泰和证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 23 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	嘉实泰和封闭（上交所上市简称：基金泰和）
基金主代码	500002
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年 4 月 8 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00 份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年 4 月 20 日

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金采用"自上而下"的资产配置与"自下而上"的股票选择相结合的投资方法。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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	尹东
	联系电话	（010）65215588	（010）67595003
	电子邮箱	service@jsfund.cn	Yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-600-8800	（010）67595096
传真		（010）65182266	（010）66275853

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	370,547,415.05	662,276,654.52	-901,456,759.95
本期利润	346,147,504.94	971,226,888.41	-2,318,119,969.87
加权平均基金份额本期利润	0.1731	0.4856	-1.1591
本期加权平均净值利润率	15.20%	50.01%	-80.06%
本期基金份额净值增长率	15.41%	70.59%	-47.21%
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	380,630,718.97	104,083,305.12	-624,148,671.43
期末可供分配基金份额利润	0.1903	0.0520	-0.3121
期末基金资产净值	2,599,225,720.72	2,347,078,216.98	1,375,851,328.57
期末基金份额净值	1.2996	1.1735	0.6879
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	794.90%	675.41%	354.54%

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	8.86%	2.38%				
过去六个月	30.27%	2.11%				
过去一年	15.41%	2.21%				
过去三年	3.93%	3.59%				
过去五年	463.30%	3.48%				
自基金合同生效起至今	794.90%	2.84%				

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

注 1：报告期内，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、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%；（2）本基金持有一家上市公司的股票，不超过基金资产净值10%；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%；（3）遵守中国证监会规定的其他比例限制。

注 2：2010 年 10 月 12 日，本基金管理人发布《关于泰和证券投资基金基金经理变更的公告》，忻怡先生不再担任本基金基金经理，聘请任竞辉先生担任本基金基金经理职务。

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

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	0.4700	94,000,001.20	-	94,000,001.20	2009年度利润分配于2010 年实施
2009	-	-	-	-	
2008	16.4000	3,280,000,000.00	-	3,280,000,000.00	
合计	16.8700	3,374,000,001.20	-	3,374,000,001.20	

§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		
忻怡	本基金基金经理	2009年 1 月 16 日	2010年 10 月 12 日	8年	曾任职于上海银行、渣打银行上海分行，曾任国泰君安证券香港公司研究员、博时基金管理有限公司研究员，2006 年 9 月加盟嘉实基金，曾任嘉实稳健混合基金经理。硕士研究生，CFA，具有基金从业资格，中国国籍。
任竞辉	本基金基金经理	2010年 10 月 12 日	-	5年	曾任申万巴黎基金管理有限公司行业研究员、中国国际金融有限公司行业研究员。2008 年 2 月加盟嘉实基金管理有限公司任高级分析师。MBA，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遵规守信情况的说明

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、《泰和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

2010 年国内国际经济是反危机措施逐步退出、经济运行独立复苏的一年。实业层面，企业订单持续上升，利润持续增长；政策层面，货币政策趋紧，房地产优惠政策取消继而转向严控；资本市场层面，创业板推出，中小板扩容。对国内宏观退出以及欧债危机的担忧造成股票市场整体估值水平持续低迷，然而活跃的中小市值股票最终反映了经济活跃度在上升，消费及新兴产业股票的巨大涨幅预示着新成长周期的开始。

本基金在 2010 年比较好地适应了市场节奏，通过超配食品、医药以及信息技术和机械设备等行业获得了比较好的超额收益。个股选择上，本基金偏重自下而上选择优质成长股并中长期持有，而适当放宽对估值的容忍，该策略在宏观预期不稳定、周期股持续低迷的 2010 年优势明显。

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 1.2996 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2011 年，始于新兴市场的通货膨胀、货币紧缩终将传到至欧盟乃至美国；国内的地产调控以及反通胀措施继续升级，与此相伴的是传统周期行业景气迅速恢复，我们同经济管理当局一样，在密切观察与寻找经济增长和通胀之间的平衡点。若使 CPI 回落至合理水平，经济增长必然付出一定代价，增长阶段性回落不可避免，但同时我们也意识到，调控之下的增长与复苏仍然是主旋律。股票市场上，成长股与价值股之间的估值差异空前巨大，风格的转换不可一蹴而就，本基金将逐步加大周期成长类股票配置，如机械设备、通信设备、交运设备以及其他专有设备行业。这些行业业绩虽然历史上有较大波动，但会更强烈地受益于国际经济复苏，并在新的经济周期中显著扩大收入规模和国际竞争地位，业绩增长与估值提升空间都比较可观。总体上，本基金会保持对成长股的主要配置，根据复苏和宏观调控的节奏，择机增加优质周期成长类股票的配置，以充分分享新的经济上升周期。

