

丰和价值证券投资基金 2015 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

送出日期：2016 年 3 月 29 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。董事 Bernd Amlung 未参会。

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 2016 年 3 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 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

基金名称	丰和价值证券投资基金
场内简称	基金丰和
基金简称	嘉实丰和价值封闭
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	2002-04-04

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	林葛
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010) 65182266	(010) 68121816

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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	977,519,170.30	527,345,522.16	243,432,187.06
本期利润	1,005,862,648.62	369,167,665.19	439,883,171.02
加权平均基金份额本期利润	0.3353	0.1231	0.1466
本期加权平均净值利润率	24.44%	11.56%	14.29%
本期基金份额净值增长率	28.23%	11.53%	15.92%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	978,520,918.15	340,001,747.85	-187,343,774.31
期末可供分配基金份额利润	0.3262	0.1133	-0.0624
期末基金资产净值	4,239,229,389.31	3,572,366,740.69	3,203,199,075.50
期末基金份额净值	1.4131	1.1908	1.0677
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	622.31%	463.27%	405.04%

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。

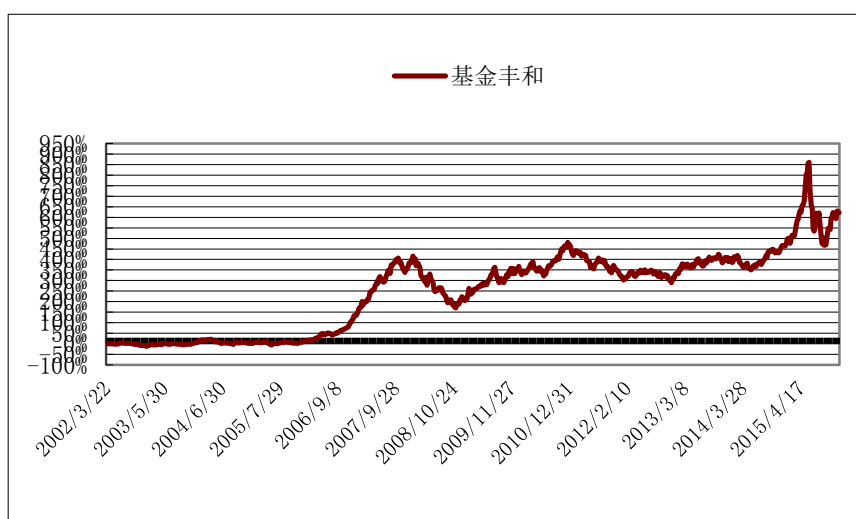
3.2 基金净值表现

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	26.51%	3.62%				
过去六个月	-2.63%	5.44%				

过去一年	28.23%	4.96%				
过去三年	65.78%	3.29%				
过去五年	26.93%	2.91%				
自基金合同生效起至今	622.31%	2.81%				

