嘉实成长收益证券投资基金 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	嘉实成长收益混合
基金主代码	070001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月5日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,665,750,065.24 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金定位于成长收益复合型基金,在获取稳定的现金收益的基础上,积极谋求资本增值机会。
投资策略	本基金通过精选收益型股票以及对债券类资产的稳健投资来实现"稳定收益"的目标;同时通过实施"行业优选、积极轮换"的策略,实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	上证A股指数
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金,长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的贝塔值不超过0.75。在此前提下,本基金通过合理配置在成长型资产类、收益型资产类和现金等大类资产之间的比例,努力实现股票市场上涨期间基金资产净值涨幅不低于上证A股指数涨幅的65%,股票市场下跌期间基金资产净值下跌幅度不超过上证A股指数跌幅的55%。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	唐州徽
	联系电话	(010)65215588	(010)66594855
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65182266	(010)66594942

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	234,350,056.37	1,023,615,034.74	-1,640,899,876.20
本期利润	77,030,147.20	1,237,800,312.59	-2,274,822,448.75
加权平均基金份额本期利润	0.0214	0.3046	-0.5007
本期加权平均净值利润率	2.37%	38.02%	-59.94%
本期基金份额净值增长率	1.29%	45.99%	-41.23%
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	1,264,576,368.66	1,235,920,572.93	250,511,119.22
期末可供分配基金份额利润	0.3450	0.3528	0.0551
期末基金资产净值	3,435,457,512.06	3,310,589,784.32	2,945,308,927.23
期末基金份额净值	0.9372	0.9450	0.6473
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	372.84%	366.80%	219.75%

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	7.98%	1.28%	5.69%	1.56%	2.29%	-0.28%
过去六个月	13.57%	1.06%	16.95%	1.37%	-3.38%	-0.31%
过去一年	1.29%	1.10%	-14.46%	1.42%	15.75%	-0.32%
过去三年	-13.08%	1.43%	-46.75%	2.16%	33.67%	-0.73%
过去五年	286.45%	1.40%	140.82%	2.04%	145.63%	-0.64%
自基金合同生效起至今	372.84%	1.24%	83.73%	1.79%	289.11%	-0.55%

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:按基金合同规定,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十八条(二)投资范围和(六)投资组合比例限制)的约定:

(1)投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%;(2)持有一家公司的股票,不得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,不得超过该证券的10%;(4)投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;(5)本基金的股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;(6)法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的,从其规定。

注2:2010年11月5日,本基金管理人发布《关于嘉实成长收益证券投资基金基金经理变更的公告》,徐晨光先生不再担任本基金基金经理,聘请刘天君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	0.2000	23,916,531.92	45,297,685.40	69,214,217.32	2009年度应分利润于2010年实施
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
合计	0.2000	23,916,531.92	45,297,685.40	69,214,217.32	

§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(含基金经理小组)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
徐晨光	本基金基金经理	2009年7月14日	2010年11月5日	9年	曾任华泰证券股份有限公司北京总部行业研究员;2002年加盟嘉实基金管理有限公司,先后任研究员、社保基金经理职务。硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。
刘天君	本基金基金经理,嘉实优质企业股票基金经理,公司股票投资部总监	2010年11月5日	-	9年	曾任招商证券有限公司研发中心行业研究员,2003年4月加入嘉实基金管理有限公司,曾任行业研究员、研究部副总监、嘉实泰和封闭、嘉实成长收益混合基金经理。北京大学光华管理学院经济学硕士,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、《嘉实成长收益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

报告期内中国经济保持较高增速,但在高房价和通胀压力下政府逐步开始实施宏观调控,宽松货币政策逐步退出。海外经济在上半年经历了欧洲主权危机,股市相对较弱;而在下半年美国启动了二次量化宽松推动经济复苏和股市走强。国内外股票市场在上半年较弱,医药、消费等防守型行业取得超额收益;下半年在企业盈利超预期等因素推动下市场出现较大幅度反弹。

报告期内小盘股在较长时间内跑赢大盘股,本基金积极回避小盘股泡沫,未能分享小盘股的超额收益,而在较长时间内以金融、石化等大市值行业为主要配置对象,未能取得较好收益。

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0.9372元;本报告期基金份额净值增长率为1.29%,业绩比较基准收益率为-14.46%,本报告期基金份额净值增长率超越业绩比较基准收益率15.75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

展望2011年,中国经济将面临阶段性过热和高通胀并存的局面,因此宏观调控压力将持续存在,央行将通过持续加息和提高RRR等方式吸收流动性并控制信贷规模,通胀压力也将逐步缓解。可以预期,随着通胀压力真正缓解,名义经济增长率也将有所下降,传统经济难免经历一个阶段的低速增长期。另一方面,随着十二五规划出台,国内经济转型的动力将有所增强,同时海外经济又处于强劲复苏阶段,因此具备相对优势的新兴产业和核心竞争力的企业将迎来新一轮高速成长期。

