嘉实策略增长混合型证券投资基金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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	嘉实策略混合
基金主代码	070011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月12日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,392,605,613.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过有效的策略组合,为基金持有人创造较高的中长期资产增值
投资策略	从宏观面、政策面、资金面和基本面进行综合分析,在具备足够多预期收益率良好的投资标的时,优先考虑股票类资产配置,剩余资产配置于债券类和现金类等大类资产。股票投资采用自上而下和自下而上相结合的方法,主策略为积极成长策略,辅之以廉价证券策略和周期反转策略等;债券投资采取"自上而下"策略,以久期管理策略为主,辅以收益率曲线策略等。
业绩比较基准	沪深300指数×75%+上证国债指数×25%
风险收益特征	较高风险,较高收益。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	赵会军
	联系电话	010)65215588	010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		010)65182266	010)66105798

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	1,039,186,941.84	1,547,694,890.31	-1,065,804,359.22
本期利润	2,102,535,205.14	4,342,229,299.59	-7,987,244,257.79
加权平均基金份额本期利润	0.2524	0.5485	-0.8660
本期加权平均净值利润率	20.24%	53.74%	-79.31%
本期基金份额净值增长率	19.91%	72.69%	-51.32%
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	3,982,268,315.90	1,913,179,926.51	-2,299,433,851.33
期末可供分配基金份额利润	0.4240	0.2714	-0.2635
期末基金资产净值	13,374,873,929.54	8,963,592,648.49	6,426,183,520.97
期末基金份额净值	1.424	1.271	0.736
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	77.82%	48.30%	-14.12%

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	5.09%	1.64%	4.99%	1.33%	0.10%	0.31%
过去六个月	33.33%	1.44%	16.59%	1.16%	16.74%	0.28%
过去一年	19.91%	1.42%	-8.29%	1.19%	28.20%	0.23%
过去三年	0.81%	1.79%	-28.13%	1.74%	28.94%	0.05%
自基金合同生效起至今	77.82%	1.75%	65.09%	1.74%	12.73%	0.01%

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数×75%+上证国债指数×25%,采用该业绩比较基准主要基于:①沪深300指数和上证国债指数编制合理、透明、运用广泛,具有较强的代表性和权威性;②作为混合型基金,选择该业绩比较基准能够真实反映本基金长期动态的资产配置目标和风险收益特征。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark 0=1000

Return t=75%×(沪深300指数t/沪深300指数t-1)-1)+25%×(上证国债指数t/(上证国债指数t-1)-1)

Benchmark1=(1+Return t)×Benchmark t-1

其中t=1,2,3,。

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:按相关法规规定,本基金自基金合同生效日起6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第十一部分(二、投资范围和六、(二)投资组合限制)的有关约定。

注2:2010年11月25日,本基金管理人发布《关于增聘嘉实策略混合基金经理的公告》,增聘邵秋涛先生任本基金基金经理,与现任基金经理邵健先生共同管理本基金。

3.2.3 自基金合同生效以来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

注:本基金基金合同生效日为2006年12月12日,2006年度的相关数据根据其实际存续期(2006年12月12日-2006年12月31日)计算。

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	0.8400	211,265,438.62	372,028,098.07	583,293,536.69	
2009	-	-	-	-	
2008	1.9000	662,152,624.86	1,011,206,868.58	1,673,359,493.44	
合计	2.7400	873,418,063.48	1,383,234,966.65	2,256,653,030.13	

§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
邵健	本基金基金经理、嘉实增长混合基金经理,公司总经理助理。	2006年12月12日	-	12年	曾任国泰君安证券研究所研究员、行业投资策略组组长,行业公司部副经理、从事行业研究,行业比较研究及资产配置等工作。2003年7月加入嘉实基金管理有限公司投资部工作。经济学硕士,具有基金从业资格,中国国籍。
邵秋涛	本基金基金经理	2010年11月25日	-	12年	曾任职于成都证券、大鹏证券、国信证券,从事行业研究工作,先后担任研究员、高级研究员;2006年12月加盟嘉实基金管理有限公司,历任公司高级研究员、投资经理,金融硕士,具有基金从业资格,澳大利亚籍。