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



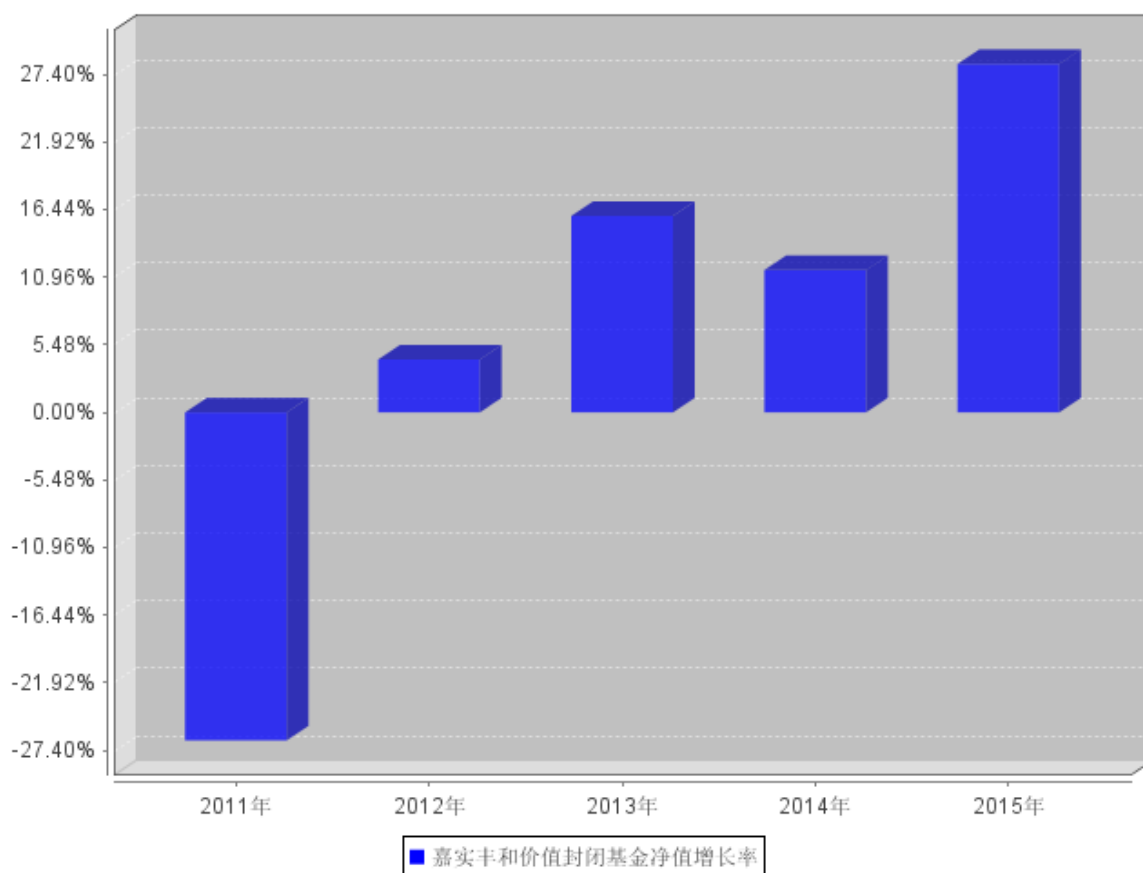
图：嘉实丰和价值封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图

(2002年3月22日至2015年12月31日)

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
2015	1.1300	339,000,000.00	-	339,000,000.00	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	1.1300	339,000,000.00	-	339,000,000.00	

§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。

截止 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、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、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴云峰	本基金基金经理	2014 年 11 月 26 日	-	7 年	曾任中国国际金融有限公司资产管理部研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究员，2012 年 2 月加

					入嘉实基金管理有限公司任研究部研究员、基金经理助理。博士，具有基金从业资格，中国国籍。
--	--	--	--	--	---

注：（1）任职日期、离任日期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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过

IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

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

2015 年年初在增量资金的推动下，市场热点纷呈，整体股票指数涨幅较大；6 月份在场外配资等杠杆限制政策的影响下，市场出现了较大幅度的调整，同时汇率贬值等宏观因素的变化也给市场引入了更多的不确定性，整体在 2015 年 3 季度股票市场出现了较大的波动。从 9 月份开始，随着宏观层面的阶段性稳定，市场出现了一波较大的存量资金驱动的行市。全年来看，上证综指上涨 9.41%，创业板指数上涨 84.41%，中小板指数上涨 53.7%，整体上仍然是以 TMT 为代表的新兴产业股票大幅跑赢传统大盘蓝筹股。具体分行业来看，计算机、旅游、通信等板块涨幅靠前，钢铁、煤炭、非银金融等板块涨幅靠后。

2015 年行情背后的主要推手仍然是流动性的宽松，贷款基准利率下降了 125 个 BP，同时存款准备金率下降了 250 个 bp，10 年期国债利率从 3.6% 下降到了 3% 以下。同时随着实体经济投资回报率的下降，全社会的财富都有向虚拟资产配置的趋势，尤其在非标资产的收益率下调以后，股票权益类资产的相对吸引力大幅提升，由此带来了 2014 年底至 2015 年年中的一波增量资金行情。具体分结构来看，契合宏观转型调结构的背景，以互联网为代表的新兴产业仍然是行情的主线。后续场外配资去杠杆的影响下，增量资金的流入趋势出现了逆转，市场出现了较大的调整，但是在巨大的存量流动性影响下，2015 年 4 季度仍然出现了一波较大的结构性行情。