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历。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）报告期内本基金实施了 2009 年度基金利润分配，具体参见本报告"7.4.11 利润分配情况"。

（2）根据本报告 3.1.1 "本期已实现收益"为 370,547,415.05 元，3.1.2 "期末可供分配利润"为 380,630,718.97 元，期末可供分配基金份额利润为 0.1903 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 0.172 元/份，符合本基金基金合同［十七（三）2、基金收益分配采取现金方式，每年至少分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成］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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为：94,000,001.20 元。

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

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

泰和证券投资基金 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 20634 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：泰和证券投资基金

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	97,061,207.33	95,447,178.05
结算备付金		7,988,737.87	3,311,337.38
存出保证金		2,643,613.28	2,448,984.09
交易性金融资产	7.4.7.2	2,532,797,233.34	2,311,788,785.88
其中：股票投资		1,976,932,564.14	1,818,451,170.78
基金投资		-	-
债券投资		555,864,669.20	493,337,615.10
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	11,588,080.28	3,135,549.61
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		2,652,078,872.10	2,418,488,215.76
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		40,219,357.66	64,210,093.53
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,313,739.06	2,963,474.82
应付托管费		552,289.86	493,912.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,448,935.34	2,423,688.50
应交税费		968,829.46	968,829.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	350,000.00	350,000.00
负债合计		52,853,151.38	71,409,998.78
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	599,225,720.72	347,078,216.98
所有者权益合计		2,599,225,720.72	2,347,078,216.98
负债和所有者权益总计		2,652,078,872.10	2,418,488,215.76

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2996 元，基金份额总额 2,000,000,000.00 份

7.2 利润表

会计主体：泰和证券投资基金

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		410,611,124.81	1,030,161,910.18
1.利息收入		12,141,617.72	11,442,137.58
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,081,006.69	388,530.57
债券利息收入		11,060,611.03	11,053,607.01
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		422,800,757.19	709,768,975.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	410,162,914.87	705,464,633.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-237,949.33	-3,940,298.67
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	243,210.77	354,436.24
股利收益	7.4.7.16	12,632,580.88	7,890,204.50
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	-24,399,910.11	308,950,233.89
4. 汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	68,660.01	562.99
减：二、费用		64,463,619.87	58,935,021.77
1.管理人报酬		34,196,837.59	28,951,874.16
2.托管费		5,699,472.97	4,825,312.37
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	23,771,851.04	24,461,250.03
5.利息支出		5,471.12	185,847.87
其中：卖出回购金融资产支出		5,471.12	185,847.87
6.其他费用	7.4.7.20	789,987.15	510,737.34
三、利润总额		346,147,504.94	971,226,888.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润		346,147,504.94	971,226,888.41

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰和证券投资基金

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）	2,000,000,000.00	347,078,216.98	2,347,078,216.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	346,147,504.94	346,147,504.94
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	-	-94,000,001.20	-94,000,001.20
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	599,225,720.72	2,599,225,720.72
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）	2,000,000,000.00	-624,148,671.43	1,375,851,328.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	971,226,888.41	971,226,888.41
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）	2,000,000,000.00	347,078,216.98	2,347,078,216.98

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	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司（"中国建设银行"）	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
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

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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	1,459,553,697.63	9.36	323,217,015.54	2.01

7.4.4.1.2 债券交易

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债券交易。

7.4.4.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.4.1.4 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例（%）	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	1,740,506.12	100.00	-	-

注：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。

7.4.4.1.5 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	1,240,621.63	9.55	795,350.53	10.68
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	274,735.63	2.05	62,437.49	2.58

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。

注 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。

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 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
当期发生的基金应支付的管理费	34,196,837.59	28,951,874.16
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 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
当期发生的基金应支付的托管费	5,699,472.97	4,825,312.37

注：支付基金托管人中国建设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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
	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
中国建设银行	9,990,894.07	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2009年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日					
	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
中国建设银行	39,856,284.22	9,988,222.19	-	-	248,430,000.00	28,591.47

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 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
基金合同生效日（1999 年 4 月 8 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	15,858,600.00	15,858,600.00
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	15,858,600.00	15,858,600.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.79%	0.79%