基金基于长线投资理念,仍将以优质消费品企业和长线成长型企业为核心配置,并将适度增持受益于新一轮投资拉动和海外复苏的优势制造业,持续优化组合以获取更高收益。

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3.1.1"本期利润"为77,030,147.20元、"期末可供分配利润"为1,264,576,368.66元,本基金管理人以截至2010年12月31日可供分配收益为基准,向本基金份额持有人进行收益分配,收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.10元,权益登记日、除息日为2011年1月21日,红利发放日为2011年1月24日,合计分配36,132,548.46元,符合本基金基金合同(二十三(三))的约定(即"在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每年至少分配一次,年度分配在基金会计年度结束后的4个月内完成")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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对嘉实成长收益证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

嘉实成长收益证券投资基金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20636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:嘉实成长收益证券投资基金

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	111,913,231.71	311,649,485.17
结算备付金		12,326,775.29	10,718,780.24
存出保证金		1,061,321.85	4,054,975.51
交易性金融资产	7.4.7.2	3,368,321,890.08	2,929,650,960.98
其中:股票投资		2,558,340,890.08	2,211,392,960.98
基金投资		-	-
债券投资		809,981,000.00	718,258,000.00
资产支持证券投资		-	-
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		-	58,798,625.57
应收利息	7.4.7.5	23,799,784.57	14,058,715.96
应收股利		-	-
应收申购款		838,260.41	262,161.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,518,261,263.91	3,329,193,705.08
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		68,977,185.67	-
应付赎回款		1,586,526.87	7,462,443.38
应付管理人报酬		4,425,510.56	4,209,383.21
应付托管费		737,585.06	701,563.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,225,718.17	5,620,789.39
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	851,225.52	609,740.90
负债合计		82,803,751.85	18,603,920.76
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,170,881,143.40	2,074,669,211.39
未分配利润	7.4.7.10	1,264,576,368.66	1,235,920,572.93
所有者权益合计		3,435,457,512.06	3,310,589,784.32
负债和所有者权益总计		3,518,261,263.91	3,329,193,705.08

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.9372元,基金份额总额3,665,750,065.24份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金

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		160,296,181.75	1,336,201,022.40
1.利息收入		26,992,445.82	32,018,135.94
其中:存款利息收入	7.4.7.11	2,078,231.72	1,647,858.00
债券利息收入		24,914,214.10	30,370,277.94
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		289,592,677.76	1,089,578,808.37
其中:股票投资收益	7.4.7.12	255,778,611.82	1,069,129,812.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,490,370.74	-6,731,033.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	880,162.50
股利收益	7.4.7.16	25,323,695.20	26,299,867.63
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	-157,319,909.17	214,185,277.85
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	1,030,967.34	418,800.24
减:二、费用		83,266,034.55	98,400,709.81
1.管理人报酬		48,541,907.91	48,632,911.92
2.托管费		8,090,317.98	8,105,485.30
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	25,875,618.87	41,036,116.74
5.利息支出		314,960.72	197,554.37
其中:卖出回购金融资产支出		314,960.72	197,554.37
6.其他费用	7.4.7.20	443,229.07	428,641.48
三、利润总额		77,030,147.20	1,237,800,312.59
减:所得税费用		-	-
四、净利润		77,030,147.20	1,237,800,312.59

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实成长收益证券投资基金

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)	2,074,669,211.39	1,235,920,572.93	3,310,589,784.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	77,030,147.20	77,030,147.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	96,211,932.01	20,839,865.85	117,051,797.86
其中:1.基金申购款	971,140,144.85	506,535,032.35	1,477,675,177.20
2.基金赎回款	-874,928,212.84	-485,695,166.50	-1,360,623,379.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-69,214,217.32	-69,214,217.32
五、期末所有者权益(基金净值)	2,170,881,143.40	1,264,576,368.66	3,435,457,512.06
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)	2,694,797,808.01	250,511,119.22	2,945,308,927.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,237,800,312.59	1,237,800,312.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-620,128,596.62	-252,390,858.88	-872,519,455.50
其中:1.基金申购款	248,755,894.22	92,689,008.08	341,444,902.30
2.基金赎回款	-868,884,490.84	-345,079,866.96	-1,213,964,357.80
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)	2,074,669,211.39	1,235,920,572.93	3,310,589,784.32

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
中国银行股份有限公司("中国银行")	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