在报告期内，本组合年初对低估值蓝筹的配置出现了一定的方向性错误，拖累了上半年的业绩表现。同时在股市剧烈调整时，由于缺乏应对经验，组合回撤幅度较大。在 4 季度通过结构的积极调整，获取了较好的投资回报。全年来看，组合获得 28% 的正收益，跑赢了组合的基准收益率，在同类竞争组中居于中间的位置。

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 1.4131 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从目前的经济数据来看，美国经济复苏的进程可能会继续维持，美联储加息的力度可能会超出市场预期，这会给人民币汇率带来压力，进而会限制央行货币宽松的力度。同时在经济层面，PMI 数据显示经济仍然存在下滑的压力，积极的财政政策的刺激效果可能还需要一段时间才会体现，因此展望 2016 年，宏观流动性进一步宽松的空间弱于 2015 年，同时经济目前还没有明确见底的迹象，因此 2016 年投资的难度会大于 2015 年，流动性的边际变化带来的股票估值压缩是 2016 年需要防范的最大风险。

人民币汇率和国内经济波动时 2016 年需要密切关注的两个重要因素，人民币汇率的调整会对国内货币政策形成一定的反向制约，进而对国内所有大类资产产生重要的影响。一旦人民币汇率调整结束，股票等各类资产也会相应找到底部区域。宏观经济的波动，尤其是供给侧改革（去产能）带来的影响会对传统周期蓝筹股产生重要影响，一旦经济企稳，产能去化完成，在调整中生存下来的传统周期股会迎来较大的价值重估机会。

虽然宏观环境 2016 年会弱于 2015 年，但是考虑到存量的流动性较多，我们仍然乐观的认为 2016 年股票市场存在结构性的机会。具体来看，我们认为投资机会主要在于以下三类：1、景气度确定上升，同时估值相对合理的行业，例如农业中的养殖以及产业向大陆转移的半导体板块；2、长期成长空间较大，可以通过成长消化估值的新兴产业，例如教育、体育、云计算、车联网；3、供给侧改革以及经济企稳带来的有色、钢铁等传统周期板块的价值重估。2016 年可能存在风险点有：1、人民币调整过程可能的资本外流压力；2、去产能过程中可能形成的信用风险冲击。

基于上述的判断，本组合在前期采取中性偏防御的仓位，后续会根据经济和汇率的调整信号，对组合的仓位进行积极的调整。在行业配置上，会在农业、教育、体育、云计算等板块中精选优质标的进行投资。同时也会关注供给侧改革带来的有色、钢铁等传统板块的价值机会。组合在 2016 年会时根据市场的变化情况进行及时应对，争取持有人带来不错的投资回报。

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、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，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，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金的基金管理人于 2015 年 4 月 1 日发布《丰和价值证券投资基金 2014 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 1.130 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 报告期内本基金未实施利润分配。

(3) 本基金的基金管理人于 2016 年 3 月 28 日发布《丰和价值证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 2.936 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

在托管本基金的过程中，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基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 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本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份

额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，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，嘉实基金管理有限公司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本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 2015 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计、注册会计师许康玮、洪磊签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字（2016）第 20284 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	94,730,027.23	53,229,128.43
结算备付金		14,155,777.99	8,206,117.27
存出保证金		7,930,231.39	491,782.89
交易性金融资产	7.4.7.2	4,087,598,687.55	3,515,353,086.20
其中：股票投资		3,190,649,687.55	2,790,346,086.20
基金投资		-	-
债券投资		896,949,000.00	725,007,000.00

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		33,416,156.20	36,894,574.00
应收利息	7.4.7.5	19,627,357.18	14,617,956.27
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		4,257,458,237.54	3,628,792,645.06
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014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		5,234,196.25	46,219,483.92
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,332,952.39	4,522,749.77
应付托管费		888,825.38	753,791.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,622,874.21	3,779,879.04
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,150,000.00	1,150,000.00
负债合计		18,228,848.23	56,425,904.37
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	1,239,229,389.31	572,366,740.69
所有者权益合计		4,239,229,389.31	3,572,366,740.69
负债和所有者权益总计		4,257,458,237.54	3,628,792,645.06