注：基金管理人作为本基金发起人，于本基金 1999 年 4 月 2 日发行日认购本基金份额 10,000,000 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 5,858,600 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	6,250,000.00	0.31	6,250,000.00	0.31
立信投资有限责任公司	6,250,000.00	0.31	6,250,000.00	0.31
广发证券股份有限公司	6,250,000.00	0.31	6,250,000.00	0.31

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）、广发证券股份有限公司作为本基金发起人，于本基金 1999 年 4 月 2 日发行日分别认购本基金份额 12,500,000 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。截止 2010 年 12 月 31 日，中诚信托有限责任公司、广发证券股份有限公司分别持有本基金 6,250,000 份。

（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 6,250,000 份转让给立信投资有限责任公司，于 2005 年 8 月 23 日在中国证券登记结算有限责任公司上海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
中国建设银行	97,061,207.33	996,134.46	95,447,178.05	297,115.44

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本报告期及上年度可比期间，本基金未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
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	-
002534	杭锅股份	2010年 12 月 31 日	2011年 1 月 10 日	未上市	26.00	26.00	1,000	26,000.00	26,000.00	-
601118	海南橡胶	2010年 12 月 30 日	2011年 1 月 7 日	未上市	5.99	5.99	4,000	23,960.00	23,960.00	-
300158	振东制药	2010年 12 月 29 日	2011年 1 月 7 日	未上市	38.80	38.80	500	19,400.00	19,400.00	-
002535	林州重机	2010年 12 月 31 日	2011年 1 月 11 日	未上市	25.00	25.00	500	12,500.00	12,500.00	-

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	3,539,975	58,608,994.33	69,772,907.25	-

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

期末（2010 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

期末（2010 年 12 月 31 日）本基金无交易所债券正回购余额。

§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	1,976,932,564.14	74.54
	其中：股票	1,976,932,564.14	74.54
2	固定收益投资	555,864,669.20	20.96
	其中：债券	555,864,669.20	20.96
	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	105,049,945.20	3.96
6	其他各项资产	14,231,693.56	0.54
	合计	2,652,078,872.10	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	51,579,450.12	1.98
B	采掘业	34,203,280.44	1.32
C	制造业	1,570,636,770.87	60.43
C0	食品、饮料	124,463,162.51	4.79
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	610,530,513.45	23.49
C6	金属、非金属	222,903,231.50	8.58
C7	机械、设备、仪表	428,664,172.58	16.49
C8	医药、生物制品	184,075,690.83	7.08
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	42,380.00	0.00
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	198,252,259.73	7.63
H	批发和零售贸易	39,539,324.00	1.52
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	79,533,863.70	3.06
K	社会服务业	3,145,235.28	0.12
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,976,932,564.14	76.06

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	002106	莱宝高科	2,385,952	158,069,320.00	6.08
2	600031	三一重工	7,299,971	157,898,372.73	6.07
3	002241	歌尔声学	2,849,925	155,805,399.75	5.99
4	002236	大华股份	1,305,297	109,488,312.36	4.21
5	002055	得润电子	3,793,783	104,063,467.69	4.00
6	000858	五 粮 液	3,000,000	103,890,000.00	4.00
7	000651	格力电器	5,699,914	103,339,440.82	3.98
8	002161	远 望 谷	2,468,478	86,174,566.98	3.32
9	000423	东阿阿胶	1,619,897	82,776,736.70	3.18
10	600518	康美药业	3,539,975	69,772,907.25	2.68