注:(1)邵健的任职日期是指本基金合同生效之日,邵秋涛的任职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

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、《嘉实策略增长混合型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年作为中国经济最复杂的一年,也在A股市场上投射下了多变的轨迹。2010年上半年,经济政策从极度宽松向常规状态转变,意味着短期的经济增速和流动性受限;10年4月的房地产国十条政策,以及欧债危机的叠加干扰,让A股市场在2010年的上半场大跌近30%。进入下半年,在业绩增长与经济关联性较小的消费、新兴成长类板块的驱动下,大盘开始反弹;并在10月份全球流动性和大宗商品大涨的刺激下迸发出暴涨行情;随即由于国内通胀上升和紧缩力度加大而再次回调,沪深300指数下跌12.5%结束,名列全球资本市场榜尾。

本基金在2010年初的2009年报中曾作出判断,认为全球货币环境会因各国政府陆续退出刺激政策而收紧,但结构性机会的把握将显得尤为重要,代表中国经济将来发展方向的消费、新经济、新能源等产业将迎来较好发展机遇。在2010年的宏观经济和资本市场走势上得到基本确认。

本基金在2010全年坚持以业绩增长确定、符合未来中国经济转型和发展方向的消费、成长、新经济板块为主要投资领域,精心选择并长期持有估值合理、公司治理良好的优质企业,并适量参与战略新兴领域的主题投资、矫枉过正的稀缺资源投资。在2010年本基金业绩卓越超跑赢业绩比较基准,为投资人获得了丰厚回报。

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1.424元;本报告期基金份额净值增长率为19.91%,业绩比较基准收益率为-8.29%,本报告期基金份额净值增长率超越业绩比较基准收益率28.20个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

与2010年相比,2011年的复杂性并未降低。全球经济政策从2009年的一致宽松,到2010年的分歧,再到目前的截然相反,为全球经济带来了诸多不确定性。当发展中国家被迫持续紧缩,以应对愈演愈烈的通胀压力时,这不可避免的会减速经济;而美国鉴于居高不下的失业率、以及较低的核心通胀,将坚定不移的推行持续宽松政策,虽然能助推美国经济复苏,但也部分抵消了发展中国家对抗通胀的紧缩政策效果。

中国经济的复杂性也在持续。由于超发货币的滞后影响、劳动力成本的长期上升趋势、以及农产品价格的短期干扰,通胀压力短期继续存在;而居高不下的房价因为涉及到社会稳定,已经将政策空间逼到极限,极度严厉的房地产调控政策如果全国范围内长期严格执行,不可避免的对经济增长有影响。持续上升的劳动力成本、利率、土地房屋租金等,也将给企业利润增长带来巨大挑战。

但是我们也要看到,目前的困境其实还是旧增长模式的问题延续,即依靠高资源耗费、低劳动力成本、环境污染、低附加值出口的传统经济增长模式已经走到了尽头。虽然转型的阵痛令人不快,但十二五规划如能认真落实和长期坚持,中国经济迎来新一轮升级和增长并非假想。虽然年初的紧缩力度较大,影响短期经济增速预期;但这必然有利于消除通胀不受控风险。当通胀稳定在合理水平后,中国经济转高的内生增长动力,依然会为A股市场带来投资机会。

本基金在2011年将继续沿着中国经济的转型与升级主线,在受益于扩大内需的大消费板块、产业升级必需的高端装备制造板块、促进中国经济可持续发展的战略新兴产业、以及与经济复苏和流动性相关的资源品板块,去把握结构性投资机会。我们将以积极成长、廉价证券、周期反转、事件驱动等多策略,积极主动寻找投资机会,力争为投资人获取持续优良回报。

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、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)本报告期内实施了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3.1.2"期末可供分配基金份额利润"为0.4240元,及本基金基金合同十五(三)"在符合有关基金分红条件的情况下,本基金每年收益分配次数最多为4次,全年分配比例不得低于年度可分配收益的30%。"本报告期每10份应分配的金额为1.272元以上。