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4131 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年1月1日至 2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至 2014年12月31日
一、收入		1,136,422,094.89	440,859,405.72
1.利息收入		36,007,746.21	29,548,299.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,833,658.42	1,234,618.98
债券利息收入		34,174,087.79	28,225,497.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	88,182.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益		1,072,070,870.36	569,488,963.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,061,811,084.41	543,894,319.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	531,603.64	1,578,985.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	9,728,182.31	24,015,659.37
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	28,343,478.32	-158,177,856.97
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		130,559,446.27	71,691,740.53
1. 管理人报酬		61,508,952.47	47,975,999.09
2. 托管费		10,251,492.11	7,995,999.90
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	56,483,925.16	14,409,836.56
5. 利息支出		798,608.22	825,139.75
其中：卖出回购金融资产支出		798,608.22	825,139.75
6. 其他费用	7.4.7.19	1,516,468.31	484,765.23
三、利润总额		1,005,862,648.62	369,167,665.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润		1,005,862,648.62	369,167,665.19

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：2015年1月1日至2015年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015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	572,366,740.69	3,572,366,740.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,005,862,648.62	1,005,862,648.62
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	-	-339,000,000.00	-339,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	1,239,229,389.31	4,239,229,389.31
	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日		
项目	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	203,199,075.50	3,203,199,075.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	369,167,665.19	369,167,665.19
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	572,366,740.69	3,572,366,740.69

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
基金管理人负责人

王红
主管会计工作负责人

常旭
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与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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
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

本期(2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日)及上年度可比期间(2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日)，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	61,508,952.47	47,975,999.09
其中：支付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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	10,251,492.11	7,995,999.90

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

上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	-	-	-	-	50,440,000.00	32,698.37

注：本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
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		上年度末	
	2015 年 12 月 31 日		2014 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	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
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。

（3）中诚信托有限责任公司于 2014 年通过二级市场卖出本基金基金份额 3,000,000 份，交易费

用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

7.4.4.5 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 2015年1月1日至2015年12月 31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	94,730,027.23	1,489,223.61	53,229,128.43	1,167,477.92

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按适用利率计息。

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（2015年1月1日至2015年12月31日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年12月31日），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（2015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

本期末（2015年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
000796	凯撒旅游	2015年11月9日	重大事项停牌	27.46	-	-	29,300	473,124.00	804,578.00	-
300025	华星创业	2015年11月26日	重大事项停牌	30.15	-	-	1,708,587	37,572,831.58	51,513,898.05	-
600654	中安消	2015年12月14日	重大事项停牌	28.84	-	-	3,779,960	89,490,757.50	109,014,046.40	-
600988	赤峰黄金	2015年8月31日	重大事项停牌	11.88	2016年1月5日	12.73	8,205,607	111,099,558.86	97,482,611.16	-
601388	怡球资源	2015年7月27日	重大事项停牌	20.72	2016年2月15日	21.00	10,921,250	177,777,415.83	226,288,300.00	-

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

本期末（2015年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015年12月31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§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	3,190,649,687.55	74.94
	其中：股票	3,190,649,687.55	74.94
2	固定收益投资	896,949,000.00	21.07
	其中：债券	896,949,000.00	21.07
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	108,885,805.22	2.56
7	其他各项资产	60,973,744.77	1.43
	合计	4,257,458,237.54	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	243,763,006.37	5.75
B	采矿业	161,417,562.81	3.81
C	制造业	1,973,110,948.04	46.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	257,428,815.35	6.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	804,578.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	392,933,367.45	9.27
J	金融业	-	-

K	房地产业	37,650,091.00	0.89
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	66,388,041.72	1.57
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	57,153,276.81	1.35
S	综合	-	-
	合计	3,190,649,687.55	75.26