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	000002	万 科 A	349,074,445.98	14.87
2	600031	三一重工	282,632,842.32	12.04
3	002106	莱宝高科	206,742,221.60	8.81
4	000858	五 粮 液	197,161,783.14	8.40
5	600348	国阳新能	191,014,244.14	8.14
6	600362	江西铜业	180,539,435.30	7.69
7	002236	大华股份	156,431,089.47	6.66
8	600111	包钢稀土	148,840,682.53	6.34
9	000651	格力电器	145,872,055.62	6.22
10	000983	西山煤电	139,682,522.51	5.95
11	601818	光大银行	130,070,367.69	5.54
12	002241	歌尔声学	118,697,901.99	5.06
13	600188	兖州煤业	112,072,803.47	4.77
14	000063	中兴通讯	106,335,784.84	4.53
15	002230	科大讯飞	104,470,782.15	4.45
16	600085	同仁堂	99,015,235.49	4.22
17	600036	招商银行	98,853,798.60	4.21
18	600104	上海汽车	98,436,100.78	4.19
19	000528	柳 工	96,850,390.31	4.13
20	600518	康美药业	95,032,920.36	4.05
21	600038	哈飞股份	94,055,239.82	4.01
22	600309	烟台万华	92,511,099.43	3.94
23	000012	南 玻 A	87,950,078.35	3.75
24	000060	中金岭南	87,270,218.03	3.72
25	600058	五矿发展	79,082,747.42	3.37
26	601601	中国太保	77,032,898.53	3.28
27	600519	贵州茅台	75,587,594.28	3.22
28	002161	远 望 谷	75,161,490.49	3.20
29	600859	王府井	73,640,881.99	3.14
30	002055	得润电子	72,305,653.76	3.08
31	601288	农业银行	71,850,000.00	3.06
32	002155	辰州矿业	71,480,516.11	3.05
33	000537	广宇发展	70,973,792.39	3.02
34	000423	东阿阿胶	70,578,244.37	3.01
35	000538	云南白药	70,337,693.02	3.00
36	600030	中信证券	66,004,885.50	2.81
37	600546	山煤国际	64,336,478.07	2.74
38	600742	一汽富维	63,917,965.68	2.72
39	600888	新疆众和	63,550,561.30	2.71
40	002415	海康威视	63,513,353.54	2.71
41	600823	世茂股份	62,292,933.12	2.65
42	000157	中联重科	62,094,193.14	2.65
43	002073	软控股份	60,917,472.89	2.60
44	600048	保利地产	59,731,523.68	2.54
45	002011	盾安环境	56,697,574.97	2.42
46	600115	东方航空	54,716,586.70	2.33
47	600432	吉恩镍业	51,500,138.61	2.19
48	600713	南京医药	50,961,197.73	2.17
49	600497	驰宏锌锗	50,731,854.83	2.16
50	002123	荣信股份	48,365,131.24	2.06
51	601101	昊华能源	48,118,165.25	2.05
52	002419	天虹商场	47,747,595.16	2.03
53	601318	中国平安	47,300,848.40	2.02
54	600276	恒瑞医药	47,285,461.69	2.01

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	000002	万 科 A	315,043,081.39	13.42
2	600031	三一重工	218,130,533.10	9.29
3	600348	国阳新能	185,294,433.56	7.89
4	600111	包钢稀土	176,503,345.47	7.52
5	600823	世茂股份	163,174,360.61	6.95
6	000983	西山煤电	155,830,860.19	6.64
7	600362	江西铜业	146,229,461.88	6.23
8	600036	招商银行	142,750,410.98	6.08
9	000858	五 粮 液	140,307,158.89	5.98
10	000651	格力电器	137,172,413.11	5.84
11	601818	光大银行	128,325,688.60	5.47
12	600104	上海汽车	118,690,615.38	5.06
13	600600	青岛啤酒	118,280,417.37	5.04
14	000581	威孚高科	117,049,803.86	4.99
15	600188	兖州煤业	110,702,268.58	4.72
16	600276	恒瑞医药	110,659,235.63	4.71
17	002106	莱宝高科	108,647,410.75	4.63
18	000528	柳 工	108,291,030.12	4.61
19	601111	中国国航	102,826,503.84	4.38
20	000063	中兴通讯	100,939,348.02	4.30
21	600085	同仁堂	99,702,236.27	4.25
22	600859	王府井	96,889,028.77	4.13
23	600315	上海家化	96,832,250.43	4.13
24	600309	烟台万华	91,224,465.62	3.89
25	601601	中国太保	90,299,213.75	3.85
26	600809	山西汾酒	87,965,966.03	3.75
27	601318	中国平安	83,047,247.52	3.54
28	600066	宇通客车	78,560,562.04	3.35
29	600519	贵州茅台	76,564,073.23	3.26
30	600058	五矿发展	74,570,787.16	3.18
31	600546	山煤国际	74,398,334.03	3.17
32	600038	哈飞股份	71,022,832.36	3.03
33	000157	中联重科	69,531,208.46	2.96
34	002155	辰州矿业	69,243,656.46	2.95
35	600742	一汽富维	68,012,052.41	2.90
36	601288	农业银行	67,596,501.68	2.88
37	000538	云南白药	67,340,759.01	2.87
38	000400	许继电气	66,994,476.99	2.85
39	600418	江淮汽车	65,718,125.07	2.80
40	600888	新疆众和	64,275,083.05	2.74
41	600157	永泰能源	63,360,519.84	2.70
42	000401	冀东水泥	62,908,624.91	2.68
43	000537	广宇发展	62,143,029.64	2.65
44	600030	中信证券	61,964,647.26	2.64
45	600887	伊利股份	61,154,161.23	2.61
46	002011	盾安环境	60,103,414.07	2.56
47	600361	华联综超	58,119,259.65	2.48
48	000860	顺鑫农业	57,187,761.44	2.44
49	600432	吉恩镍业	56,346,022.31	2.40
50	002236	大华股份	56,237,521.58	2.40
51	000012	南 玻 A	54,198,552.90	2.31
52	000911	南宁糖业	53,301,264.33	2.27
53	600713	南京医药	53,011,413.23	2.26
54	600115	东方航空	52,813,633.03	2.25
55	002230	科大讯飞	49,655,086.40	2.12
56	600729	重庆百货	49,098,385.24	2.09
57	000550	江铃汽车	48,763,974.53	2.08
58	000060	中金岭南	47,394,733.32	2.02
59	600354	敦煌种业	47,099,521.08	2.01
60	600406	国电南瑞	47,077,332.40	2.01
61	002419	天虹商场	46,942,986.79	2.00