(3)2011年1月18日,本基金管理人发布《嘉实策略增长混合型证券投资基金2010年年度收益分配公告》,收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利1.28元,权益登记日、除息日为2011年1月21日,红利发放日为2010年1月24日,已分配利润1,160,420,183.52元,符合基金合同的约定。

§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

2010年,本基金托管人在对嘉实策略增长混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

2010年,嘉实策略增长混合型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实策略增长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,嘉实策略增长混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为583,293,536.69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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实策略增长混合型证券投资基金2010年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实策略增长混合型证券投资基金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20642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:嘉实策略增长混合型证券投资基金

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	636,189,268.67	119,885,496.99
结算备付金		14,399,959.35	15,850,983.55
存出保证金		3,435,111.28	4,710,765.98
交易性金融资产	7.4.7.2	12,555,237,030.66	8,793,643,474.00
其中:股票投资		12,160,380,220.06	8,390,220,593.00
基金投资		-	-
债券投资		394,856,810.60	403,422,881.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	18,332,633.42
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		225,520,656.53	124,067,107.31
应收利息	7.4.7.5	7,245,518.34	1,409,161.95
应收股利		-	-
应收申购款		22,147,509.47	1,369,023.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		13,464,175,054.30	9,079,268,647.09
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		52,451,550.97	69,033,050.19
应付赎回款		7,887,913.59	23,462,556.22
应付管理人报酬		17,222,667.92	11,285,288.39
应付托管费		2,870,444.64	1,880,881.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,724,520.10	7,897,022.14
应交税费		215,205.30	210,467.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,928,822.24	1,906,732.54
负债合计		89,301,124.76	115,675,998.60
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	9,392,605,613.64	7,050,412,721.98
未分配利润	7.4.7.10	3,982,268,315.90	1,913,179,926.51
所有者权益合计		13,374,873,929.54	8,963,592,648.49
负债和所有者权益总计		13,464,175,054.30	9,079,268,647.09

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.424元,基金份额总额9,392,605,613.64份

7.2 利润表

会计主体:嘉实策略增长混合型证券投资基金

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		2,322,068.897.01	4,543,362.413.92
1.利息收入		13,012,364.02	13,717,496.31
其中:存款利息收入	7.4.7.11	5,191,903.76	2,762,616.55
债券利息收入		7,820,460.26	10,954,879.76
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		1,241,496,813.77	1,734,301,260.32
其中:股票投资收益	7.4.7.12	1,177,871,544.76	1,656,212,064.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	23,280,004.59	23,814,088.41
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-14,103,982.78	237,273.78
股利收益	7.4.7.16	54,449,247.20	54,037,833.84
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	1,063,348,263.30	2,794,534,409.28
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	4,211,455.92	809,248.01
减:二、费用		219,533,691.87	201,133,114.33
1.管理人报酬		155,529,218.39	120,398,616.92
2.托管费		25,921,536.34	20,066,436.15
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	37,062,803.85	59,826,391.85
5.利息支出		518,220.17	336,909.56
其中:卖出回购金融资产支出		518,220.17	336,909.56
6.其他费用	7.4.7.20	501,913.12	504,759.85
三、利润总额		2,102,535,205.14	4,342,229,299.59
减:所得税费用		-	-
四、净利润		2,102,535,205.14	4,342,229,299.59