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	601388	怡球资源	10,921,250	226,288,300.00	5.34
2	002192	*ST 融捷	3,107,833	155,391,650.00	3.67
3	002446	盛路通信	3,946,771	146,425,204.10	3.45
4	300232	洲明科技	3,724,938	145,756,823.94	3.44
5	300047	天源迪科	3,980,250	115,825,275.00	2.73
6	002308	威创股份	4,685,352	115,493,926.80	2.72
7	000911	南宁糖业	6,844,381	114,643,381.75	2.70
8	600654	中安消	3,779,960	109,014,046.40	2.57
9	600313	农发种业	7,003,445	106,312,295.10	2.51
10	002425	凯撒股份	3,395,457	98,434,298.43	2.32

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	601988	中国银行	624,829,618.50	17.49
2	601166	兴业银行	412,566,300.46	11.55

3	601601	中国太保	371,684,462.65	10.40
4	601388	怡球资源	281,511,281.16	7.88
5	601328	交通银行	273,771,632.54	7.66
6	002231	奥维通信	264,995,828.34	7.42
7	601336	新华保险	254,911,327.73	7.14
8	300253	卫宁软件	248,445,257.26	6.95
9	300224	正海磁材	245,717,068.41	6.88
10	600259	广晟有色	223,411,494.52	6.25
11	300399	京天利	222,365,282.53	6.22
12	601939	建设银行	215,616,102.12	6.04
13	002466	天齐锂业	205,081,126.29	5.74
14	600446	金证股份	199,386,878.02	5.58
15	000975	银泰资源	199,252,951.23	5.58
16	002657	中科金财	196,576,465.24	5.50
17	300450	先导智能	196,346,622.11	5.50
18	002469	三维工程	194,795,319.86	5.45
19	002063	远光软件	193,653,890.70	5.42
20	002439	启明星辰	184,947,825.12	5.18
21	601688	华泰证券	184,754,560.25	5.17
22	000960	锡业股份	184,268,241.45	5.16
23	600549	厦门钨业	182,298,594.37	5.10
24	600118	中国卫星	173,058,524.95	4.84
25	600048	保利地产	172,438,516.07	4.83
26	600326	西藏天路	171,699,941.49	4.81
27	600271	航天信息	171,375,031.72	4.80
28	600687	刚泰控股	164,515,278.44	4.61
29	300465	高伟达	157,548,117.72	4.41
30	601169	北京银行	156,672,388.97	4.39
31	600988	赤峰黄金	155,847,657.49	4.36
32	000911	南宁糖业	155,219,887.41	4.35
33	000758	中色股份	154,454,857.48	4.32
34	000733	振华科技	152,550,925.32	4.27
35	600654	中安消	148,096,459.93	4.15
36	600409	三友化工	147,429,024.49	4.13
37	300228	富瑞特装	144,168,581.51	4.04
38	300457	赢合科技	142,386,983.68	3.99

39	600362	江西铜业	141,397,256.91	3.96
40	601699	潞安环能	141,187,232.26	3.95
41	601006	大秦铁路	140,453,295.25	3.93
42	002714	牧原股份	140,091,266.70	3.92
43	601872	招商轮船	137,024,157.93	3.84
44	002192	*ST 融捷	136,936,054.73	3.83
45	000835	长城动漫	136,742,002.41	3.83
46	600598	北大荒	136,131,138.64	3.81
47	601628	中国人寿	134,740,647.43	3.77
48	600115	东方航空	127,675,947.79	3.57
49	603022	新通联	124,800,304.88	3.49
50	600029	南方航空	124,481,705.69	3.48
51	000783	长江证券	122,758,978.57	3.44
52	300059	东方财富	121,384,813.16	3.40
53	002285	世联行	120,010,055.90	3.36
54	300232	洲明科技	120,008,981.67	3.36
55	601021	春秋航空	119,752,661.41	3.35
56	300369	绿盟科技	117,601,535.34	3.29
57	600674	川投能源	114,899,923.20	3.22
58	600547	山东黄金	113,499,098.62	3.18
59	600773	西藏城投	112,189,583.64	3.14
60	000919	金陵药业	111,357,834.85	3.12
61	300053	欧比特	111,018,718.91	3.11
62	002308	威创股份	110,545,526.80	3.09
63	601857	中国石油	110,509,531.30	3.09
64	300251	光线传媒	106,258,985.30	2.97
65	600015	华夏银行	105,478,204.61	2.95
66	300274	阳光电源	103,937,288.01	2.91
67	002425	凯撒股份	103,817,508.51	2.91
68	600313	农发种业	102,088,349.95	2.86
69	000807	云铝股份	101,631,870.28	2.84
70	600129	太极集团	101,196,361.29	2.83
71	300245	天玑科技	100,871,570.23	2.82
72	600749	西藏旅游	99,774,253.90	2.79
73	002036	汉麻产业	98,929,529.07	2.77
74	000603	盛达矿业	97,040,886.52	2.72

