

丰和价值证券投资基金

2008年年度报告摘要

1 重要提示

基金管理人的董事、监事和高级管理人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 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...

2 基金简介

Table with 2 columns: Item (基金名称, 基金管理人, etc.) and Value (丰和价值证券投资基金, 嘉实基金管理有限公司, etc.)

2.1 基金基本情况

本基金为价值型证券投资基金, 主要投资于依照有关分拆股票价值、成长性指标所界定的价值型股票... 投资策略: 本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略...

2.2 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: Name (姓名), Position (职务), and Contact Info (电话, 邮箱, etc.) for 嘉实基金管理有限公司 and 中国农业银行股份有限公司

2.3 基金业绩表现

Table with 2 columns: Period (2008年, 2007年) and Performance (净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.)

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: 本期已实现收益 -1,482,354,989.52; 本期利润 -2,183,678,595.19; 期末可供分配利润 -992,352,289.19...

3.2 基金净值表现

Table with 2 columns: Period (过去三个月, 过去六个月, etc.) and Performance (净值增长率, 业绩比较基准收益率, etc.)

3.3 基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率\*60%+上证国债指数收益率\*40%... 本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...

3.4 基金费用

Table with 2 columns: Item (管理费, 托管费, etc.) and Amount (0.25%, 0.1%, etc.)

3.5 基金分红

Table with 2 columns: Period (2008年, 2007年) and Dividend (每10份基金份额派发红利, etc.)

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金情况: 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... 4.2 基金管理人履行职责的情况: 报告期内, 本基金管理人严格遵守法律法规...

4.3 基金投资策略

本基金采取自上而下和自下而上相结合的投资策略... 4.4 基金业绩表现: 报告期内, 本基金净值增长率为-34.52%, 业绩比较基准收益率为-27.56%...

4.5 基金风险分析

4.5.1 市场风险: 报告期内, 本基金主要投资于沪深300指数... 4.5.2 信用风险: 报告期内, 本基金未发生信用风险事件...

4.6 基金管理人承诺

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... 4.7 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.8 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.9 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.10 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.11 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.12 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.13 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.14 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.15 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.16 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.17 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.18 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.19 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.20 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.21 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.22 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.23 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.24 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.25 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.26 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.27 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.28 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.29 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.30 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.31 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.32 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.33 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

4.34 基金管理人声明

基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏... 4.35 基金管理人声明: 本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

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

Table with 4 columns: No. (序号), Stock Code (股票代码), Stock Name (股票名称), and Amount (金额/数量). Lists stocks like 招商银行, 华夏银行, etc.

7.4.4.2 关联方报告

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees and other expenses.

7.4.4.2.1 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows custody fees.

7.4.4.2.2 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.3 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.4 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.5 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.6 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.7 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.8 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.9 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.10 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.11 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.12 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.13 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.14 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.15 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.16 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.17 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.18 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.19 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.20 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.21 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.22 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.23 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.24 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.25 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.26 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

7.4.4.2.27 基金托管费

Table with 3 columns: Item (项目), 2008年1月1日至2008年12月31日, and 2007年1月1日至2007年12月31日. Shows management fees.

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: Item (买入股票成本/卖出股票收入) and Amount (13,715,937,724.32 / 16,961,634,110.62)

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: Bond Type (债券品种), Fair Value (公允价值), and Proportion (占基金资产净值比例%). Lists 国债, 央行票据, etc.

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

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 国债, 央行票据, etc.

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

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 央行票据, 企业债, etc.

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

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 权证, etc.

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... 8.9.2 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...

8.9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9 基金持有人户数及持有结构

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 持有人户数, 机构投资者, etc.

9.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名股票投资明细

Table with 4 columns: No. (序号), Stock Code (股票代码), Stock Name (股票名称), and Amount (金额). Lists 中国太平洋保险, UIC, etc.

9.2 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

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 权证, etc.

9.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5 投资组合报告附注

9.5.1 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... 9.5.2 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...

9.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5.5 投资组合报告附注

9.5.5.1 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... 9.5.5.2 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...

9.5.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.5.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5.5.5 投资组合报告附注

9.5.5.5.1 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... 9.5.5.5.2 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...

9.5.5.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.5.5.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5.5.5.5 投资组合报告附注

9.5.5.5.5.1 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... 9.5.5.5.5.2 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...

9.5.5.5.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.5.5.5.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5.5.5.5.5 投资组合报告附注

9.5.5.5.5.5.1 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... 9.5.5.5.5.5.2 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...

9.5.5.5.5.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.5.5.5.5.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注

9.5.5.5.5.5.5.1 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... 9.5.5.5.5.5.5.2 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...

9.5.5.5.5.5.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

9.5.5.5.5.5.5.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

Table with 4 columns: No. (序号), Bond Code (债券代码), Bond Name (债券名称), and Amount (金额). Lists 转债, etc.

9.5.5.5.5.5.5.5 投资组合报告附注

9.5.5.5.5.5.5.5.1 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... 9.5.5.5.5.5.5.5.2 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...

9.5.5.5.5.5.5.5.3 其他资产构成

Table with 2 columns: Item (名称) and Amount (金额). Lists 存出保证金, 应收证券清算款, etc.