 3,000,000 份转让给立信投资有限责任公司，于 2008 年 3 月 31 日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完过户手续。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 | | 上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日 | |
|--------|-----------------------------|--------------|----------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国农业银行 | 64,572,178.55 | 1,423,302.82 | 178,278,309.12 | 773,818.65 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.5.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|------------|------------|-------|--------|--------------|---------------|---------------|----|
| 300157 | 恒泰艾普 | 2010年12月29日 | 2011年4月7日 | ipo网下锁定三个月 | 57.00 | 57.00 | 440,000 | 25,080,000.00 | 25,080,000.00 | - |
| 300134 | 大富科技 | 2010年10月14日 | 2011年1月26日 | ipo网下锁定三个月 | 49.50 | 66.00 | 186,915 | 9,252,292.50 | 12,336,390.00 | - |
| 601177 | 杭齿前进 | 2010年9月29日 | 2011年1月11日 | ipo网下锁定三个月 | 8.29 | 16.03 | 322,459 | 2,673,185.11 | 5,169,017.77 | - |
| 600998 | 九州通 | 2010年10月27日 | 2011年2月9日 | ipo网下锁定三个月 | 13.00 | 14.55 | 267,102 | 3,472,326.00 | 3,886,334.10 | - |
| 300125 | 易世达 | 2010年9月27日 | 2011年1月13日 | ipo网下锁定三个月 | 55.00 | 83.49 | 37,672 | 2,071,960.00 | 3,145,235.28 | - |
| 601126 | 四方股份 | 2010年12月28日 | 2011年3月31日 | ipo网下锁定三个月 | 23.00 | 31.11 | 88,502 | 2,035,546.00 | 2,753,297.22 | - |

7.4.5.1.2 受限证券类别：债券

报告期末（2010年12月31日）本基金未持有流通受限的债券。

7.4.5.1.3 受限证券类别：其他

报告期末（2010年12月31日）本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|-------------|----------|--------|------------|--------|-----------|----------------|----------------|----|
| 600518 | 康美药业 | 2010年12月28日 | 配股申购期间停牌 | 19.71 | 2011年1月6日 | 17.29 | 8,112,316 | 113,113,194.38 | 159,893,748.36 | - |
| 600664 | 哈药股份 | 2010年12月29日 | 重要事项未公告 | 22.57 | 2011年2月16日 | 24.83 | 1,999,982 | 50,760,716.41 | 45,139,593.74 | - |

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

报告期末（2010年12月31日）本基金银行间市场债券正回购余额为零。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

报告期末（2010年12月31日）本基金的交易所债券正回购余额为零。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 2,950,065,943.32 | 77.22 |
| | 其中：股票 | 2,950,065,943.32 | 77.22 |
| 2 | 固定收益投资 | 776,160,600.00 | 20.32 |
| | 其中：债券 | 776,160,600.00 | 20.32 |
| | 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 | 72,725,421.40 | 1.90 |
| 6 | 其他各项资产 | 21,279,753.32 | 0.56 |
| | 合计 | 3,820,231,718.04 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 48,921,694.80 | 1.30 |
| B | 采掘业 | 90,046,747.37 | 2.40 |

| | | | |
|-----|----------------|------------------|-------|
| C | 制造业 | 1,744,170,836.62 | 46.45 |
| C0 | 食品、饮料 | 196,939,151.82 | 5.24 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 22,219,505.88 | 0.59 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 288,892,119.59 | 7.69 |
| C5 | 电子 | 25,640,416.70 | 0.68 |
| C6 | 金属、非金属 | 78,738,325.03 | 2.10 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 657,938,226.82 | 17.52 |
| C8 | 医药、生物制品 | 473,803,090.78 | 12.62 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 338,941,975.41 | 9.03 |
| F | 交通运输、仓储业 | 1,114,000.00 | 0.03 |
| G | 信息技术业 | 546,951,338.76 | 14.57 |
| H | 批发和零售贸易 | 144,029,640.18 | 3.84 |
| I | 金融、保险业 | 32,413,974.90 | 0.86 |
| J | 房地产业 | 330,500.00 | 0.01 |
| K | 社会服务业 | 3,145,235.28 | 0.08 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 2,950,065,943.32 | 78.57 |