75	002446	盛路通信	95,374,848.01	2.67
76	300188	美亚柏科	95,146,618.97	2.66
77	000060	中金岭南	93,674,963.71	2.62
78	600585	海螺水泥	93,671,742.99	2.62
79	600096	云天化	93,249,233.46	2.61
80	300047	天源迪科	92,184,802.84	2.58
81	600711	盛屯矿业	90,745,264.29	2.54
82	002376	新北洋	90,574,253.64	2.54
83	601398	工商银行	90,455,084.82	2.53
84	300352	北信源	89,698,012.19	2.51
85	300104	乐视网	88,685,962.46	2.48
86	300376	易事特	87,505,559.65	2.45
87	300186	大华农	87,364,161.85	2.45
88	600323	瀚蓝环境	87,230,764.09	2.44
89	600030	中信证券	87,127,069.59	2.44
90	002357	富临运业	86,946,344.31	2.43
91	601390	中国中铁	86,553,352.91	2.42
92	000524	岭南控股	86,339,697.76	2.42
93	002268	卫士通	85,898,900.50	2.40
94	002175	东方网络	84,761,649.05	2.37
95	002477	雏鹰农牧	84,356,247.79	2.36
96	601800	中国交建	83,515,314.69	2.34
97	600583	海油工程	83,113,243.00	2.33
98	002256	彩虹精化	82,287,864.24	2.30
99	000971	高升控股	82,227,813.75	2.30
100	300302	同有科技	82,132,426.07	2.30
101	300133	华策影视	81,727,469.90	2.29
102	002681	奋达科技	81,411,760.67	2.28
103	000559	万向钱潮	81,312,484.50	2.28
104	300380	安硕信息	78,723,719.91	2.20
105	601211	国泰君安	78,333,978.78	2.19
106	002460	赣锋锂业	76,711,062.34	2.15
107	601318	中国平安	76,296,414.49	2.14
108	600497	驰宏锌锗	75,430,096.89	2.11
109	300006	莱美药业	74,200,656.24	2.08
110	300033	同花顺	73,839,643.98	2.07

111	600005	武钢股份	73,543,831.55	2.06
112	000157	中联重科	72,908,416.50	2.04
113	600397	安源煤业	72,873,811.46	2.04
114	002551	尚荣医疗	72,680,590.80	2.03
115	002074	国轩高科	71,567,251.63	2.00

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601988	中国银行	704,330,818.57	19.72
2	601166	兴业银行	442,857,806.97	12.40
3	300224	正海磁材	379,784,892.57	10.63
4	002285	世联行	378,126,711.33	10.58
5	000758	中色股份	373,466,849.45	10.45
6	601601	中国太保	357,472,317.79	10.01
7	601328	交通银行	331,548,042.90	9.28
8	600271	航天信息	291,219,650.73	8.15
9	000975	银泰资源	278,790,833.27	7.80
10	002439	启明星辰	270,948,870.45	7.58
11	600096	云天化	264,742,915.14	7.41
12	300228	富瑞特装	257,142,285.09	7.20
13	601336	新华保险	242,628,694.37	6.79
14	002466	天齐锂业	239,085,720.77	6.69
15	600446	金证股份	233,145,616.33	6.53
16	002231	奥维通信	229,667,641.55	6.43
17	002063	远光软件	226,342,422.62	6.34
18	600687	刚泰控股	225,663,627.87	6.32
19	601688	华泰证券	217,061,861.41	6.08
20	601939	建设银行	214,918,753.55	6.02
21	601021	春秋航空	211,299,377.77	5.91
22	300369	绿盟科技	203,727,756.83	5.70
23	000625	长安汽车	203,168,119.78	5.69
24	002469	三维工程	199,094,262.36	5.57
25	600326	西藏天路	191,745,310.29	5.37
26	300450	先导智能	187,909,305.00	5.26
27	601628	中国人寿	184,106,306.69	5.15