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实策略增长混合型证券投资基金

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)	7,050,412,721.98	1,913,179,926.51	8,963,592,648.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,102,535,205.14	2,102,535,205.14
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,342,192,891.66	549,846,720.94	2,892,039,612.60
其中:1.基金申购款	5,973,518,463.23	1,636,055,862.86	7,609,574,326.09
2.基金赎回款	-3,631,325,571.57	-1,086,209,141.92	-4,717,534,713.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-583,293,536.69	-583,293,536.69
五、期末所有者权益(基金净值)	9,392,605,613.64	3,982,268,315.90	13,374,873,929.54
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)	8,725,617,372.30	-2,299,433,851.33	6,426,183,520.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,342,229,299.59	4,342,229,299.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,675,204,650.32	-129,615,521.75	-1,804,820,172.07
其中:1.基金申购款	942,794,562.83	112,465,436.15	1,055,259,998.98
2.基金赎回款	-2,617,999,213.15	-242,080,957.90	-2,860,080,171.05
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)	7,050,412,721.98	1,913,179,926.51	8,963,592,648.49

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(中国工商银行)	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	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、基金代销机构

注:下述关联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	4,541,217,113.35	18.25	12,148,613,496.50	31.20

7.4.4.1.2 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	78,742,511.90	22.46%	-	-

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

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。

7.4.4.1.5 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	3,860,006.59	18.54	717,043.70	10.67
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	10,326,273.35	31.65	3,391,522.18	42.96

注: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、经手费后的净额列示。债券交易不计佣金。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	155,529,218.39	120,398,616.92
其中:支付给销售机构的客户维护费	20,610,445.77	19,475,503.63

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。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	25,921,536.34	20,066,436.15

注:支付基金托管人中国工商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	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
中国工商银行	-	-	-	-	348,586,000.00	43,105.56

注:报告期内,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

报告期内,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

报告期末(2010年12月31日),其他关联方未持有本基金。

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
中国工商银行	636,189,268.67	4,948,383.10	119,885,496.99	2,558,626.50

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,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

报告期内,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
002241	歌尔声学	2010.10.20	2011.10.21	非公开发行流通受限	33.01	37.68	1,300,000	42,913,000.00	48,984,000.00	-
300125	易世达	2010.9.27	2011.1.13	IPO网下锁定三个月	55.00	83.49	37,672	2,071,960.00	3,145,235.28	-
300126	锐奇股份	2010.9.27	2011.1.13	IPO网下锁定三个月	34.00	38.68	89,893	3,056,362.00	3,477,061.24	-
300154	瑞凌股份	2010.12.22	2011.3.29	IPO网下锁定三个月	38.50	40.65	700,000	26,950,000.00	28,455,000.00	-
600406	国电南瑞	2010.10.25	2011.10.21	非公开发行流通受限	52.00	56.13	343,330	17,853,160.00	19,271,112.90	-
600998	九州通	2010.10.27	2011.2.9	IPO网下锁定三个月	13.00	14.55	258,199	3,356,587.00	3,756,795.45	-
601126	四方股份	2010.12.28	2011.3.31	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
300113	顺网科技	2010.12.13	筹划重大资产重组	69.40	2011.1.31	75.98	1,058,177	82,829,585.82	73,437,483.80	-
600315	上海家化	2010.12.6	筹划国资改革事宜	37.13	未知	未知	6,668,358	136,434,413.32	247,596,132.54	-
600518	康美药业	2010.12.28.	配股申购期间停牌	19.71	2011.1.6	17.29	20,531,497	272,583,991.42	404,675,805.87	-

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,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

报告期末,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	12,160,380,220.06	90.32
	其中:股票	12,160,380,220.06	90.32
2	固定收益投资	394,856,810.60	2.93
	其中:债券	394,856,810.60	2.93
	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	650,589,228.02	4.83
6	其他各项资产	258,348,795.62	1.92
7	合计	13,464,175,054.30	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	58,241,622.43	0.44
B	采掘业	101,288,975.58	0.76
C	制造业	8,079,303,770.74	60.41
C0	食品、饮料	1,950,123,970.14	14.58
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	121,701,426.52	0.91
C4	石油、化学、塑胶、塑料	302,638,603.27	2.26
C5	电子	225,526,685.38	1.69
C6	金属、非金属	1,011,737,630.37	7.56
C7	机械、设备、仪表	1,094,470,690.58	8.18
C8	医药、生物制品	3,339,625,260.26	24.97
C99	其他制造业	33,479,504.22	0.25
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-