嘉实主题精选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	嘉实主题混合
基金主代码	070010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年7月21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	10,135,377,147.53 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	充分把握中国崛起过程中的投资机会,谋求基金资产长期稳定增值。
投资策略	采用"主题投资策略",从主题发掘、主题配置和个股精选三个层面构建股票投资组合,并优先考虑股票类资产的配置,剩余资产配置于固定收益类和现金类等大类资产。
业绩比较基准	沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×5%
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	tgcxpl@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	884,398,971.65	2,091,957,961.13	-2,423,215,083.42
本期利润	2,526,887,349.80	4,565,549,833.20	-6,312,113,087.96
加权平均基金份额本期利润	0.2142	0.5320	-0.7800
本期加权平均净值利润率	15.66%	52.56%	-78.85%
本期基金份额净值增长率	19.11%	82.49%	-52.49%
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	131,784,004.34	-632,334,871.75	-2,403,378,292.11
期末可供分配基金份额利润	0.0130	-0.0782	-0.3256
期末基金资产净值	14,852,534,641.01	9,938,026,564.74	4,978,269,241.63
期末基金份额净值	1.465	1.230	0.674
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	258.23%	200.77%	64.81%

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	2.52%	1.04%	6.28%	1.68%	-3.76%	-0.64%
过去六个月	12.00%	0.79%	20.95%	1.47%	-8.95%	-0.68%
过去一年	19.11%	0.96%	-11.77%	1.50%	30.88%	-0.54%
过去三年	3.27%	1.91%	-39.16%	2.21%	42.43%	-0.30%
自基金合同生效起至今	258.23%	1.90%	126.36%	2.14%	131.87%	-0.24%

注:本基金业绩比较基准为沪深300指数增长率×95%+同业存款收益率×5%。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)=95%*(沪深300指数(t)/沪深300指数(t-1)-1)+5%*同业存款日收益率

Benchmark(t)=(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:按基金合同约定,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十四条(二)投资范围、(八)2.投资组合比例限制)约定:(1)资产配置范围为:股票资产30%-95%,债券0-70%,权证0-3%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;(2)持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;(3)本基金与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)在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五;(5)持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的3%;(6)法律法规和基金合同规定的其他限制。

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7月21日,2006年度的相关数据根据当年实际存续期(2006年7月21日至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年	-	-	-	-	
2009年	-	-	-	-	
2008年	3.4300	519,247,289.55	2,147,700,776.87	2,666,948,066.42	
合计	3.4300	519,247,289.55	2,147,700,776.87	2,666,948,066.42	

§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		
邹唯	本基金基金经理	2007年7月21日	-	9年	曾任职于长城证券研究发展中心,2003年6月进入嘉实基金管理有限公司研究部工作,曾任嘉实浦安保本、嘉实稳健混合、嘉实策略混合基金经理。硕士研究生,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

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、《嘉实主题精选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

报告期内,A股整体走势虽然呈现先抑后扬态势,但从分季度来看,全年指数走势复杂,是市场对于经济、流动性预期变化复杂的体现。

一季度,贷款总量与速度的控制,存款准备金的上调,政府对于房价的调控预期,对于地方融资平台的限制,政策的不确定性粉碎了市场在2009年4季度对于大小盘风格转换、跨年度创新高行情的预期。市场为震荡走势,中小盘与主题投资等结构性投资机会凸显;

二季度,在国内政策后瞻性的紧缩与调控,下半年全球经济包括中国出现前高后低、二次调整的预期,以及欧洲国家主权信用风险持续扩大三个负面因素的影响下,市场呈现单边下跌态势,中小盘股于4月阶段性见顶后随之逐渐走弱;

三季度,在大宗商品价格,尤其是农产品价格的大涨,新兴市场通胀开始显现,政府却没有缩紧流动性的背景下,市场反弹,资金再次涌入中小盘股,中小盘指数继续创出新高,进一步扩大了结构性泡沫和估值不均衡性。

四季度,在美国政府启动QE2,美元贬值、日元降息的货币博弈中,流动性进一步推高了资源品价格与股市。流动性催生泡沫毋庸置疑,但若经济基础不牢,在通胀压力下,泡沫追寻的就仅是结构性以及估值与趋势的游戏,而这是不具有持续性的。因此市场先扬后抑,大幅震荡,风格资产转换激烈,大盘周期股先扬后抑,而中小盘股则先抑后扬,继续创出历史新高。扬是由于流动性预期,而流动性进一步推高了资源品价格后,随之抑则是出于通胀控制预期。

2010年实际是结构性牛市,惟一贯穿全年的行情就是中小盘股。一方面出于经济复苏预期的不确定性,另一方面流动性充裕与经济未来转型预期的确定性,于是转型预期+流动性催生了本轮的中小盘股牛市。

本基金在上半年行情中基本判断正确,而下半年失误的主要原因在于没有考虑到政府在保增长与控制通胀预期二者之间,选择前者,继续保持的充裕流动性;加上美国的QE2,美元贬值的一致预期,致使流动性是下半年市场的主导因素,而非经济基本面预期。