8.3 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 002152 | 广电运通 | 4,704,523 | 255,831,960.74 | 6.81 |
| 2 | 002073 | 软控股份 | 6,593,191 | 175,972,267.79 | 4.69 |
| 3 | 600970 | 中材国际 | 4,036,183 | 164,313,009.93 | 4.38 |
| 4 | 600518 | 康美药业 | 8,112,316 | 159,893,748.36 | 4.26 |
| 5 | 600458 | 时代新材 | 2,378,204 | 151,776,979.28 | 4.04 |
| 6 | 002063 | 远光软件 | 4,514,708 | 140,407,418.80 | 3.74 |
| 7 | 002482 | 广田股份 | 1,435,311 | 121,656,960.36 | 3.24 |
| 8 | 002410 | 广联达 | 1,594,735 | 113,226,185.00 | 3.02 |
| 9 | 600298 | 安琪酵母 | 2,360,434 | 104,520,017.52 | 2.78 |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 2,415,555 | 92,419,134.30 | 2.46 |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 252,013,304.01 | 8.38 |
| 2 | 002152 | 广电运通 | 187,649,958.13 | 6.24 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 133,686,389.13 | 4.45 |
| 4 | 002073 | 软控股份 | 131,046,061.43 | 4.36 |
| 5 | 601111 | 中国国航 | 128,876,853.24 | 4.29 |
| 6 | 600970 | 中材国际 | 120,391,134.33 | 4.00 |
| 7 | 600518 | 康美药业 | 113,113,194.38 | 3.76 |
| 8 | 601699 | 潞安环能 | 107,528,888.49 | 3.58 |
| 9 | 002037 | 久联发展 | 104,850,138.26 | 3.49 |
| 10 | 000602 | 金马集团 | 102,529,981.51 | 3.41 |
| 11 | 002482 | 广田股份 | 97,720,257.50 | 3.25 |
| 12 | 600312 | 平高电气 | 92,537,435.15 | 3.08 |
| 13 | 002430 | 杭氧股份 | 90,402,650.79 | 3.01 |
| 14 | 600785 | 新华百货 | 89,173,099.48 | 2.97 |
| 15 | 600887 | 伊利股份 | 85,283,288.63 | 2.84 |
| 16 | 600298 | 安琪酵母 | 84,587,244.31 | 2.81 |
| 17 | 600276 | 恒瑞医药 | 84,097,876.83 | 2.80 |
| 18 | 000708 | 大冶特钢 | 81,080,953.32 | 2.70 |
| 19 | 002063 | 远光软件 | 79,172,160.80 | 2.63 |
| 20 | 600497 | 驰宏锌锗 | 73,606,866.67 | 2.45 |
| 21 | 000718 | 苏宁环球 | 73,195,988.92 | 2.43 |
| 22 | 600423 | 柳化股份 | 72,571,653.12 | 2.41 |
| 23 | 002007 | 华兰生物 | 71,639,755.92 | 2.38 |
| 24 | 002099 | 海翔药业 | 71,237,883.89 | 2.37 |
| 25 | 600125 | 铁龙物流 | 69,858,740.08 | 2.32 |
| 26 | 600031 | 三一重工 | 68,996,602.41 | 2.29 |
| 27 | 600778 | 友好集团 | 68,108,976.51 | 2.27 |
| 28 | 601607 | 上海医药 | 67,360,045.55 | 2.24 |
| 29 | 600527 | 江南高纤 | 66,507,494.69 | 2.21 |
| 30 | 002341 | 新纶科技 | 65,687,111.81 | 2.18 |
| 31 | 000792 | 盐湖钾肥 | 64,281,519.87 | 2.14 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 32 | 000063 | 中兴通讯 | 60,013,564.55 | 2.00 |
|----|--------|------|---------------|------|

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 230,020,580.94 | 7.65 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 196,761,258.42 | 6.54 |
| 3 | 600458 | 时代新材 | 147,412,903.21 | 4.90 |
| 4 | 601111 | 中国国航 | 140,294,685.74 | 4.67 |
| 5 | 000602 | 金马集团 | 119,765,286.52 | 3.98 |
| 6 | 601699 | 潞安环能 | 105,302,854.60 | 3.50 |
| 7 | 600312 | 平高电气 | 99,899,634.95 | 3.32 |
| 8 | 600863 | 内蒙华电 | 98,199,403.35 | 3.27 |
| 9 | 600581 | 八一钢铁 | 91,285,636.08 | 3.04 |
| 10 | 601169 | 北京银行 | 90,194,648.73 | 3.00 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 89,540,984.44 | 2.98 |
| 12 | 600707 | 彩虹股份 | 89,481,904.10 | 2.98 |
| 13 | 600048 | 保利地产 | 88,781,525.74 | 2.95 |
| 14 | 601888 | 中国国旅 | 87,710,596.45 | 2.92 |
| 15 | 601958 | 金钼股份 | 87,608,895.70 | 2.91 |
| 16 | 600125 | 铁龙物流 | 83,540,375.72 | 2.78 |
| 17 | 002114 | 罗平锌电 | 82,940,893.72 | 2.76 |
| 18 | 002007 | 华兰生物 | 80,682,395.99 | 2.68 |
| 19 | 002100 | 天康生物 | 80,642,652.61 | 2.68 |
| 20 | 000612 | 焦作万方 | 78,868,899.96 | 2.62 |
| 21 | 600239 | 云南城投 | 77,828,937.22 | 2.59 |
| 22 | 600111 | 包钢稀土 | 74,207,925.21 | 2.47 |
| 23 | 000718 | 苏宁环球 | 72,964,550.63 | 2.43 |
| 24 | 601607 | 上海医药 | 69,624,437.24 | 2.32 |
| 25 | 600031 | 三一重工 | 69,221,341.75 | 2.30 |
| 26 | 000060 | 中金岭南 | 68,803,930.80 | 2.29 |
| 27 | 600067 | 冠城大通 | 68,259,954.00 | 2.27 |
| 28 | 002038 | 双鹭药业 | 66,026,247.32 | 2.20 |
| 29 | 600423 | 柳化股份 | 64,698,869.37 | 2.15 |
| 30 | 000800 | 一汽轿车 | 63,943,272.09 | 2.13 |
| 31 | 002024 | 苏宁电器 | 63,930,315.94 | 2.13 |
| 32 | 002303 | 美盈森 | 63,536,568.74 | 2.11 |
| 33 | 000708 | 大冶特钢 | 62,421,845.78 | 2.08 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 34 | 600729 | 重庆百货 | 62,101,746.20 | 2.07 |
| 35 | 002065 | 东华软件 | 61,983,238.33 | 2.06 |
| 36 | 002428 | 云南锗业 | 61,937,959.13 | 2.06 |