28	600409	三友化工	168,346,374.85	4.71
29	600048	保利地产	167,999,578.03	4.70
30	601872	招商轮船	163,416,101.99	4.57
31	000960	锡业股份	162,405,379.06	4.55
32	600118	中国卫星	158,831,308.82	4.45
33	600598	北大荒	156,687,168.13	4.39
34	300399	京天利	156,106,572.24	4.37
35	600856	中天能源	150,880,899.44	4.22
36	300253	卫宁软件	149,450,622.86	4.18
37	601699	潞安环能	147,195,850.33	4.12
38	002081	金螳螂	146,838,905.46	4.11
39	601169	北京银行	145,884,277.11	4.08
40	600362	江西铜业	145,431,442.68	4.07
41	601388	怡球资源	142,863,326.84	4.00
42	000024	招商地产	140,144,809.45	3.92
43	300465	高伟达	139,489,579.40	3.90
44	600549	厦门钨业	138,288,609.51	3.87
45	600030	中信证券	137,282,246.91	3.84
46	000807	云铝股份	136,331,100.17	3.82
47	600773	西藏城投	135,055,453.67	3.78
48	601006	大秦铁路	127,133,198.63	3.56
49	600115	东方航空	125,033,231.22	3.50
50	300376	易事特	123,354,758.02	3.45
51	002657	中科金财	122,236,336.80	3.42
52	300059	东方财富	120,775,514.14	3.38
53	000783	长江证券	120,472,711.12	3.37
54	600029	南方航空	119,264,424.75	3.34
55	600340	华夏幸福	115,704,871.05	3.24
56	002036	汉麻产业	113,975,142.42	3.19
57	000835	长城动漫	111,705,167.48	3.13
58	000733	振华科技	108,083,026.24	3.03
59	300186	大华农	107,684,906.76	3.01
60	002340	格林美	107,173,988.09	3.00
61	300457	赢合科技	105,698,850.90	2.96
62	300352	北信源	105,133,624.32	2.94
63	002460	赣锋锂业	104,777,274.92	2.93
64	600571	信雅达	103,003,174.31	2.88
65	600547	山东黄金	102,684,139.36	2.87

66	603883	老百姓	100,197,715.60	2.80
67	000603	盛达矿业	99,591,963.15	2.79
68	000559	万向钱潮	98,980,529.88	2.77
69	601788	光大证券	97,823,209.58	2.74
70	300245	天玑科技	97,440,594.79	2.73
71	300418	昆仑万维	96,934,381.21	2.71
72	600749	西藏旅游	95,999,276.83	2.69
73	600015	华夏银行	95,249,431.40	2.67
74	600711	盛屯矿业	94,523,899.02	2.65
75	000939	凯迪生态	94,460,848.01	2.64
76	300251	光线传媒	94,187,356.61	2.64
77	601390	中国中铁	93,604,943.61	2.62
78	000693	华泽钴镍	92,070,444.87	2.58
79	600397	安源煤业	92,066,062.06	2.58
80	601857	中国石油	91,125,884.42	2.55
81	600654	中安消	89,757,143.95	2.51
82	002681	奋达科技	88,999,480.80	2.49
83	002256	彩虹精化	88,793,506.16	2.49
84	300274	阳光电源	88,144,720.53	2.47
85	000963	华东医药	87,985,309.48	2.46
86	000157	中联重科	86,439,982.50	2.42
87	603022	新通联	85,771,499.21	2.40
88	601398	工商银行	85,598,895.80	2.40
89	600674	川投能源	85,098,885.05	2.38
90	000651	格力电器	84,559,541.58	2.37
91	300188	美亚柏科	83,779,248.87	2.35
92	002268	卫士通	83,592,208.59	2.34
93	300104	乐视网	80,842,014.08	2.26
94	000902	新洋丰	80,457,014.70	2.25
95	601211	国泰君安	80,071,519.00	2.24
96	000997	新大陆	79,898,429.04	2.24
97	601600	中国铝业	78,991,346.56	2.21
98	300209	天泽信息	78,456,135.97	2.20
99	300380	安硕信息	77,528,487.80	2.17
100	002357	富临运业	77,359,515.30	2.17
101	002363	隆基机械	76,988,583.23	2.16
102	600217	*ST 秦岭	76,833,232.89	2.15
103	601800	中国交建	76,263,344.70	2.13