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1.465元;本报告期基金份额净值增长率为19.11%,业绩比较基准收益率为-11.77%,本报告期基金份额净值增长率超越业绩比较基准收益率30.88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

自2009年中期以来,本基金判断影响市场的5个负面因素:①全球通胀,②美国经济,③企业盈利增速,④M1与M2增速,⑤房价与交易量)来看。通胀是影响2011上半年经济和市场的主导因素。在国内外流动性充裕的背景下,资源品价格的大幅上涨,以及国内虚拟资产价格的高企,这对于复苏基础不牢、劳动力成本逐渐提升、工业化进程需要转型的中国构成了巨大的通胀成本压力。而另一方面紧缩政策的温和拖延,却增加了经济未来出现阶段性滞涨的可能性。

因此本基金坚持认为,在流动性充裕、虚拟资产价格高企、贫富差距不断扩大的情况下,2010年下半年政府在保增长与控制通胀预期二者之间选择前者,是一种短期的不理性拖延行为,这反而会使流动性影响还会继续演绎。在美国参与的全球货币博弈的背景下,预计2011上半年全球通胀压力只会加剧,将会加大政府的宏观调控压力,而"矫枉必过正"的调控行为无疑将会大大增加市场的调整压力和波动幅度。因此2011年A股市场的不确定性和风险远大于2010年,尤其假如上半年通胀压力继续加大,市场则存在较大的系统性风险,本基金继续维持对于市场中期的谨慎看法。

从分季度关注点来看,国内宏观政策的多目标管理,保持温和的紧缩政策,以及美国继续坚持数量宽松政策,本基金预计一季度流动性因素继续存在,但通胀压力继续增大,市场无系统性机会,基金配置主要在于通胀主题(农业与石油相关的大农业主题);二季度则重点关注全球通胀(体现为油价与农产品价格,国内还包括房价),政策紧缩的风险,以及欧债风险再次爆发的可能性。以防范出现较大的系统性风险;下半年重点关注宏观紧缩政策的变化以及经济复苏的进程。

总的来看,2011年-2012年国内经济或许处于中周期复苏的起点或起点前,但在通胀压力的冲击下,这个起点的过程可能会很复杂,市场的变化也随之很复杂。因此我们不能简单地以线性思维的方式来前瞻判断经济的走势。

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)报告期内本基金未实施利润分配;

(2)根据本报告3.1.1"本期利润"为2,526,887,349.80元、"期末可供分配利润"为131,784,004.34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0.050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50,647,101.06元,符合本基金基金合同十九(二)6、在符合有关基金分红条件的情况下,本基金收益每季度至少分配一次,每季度不超过三次,每年不超过十二次。在每基金份额可分配收益占基金份额面值的比例超过中国人民银行执行的三年期居民定期储蓄存款利率(税后)水平的120%时,基金应当分配收益"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")在对嘉实主题精选混合型证券投资基金(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,完全履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

嘉实主题精选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,注册会计师汪建、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20641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:嘉实主题精选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	805,459,695.28	1,392,483,714.42
结算备付金		350,977.76	30,082,821.52
存出保证金		1,585,586.72	5,092,823.03
交易性金融资产	7.4.7.2	13,981,560,919.18	8,690,152,212.21
其中:股票投资		12,589,383,015.58	8,191,802,212.21
基金投资		-	-
债券投资		1,392,177,903.60	498,350,000.00
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		74,426,638.02	-
应收利息	7.4.7.5	31,259,480.66	795,930.98
应收股利		-	-
应收申购款		1,198,175.88	9,359,850.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		14,895,841,473.50	10,127,967,352.71
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		-	128,322,746.21
应付赎回款		9,051,478.02	38,427,913.39
应付管理人报酬		19,387,063.52	12,591,112.38
应付托管费		3,231,177.24	2,098,518.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	10,941,509.27	7,781,179.18
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	695,604.44	719,318.09
负债合计		43,306,832.49	189,940,787.97
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	10,135,377,147.53	8,082,957,608.80
未分配利润	7.4.7.10	4,717,157,493.48	1,855,068,955.94
所有者权益合计		14,852,534,641.01	9,938,026,564.74
负债和所有者权益总计		14,895,841,473.50	10,127,967,352.71

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.465元,基金份额总额10,135,377,147.53份

7.2 利润表

会计主体:嘉实主题精选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	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		2,855,114,165.66	4,799,017,114.64
1.利息收入		204,073,899.06	19,730,413.05
其中:存款利息收入	7.4.7.11	13,406,459.23	10,306,874.85
债券利息收入		151,337,249.00	9,423,538.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		39,330,190.83	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		994,589,771.12	2,296,519,988.37
其中:股票投资收益	7.4.7.12	1,082,107,350.13	2,217,419,279.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-116,821,958.41	-4,650,508.63
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	29,304,379.40	83,751,217.30
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	1,642,488,378.15	2,473,591,872.07
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	13,962,117.33	9,174,841.15
减:二、费用		328,226,815.86	233,467,281.44
1.管理人报酬		241,620,258.34	129,326,331.13
2.托管费		40,270,042.97	21,554,388.50
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	45,424,637.30	82,131,579.54
5.利息支出		316,278.25	-
其中:卖出回购金融资产支出		316,278.25	-
6.其他费用	7.4.7.20	595,599.00	454,982.27
三、利润总额		2,526,887,349.80	4,565,549,833.20
减:所得税费用		-	-
四、净利润		2,526,887,349.80	4,565,549,833.20