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 7,514,886,713.84 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 7,524,690,677.18 |

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 60,855,600.00 | 1.62 |
| 2 | 央行票据 | 576,806,000.00 | 15.36 |
| 3 | 金融债券 | 138,499,000.00 | 3.69 |
| | 其中：政策性金融债 | 138,499,000.00 | 3.69 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| | 合计 | 776,160,600.00 | 20.67 |

8.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 0801017 | 08 央行票据 17 | 1,400,000 | 140,168,000.00 | 3.73 |
| 2 | 0801038 | 08 央行票据 38 | 1,000,000 | 100,320,000.00 | 2.67 |
| 3 | 0801035 | 08 央行票据 35 | 700,000 | 70,203,000.00 | 1.87 |
| 4 | 0801047 | 08 央行票据 47 | 500,000 | 50,195,000.00 | 1.34 |
| 5 | 090301 | 09 进出 01 | 500,000 | 49,815,000.00 | 1.33 |

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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和处罚。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,160,000.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 886,352.99 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 19,233,400.33 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| | 合计 | 21,279,753.32 |

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|---------------|----------|
| 1 | 600518 | 康美药业 | 159,893,748.36 | 4.26 | 配股申购期间停牌 |

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的基 金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|------------------|--------|------------------|--------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 42,069 | 71,311.42 | 1,582,513,660.00 | 52.75% | 1,417,486,340.00 | 47.25% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|-------------------------------------|----------------|----------|
| 1 | 中国人寿保险股份有限公司 | 263,061,105.00 | 8.77% |
| 2 | 中国人寿保险（集团）公司 | 144,921,794.00 | 4.83% |
| 3 | 泰康人寿保险股份有限公司—分红—个人分红—019L-FH002 深 | 138,295,299.00 | 4.61% |
| 4 | 泰康人寿保险股份有限公司—万能—个险万能 | 72,716,944.00 | 2.42% |
| 5 | 中国太平洋财产保险—传统—普通保险产品—013C-CT001 深 | 69,000,416.00 | 2.30% |
| 6 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 67,999,912.00 | 2.27% |
| 7 | UBS AG | 51,237,061.00 | 1.71% |
| 8 | 宝钢集团有限公司 | 48,000,000.00 | 1.60% |
| 9 | 嘉禾人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 46,795,860.00 | 1.56% |
| 10 | 泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L-CT001 深 | 43,865,519.00 | 1.46% |

注：上表数据由中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所

有限公司的审计费 100,000.00 元，该审计机构连续 9 年为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|--------------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 国都证券有限责任公司 | 1 | 3,718,179,418.64 | 24.87% | 3,160,448.51 | 25.43% | - |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | 3,570,557,506.51 | 23.88% | 2,901,099.28 | 23.35% | - |
| 德邦证券有限责任公司 | 1 | 2,463,913,483.95 | 16.48% | 2,094,321.56 | 16.85% | - |
| 国信证券股份有限公司 | 1 | 1,833,450,028.26 | 12.26% | 1,489,688.36 | 11.99% | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 2 | 1,657,917,288.63 | 11.09% | 1,362,567.84 | 10.97% | - |
| 国元证券股份有限公司 | 1 | 865,097,663.71 | 5.79% | 702,898.41 | 5.66% | - |
| 国盛证券有限责任公司 | 1 | 692,725,373.38 | 4.63% | 588,813.62 | 4.74% | - |
| 华泰联合证券有限责任公司 | 1 | 114,405,184.91 | 0.77% | 97,243.86 | 0.78% | - |
| 世纪证券有限责任公司 | 1 | 33,844,003.53 | 0.23% | 28,767.36 | 0.23% | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 渤海证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 长城证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订

协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|--------------|--------------|----------------|----------------|--------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国都证券有限责任公司 | 6,323,971.70 | 85.29% | 100,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 光大证券股份有限公司 | 998,070.20 | 13.46% | - | - | - | - |
| 德邦证券有限责任公司 | 92,520.94 | 1.25% | - | - | 2,316,341.90 | 100.00% |

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2011 年 3 月 28 日