104	600323	瀚蓝环境	76,016,774.62	2.13
105	002074	国轩高科	75,937,333.24	2.13
106	600259	广晟有色	75,587,389.98	2.12
107	002573	清新环境	74,285,102.88	2.08
108	600585	海螺水泥	74,023,707.30	2.07
109	000550	江铃汽车	73,076,694.96	2.05
110	000971	高升控股	72,469,246.71	2.03
111	601618	中国中冶	72,409,601.12	2.03
112	600518	康美药业	71,961,921.40	2.01
113	000709	河北钢铁	71,838,253.51	2.01

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	21,135,294,968.41
卖出股票收入（成交）总额	21,816,514,663.43

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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	148,290,000.00	3.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	748,659,000.00	17.66
	其中：政策性金融债	748,659,000.00	17.66
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	896,949,000.00	21.16

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	150211	15 国开 11	1,700,000	170,493,000.00	4.02
2	150411	15 农发 11	1,600,000	160,464,000.00	3.79
3	150206	15 国开 06	1,500,000	150,645,000.00	3.55
4	150301	15 进出 01	900,000	90,081,000.00	2.12
5	110248	11 国开 48	500,000	54,340,000.00	1.28

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 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	7,930,231.39
2	应收证券清算款	33,416,156.20
3	应收股利	-
4	应收利息	19,627,357.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
	合计	60,973,744.77

8.12.4 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。

8.12.5 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	601388	怡球资源	226,288,300.00	5.34	重大事项停牌
2	600654	中安消	109,014,046.40	2.57	重大事项停牌

§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
23,529	127,502.23	1,644,323,426.00	54.81%	1,355,676,574.00	45.19%

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	泰康人寿保险股份有限公司 — 分红—个人分红—019L- FH002 深	358,975,780.00	11.97%
2	伦敦市投资管理有限公司— 客户资金	134,134,410.00	4.47%
3	中国人寿保险 (集团) 公司	107,066,098.00	3.57%
4	中国人寿保险股份有限公司	95,038,049.00	3.17%
5	农银人寿保险股份有限公司 — 传统—普通保险产品	76,152,583.00	2.54%
6	阳光财产保险股份有限公司 — 自有资金	67,442,578.00	2.25%

7	建信人寿保险有限公司—普通	65,938,291.00	2.20%
8	泰康人寿保险股份有限公司—万能一个险万能	65,820,681.00	2.19%
9	泰康人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品—019L-CT001 深	63,453,204.00	2.12%
10	刘占梅	60,000,000.00	2.00%

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

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 元，该审计机构已连续 14 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

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为

期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
中国银河证券股份有限公司	2	17,148,167,003.35	39.93%	12,003,770.53	39.93%	-
国信证券股份有限公司	1	6,476,364,682.43	15.08%	4,533,489.21	15.08%	-
中银国际证券有限责任公司	1	6,147,096,713.63	14.31%	4,302,967.64	14.31%	-
光大证券股份有限公司	1	5,582,873,016.85	13.00%	3,908,038.05	13.00%	-
申万宏源证券有限公司	2	4,862,201,529.08	11.32%	3,403,558.71	11.32%	-
长城证券有限责任公司	1	1,466,479,975.44	3.41%	1,026,535.97	3.41%	-
华泰证券股份有限公司	1	1,267,211,676.56	2.95%	887,048.15	2.95%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

世纪证券有限 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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

注 4：国都证券有限责任公司更名为国都证券股份有限公司。

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
2016 年 3 月 29 日