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	7,692,223,807.98
卖出股票收入（成交）总额	7,925,294,575.98

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	49,358,700.00	1.90
2	央行票据	464,509,000.00	17.87
3	金融债券	39,878,000.00	1.53
	其中：政策性金融债	39,878,000.00	1.53
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	2,118,969.20	0.08
7	其他	-	-
	合计	555,864,669.20	21.39

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	1001019	10央行票据 19	1,100,000	107,613,000.00	4.14
2	1001021	10央行票据 21	900,000	88,029,000.00	3.39
3	0801035	08央行票据 35	800,000	80,232,000.00	3.09
4	1001037	10央行票据 37	700,000	68,663,000.00	2.64
5	0801044	08央行票据 44	600,000	60,216,000.00	2.32

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	2,643,613.28
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,588,080.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	14,231,693.56

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110007	博汇转债	1,066,524.80	0.04

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	69,772,907.25	2.68	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
58,001	34,482.16	1,064,010,274.00	53.20%	935,989,726.00	46.80%

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	199,598,431.00	9.98%
2	中国人寿保险（集团）公司	173,621,102.00	8.68%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	85,213,213.00	4.26%
4	阳光人寿保险股份有限公司-分红保险产品	64,363,899.00	3.22%
5	阳光财产保险股份有限公司-自有资金	53,979,141.00	2.70%
6	宝钢集团有限公司	45,440,000.00	2.27%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司-万能-个人万能	39,499,914.00	1.97%
8	国泰君安-招行-国泰君安君得益优选基金集合资产管理计划	30,954,993.00	1.55%
9	UBS AG	27,145,032.00	1.36%
10	太平人寿保险有限公司	25,673,920.00	1.28%

注：上表数据由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供。

§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

2010 年 10 月 12 日，本基金管理人发布《关于泰和证券投资基金基金经理变更的公告》，忻怡先生不再担任本基金基金经理，聘请任竞辉先生担任本基金基金经理职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2011 年 2 月 9 日，本基金托管人发布公告经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可［2011］115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

2011 年 1 月 31 日，本基金托管人发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

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 12 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	
中信建投证券有限责任公司	2	5,353,017,027.51	34.31%	4,413,582.03	33.98%	-
华西证券有限责任公司	1	4,614,618,550.52	29.58%	3,922,403.98	30.20%	-
招商证券股份有限公司	1	3,046,102,620.80	19.52%	2,474,981.17	19.05%	-
国都证券有限责任公司	1	1,459,553,697.63	9.36%	1,240,621.63	9.55%	-
国元证券股份有限公司	1	541,025,225.55	3.47%	439,587.71	3.38%	-
中信证券股份有限公司	1	346,091,104.08	2.22%	294,173.00	2.26%	-
中国建银投资证券有限责任公司	1	232,309,752.38	1.49%	197,462.41	1.52%	-
海通证券股份有限公司	1	8,333,781.74	0.05%	7,084.03	0.05%	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	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。

注 3：报告期内，本基金退租以下交易单元：金元证券股份有限公司深圳交易单元 1 个。

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		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券有限责任公司	21,550,939.70	94.15%	-	-
华西证券有限责任公司	1,340,178.80	5.85%	-	-
国都证券有限责任公司	-	-	1,740,506.12	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