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 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	48,541,907.91	48,632,911.92
其中:支付给销售机构的客户维护费	1,354,731.48	1,246,399.70

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	8,090,317.98	8,105,485.30

注:支付基金托管人中国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
中国银行	207,804,794.11	10,383,684.93	-	-	390,048,000.00	314,960.72
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
中国银行	29,922,693.58	-	-	-	751,170,000.00	167,471.15

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

本期及上年度可比期间,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)及上年度末(2009年12月31日),其他关联方未投资本基金。

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
中国银行	111,913,231.71	1,956,748.00	311,649,485.17	1,519,486.37

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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
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	222,585	2,893,605.00	3,238,611.75	-
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	4,999,911	95,330,911.63	98,548,245.81	-

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(2010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	2,558,340,890.08	72.72
	其中:股票	2,558,340,890.08	72.72
2	固定收益投资	809,981,000.00	23.02
	其中:债券	809,981,000.00	23.02
	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	124,240,007.00	3.53
6	其他各项资产	25,699,366.83	0.73
7	合计	3,518,261,263.91	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	143,653,545.69	4.18
B	采掘业	30,183,542.88	0.88
C	制造业	1,960,607,867.77	57.07
C0	食品、饮料	438,377,668.33	12.76
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	483,388,820.43	14.07
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	411,861,324.63	11.99
C8	医药、生物制品	626,980,054.38	18.25
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	135,953,310.32	3.96
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	67,316,210.73	1.96
H	批发和零售贸易	190,047,937.25	5.53
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	30,578,475.44	0.89
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,558,340,890.08	74.47

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	000423	东阿阿胶	3,504,901	179,100,441.10	5.21
2	002241	歌尔声学	2,862,050	156,468,273.50	4.55
3	002422	科伦药业	782,113	123,198,439.76	3.59
4	000538	云南白药	2,003,627	121,019,070.80	3.52
5	000651	格力电器	6,060,427	109,875,541.51	3.20
6	000858	五粮液	3,000,000	103,890,000.00	3.02
7	002106	莱宝高科	1,507,130	99,847,362.50	2.91
8	600518	康美药业	4,999,911	98,548,245.81	2.87
9	000869	张裕A	954,037	91,549,390.52	2.66
10	002299	圣农发展	2,489,310	89,490,694.50	2.60

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	600028	中国石化	349,307,306.91	10.55
2	601006	大秦铁路	317,942,129.01	9.60
3	601328	交通银行	279,334,991.77	8.44
4	600015	华夏银行	237,615,400.24	7.18
5	601668	中国建筑	227,975,277.51	6.89
6	000858	五粮液	223,723,223.06	6.76
7	002241	歌尔声学	182,072,729.26	5.50
8	002024	苏宁电器	170,316,862.75	5.14
9	600050	中国联通	166,876,767.25	5.04
10	000423	东阿阿胶	162,053,571.19	4.90
11	600188	兖州煤业	150,488,306.67	4.55
12	601398	工商银行	142,915,256.36	4.32
13	000538	云南白药	130,801,254.74	3.95
14	600688	S上石化	126,925,920.46	3.83
15	600104	上海汽车	120,327,388.50	3.63
16	600770	综艺股份	118,474,367.13	3.58
17	000651	格力电器	115,364,059.25	3.48
18	000869	张裕A	112,569,567.16	3.40
19	601899	紫金矿业	109,793,734.33	3.32
20	600377	宁沪高速	107,690,546.55	3.25
21	600029	南方航空	106,591,543.84	3.22
22	002422	科伦药业	104,068,712.94	3.14
23	600519	贵州茅台	98,592,437.55	2.98
24	002142	宁波银行	97,659,362.56	2.95
25	600859	王府井	97,560,966.54	2.95
26	600518	康美药业	95,330,911.63	2.88
27	000581	威孚高科	92,599,472.16	2.80
28	002299	圣农发展	90,209,483.77	2.72
29	600809	山西汾酒	89,787,506.87	2.71
30	000069	华侨城A	86,994,819.68	2.63
31	002106	莱宝高科	86,325,150.40	2.61
32	600887	伊利股份	84,604,945.61	2.56
33	002482	广田股份	80,510,257.02	2.43
34	600329	中新药业	75,759,775.00	2.29
35	601111	中国国航	73,071,231.19	2.21
36	000338	潍柴动力	70,768,979.70	2.14
37	600100	同方股份	69,428,447.38	2.10
38	002123	梦兰股份	69,347,544.60	2.09
39	002304	洋河股份	67,991,589.66	2.05
40	000024	招商地产	66,927,527.06	2.02
41	600031	三一重工	66,524,411.88	2.01

8.4.2 累计卖出金额超