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实主题精选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)	8,082,957,608.80	1,855,068,955.94	9,938,026,564.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,526,887,349.80	2,526,887,349.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	2,052,419,538.73	335,201,187.74	2,387,620,726.47
其中:1.基金申购款	11,178,323,843.82	3,779,504,760.75	14,957,828,604.57
2.基金赎回款	-9,125,904,305.09	-3,444,303,573.01	-12,570,207,878.10
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)	10,135,377,147.53	4,717,157,493.48	14,852,534,641.01
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)	7,381,647,533.74	-2,403,378,292.11	4,978,269,241.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,565,549,833.20	4,565,549,833.20
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	701,310,075.06	-307,102,585.15	394,207,489.91
其中:1.基金申购款	10,588,274,750.73	-100,489,872.06	10,487,784,878.67
2.基金赎回款	-9,886,964,675.67	-206,612,713.09	-10,093,577,388.76
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)	8,082,957,608.80	1,855,068,955.94	9,938,026,564.74

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(简称"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(简称"国都证券")	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

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

本报告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	241,620,258.34	129,326,331.13
其中:支付给销售机构的客户维护费	28,206,103.45	12,138,165.24

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	40,270,042.97	21,554,388.50

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	1,491,611,844.68	827,449,656.95	-	-	390,360,000.00	315,212.50
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	198,617,757.54	-	-	-	-	-

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	805,459,695.28	13,213,091.23	1,392,483,714.42	9,970,425.63

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

本期及上年度可比期间,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
002493	荣盛石化	2010.10.22	2011.2.9	ipo网下锁定三个月	53.80	63.96	993.977	53,475,962.60	63,574,768.92	-
300134	大富科技	2010.10.14	2011.1.26	ipo网下锁定三个月	49.50	66.00	373.831	18,504,634.50	24,672,846.00	-
002496	辉丰股份	2010.10.29	2011.2.9	ipo网下锁定三个月	48.69	55.80	90.645	4,413,505.05	5,057,991.00	-
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	-
002494	华斯股份	2010.10.22	2011.2.9	ipo网下锁定三个月	22.00	31.29	98.753	2,172,566.00	3,089,981.37	-
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
600518	康美药业	2010.12.28	配股申购期间停牌	19.71	2011.1.6	17.29	64,688.953	535,517,300.12	1,275,019,263.63	-
002246	北化股份	2010.12.28	筹划重大重组事项	17.29	2011.3.8	19.02	4,391.776	81,267,914.66	75,933,807.04	-

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	12,589,383,015.58	84.52
	其中:股票	12,589,383,015.58	84.52
2	固定收益投资	1,392,177,903.60	9.35
	其中:债券	1,392,177,903.60	9.35
	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	805,810,673.04	5.41
6	其他各项资产	108,469,881.28	0.73
7	合计	14,895,841,473.50	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	2,080,904,214.32	14.01
B	采掘业	153,236,066.84	1.03
C	制造业	7,432,109,491.23	50.04
C0	食品、饮料	654,850,855.12	4.41
C1	纺织、服装、皮毛	53,496,651.53	0.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	12,609,349.30	0.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,982,554,557.03	20.08
C5	电子	229,756,276.92	1.55
C6	金属、非金属	390,667,456.54	2.63
C7	机械、设备、仪表	1,484,933,736.26	10.00
C8	医药、生物制品	1,623,240,608.53	10.93
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	223,238,355.36	1.50
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	2,103,816,620.72	14.16
H	批发和零售贸易	62,067,769.60	0.42
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	26,781,022.62	0.18
K	社会服务业	262,433,000.28	1.77
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	244,796,474.61	1.65
	合计	12,589,383,015.58	84.76

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	600406	国电南瑞	19,720,877	1,421,086,396.62	9.57
2	600518	康美药业	64,688,953	1,275,019,263.63	8.58
3	000792	盐湖钾肥	12,880,548	853,207,499.52	5.74
4	002123	梦百合家居	13,579,894	645,044,965.00	4.34
5	600096	云天化	15,644,851	417,873,970.21	2.81
6	000876	新希望	18,949,459	396,991,166.05	2.67
7	600038	哈飞股份	11,720,876	333,810,548.48	2.25
8	002093	国脉科技	17,957,334	324,668,598.72	2.19
9	600251	冠农股份	10,261,437	291,732,653.91	1.96
10	600354	敦煌种业	7,985,039	289,856,915.70	1.95

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