嘉实服务增值行业证券投资基金 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	嘉实服务增值行业混合
基金主代码	070006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月1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	2,206,971,457.56 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩比较基准,在追求长期稳定增长的同时不放弃短期收益。
投资策略	在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制定资产配置比例的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。同时,根据合适的定性、定量指标选择服务业及其他产业内具有竞争优势的上市公司所发行的股票,获取稳定的长期回报。
业绩比较基准	投资基准指数=中信综合指数×80%+中信国债指数×20%
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金

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	tpxxpl@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	1,247,074,677.39	1,871,616,326.03	-2,237,210,936.36
本期利润	1,376,709,386.10	2,549,460,444.42	-4,250,925,450.73
加权平均基金份额本期利润	0.7526	1.6337	-2.0983
本期加权平均净值利润率	19.05%	51.51%	-70.41%
本期基金份额净值增长率	17.87%	77.01%	-47.30%
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	6,662,611,314.96	3,791,625,154.27	1,964,009,445.83
期末可供分配基金份额利润	3.0189	2.4547	1.1657
期末基金资产净值	9,844,979,395.28	5,921,798,218.06	3,648,860,522.17
期末基金份额净值	4.461	3.834	2.166
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	425.01%	345.41%	151.63%

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称达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	9.20%	1.62%	5.59%	1.36%	3.61%	0.26%
过去六个月	28.04%	1.32%	21.79%	1.21%	6.25%	0.11%
过去一年	17.87%	1.29%	-1.77%	1.25%	19.64%	0.04%
过去三年	9.96%	1.76%	-17.41%	1.85%	27.37%	-0.09%
过去五年	472.53%	1.73%	236.66%	1.73%	235.87%	0.00%
自基金合同生效起至今	425.01%	1.55%	136.88%	1.60%	288.13%	-0.05%

注:本基金业绩比较基准为中信综合指数×80%+中信国债指数×20%。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 t=1000

Return t=80%×(中信综合指数t/中信综合指数t-1)-1)+20%×(中信国债指数t/(上证国债指数t-1)-1)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:按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓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证正常市场情况下,本基金资产配置的比例范围:股票资产25%-95%;债券资产0%-70%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中,基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的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法律法规规定的其他限制。

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	0.5000	26,536,275.84	50,654,465.97	77,190,741.81	2009年度应分利润于2010年实施
2009	-	-	-	-	-
2008	2.0000	179,940,805.11	240,968,802.07	420,909,607.18	2007年应分利润于2008年实施
合计	2.5000	206,477,080.95	291,623,268.04	498,100,348.99	

§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23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、嘉实稳健双益债券、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		
陈勤	本基金基金经理,嘉实价值优势股票基金经理	2008年3月20日	-	8年	曾任瑞士信贷第一波士顿投资银行证券分析师,华夏基金管理有限公司基金经理助理,银华基金管理有限公司投资管理部,曾任银华优势企业混合基金经理。2007年11月加盟嘉实基金管理有限公司。工商管理硕士(MBA),经济学硕士,特许金融分析师(CFA),具有基金从业资格,国籍加拿大。

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、《嘉实服务增值行业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

过去的2010年是中国经济和股市错综复杂的一年,但总体来看经济波澜不惊,资本市场是结构性牛市。充裕的流动性继续成为市场的重要主导因素,而经济复苏走稳的不明朗使得权重股的估值水平全年持续受到压制,而资金持续在局部板块寻求突破,使得中小板和创业板指数的估值水平创出了历史新高。同时中小板指数相对权重指数的估值溢价率也达到了历史新高。

报告期内,表现比较好的行业有电子、医药、农林牧渔和食品饮料等,表现较差的有金融、地产、采掘和公用事业等。本基金在过去的一年里,在对经济及市场成动性有比较明确的判断的基础上,通过充分的个股挖掘以及相对正确的行业配置,取得了比较好的超额收益。

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4.461元;本报告期基金份额净值增长率为17.87%,业绩比较基准收益率为-1.77%,本报告期基金份额净值增长率超越业绩比较基准收益率19.64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

进入新的一年,我们对国内宏观经济形势的判读是经济增长前低后高,通货膨胀前高后低,全年看流动性可能呈现前紧后松的局面。未来一段时间市场的流动性环境大有所改善。同时,伴随着经济结构调整的不断深入,新兴技术的发展,经济复苏的趋势日益明确,使得投资范围和投资品种的不断丰富,为我们在结构性牛市中寻找个股投资机会提供了更大的空间。

从宏观经济的角度来看,我们对国内宏观经济形势的判读是经济增长前低后高,通货膨胀前高后低,全年看流动性可能呈现前紧后松的局面。未来一段时间市场的流动性环境大有所改善。同时,伴随着经济结构调整的不断深入,新兴技术的发展,经济复苏的趋势日益明确,使得投资范围和投资品种的不断丰富,为我们在结构性牛市中寻找个股投资机会提供了更大的空间。

从宏观经济的角度来看,我们对国内宏观经济形势的判读是经济增长前低后高,通货膨胀前高后低,全年看流动性可能呈现前紧后松的局面。未来一段时间市场的流动性环境大有所改善。同时,伴随着经济结构调整的不断深入,新兴技术的发展,经济复苏的趋势日益明确,使得投资范围和投资品种的不断丰富,为我们在结构性牛市中寻找个股投资机会提供了更大的空间。

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1,376,709,386.10元,期末可供分配利润"为6,662,611,314.96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21,153,129.13元,符合本基金基金合同《二十三、收益分配原则7款 在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至少一次;年度分配在基金会计年度结束后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")在对嘉实服务增值行业证券投资基金(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

嘉实服务增值行业证券投资基金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20637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:嘉实服务增值行业证券投资基金

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	536,907,650.18	403,097,131.80
结算备付金		38,330,609.10	36,599,575.24
存出保证金		7,602,117.31	11,901,661.66
交易性金融资产	7.4.7.2	9,142,169,011.22	5,283,426,619.03
其中:股票投资		8,882,961,011.22	5,024,174,619.03
基金投资		-	-
债券投资		259,208,000.00	259,252,000.00
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		157,235,384.41	223,316,840.70
应收利息	7.4.7.5	8,173,139.99	711,053.11
应收股利		-	-
应收申购款		8,600,538.25	2,420,395.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,899,018,450.46	5,961,473,276.99
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		16,420,213.71	-
应付赎回款		2,403,946.61	12,941,866.38
应付管理人报酬		12,442,183.79	7,561,637.19
应付托管费		2,073,697.33	1,260,272.87
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	18,823,704.61	16,018,330.03
应交税费		741,392.44	741,392.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,133,916.69	1,151,560.02
负债合计		54,039,055.18	39,675,058.93
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,206,971,457.56	1,544,658,566.01
未分配利润	7.4.7.10	7,638,007,937.72	4,377,139,652.05
所有者权益合计		9,844,979,395.28	5,921,798,218.06
负债和所有者权益总计		9,899,018,450.46	5,961,473,276.99

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值4.461元,基金份额总额2,206,971,457.56份。

7.2 利润表

会计主体:嘉实服务增值行业证券投资基金

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		1,593,359,845.86	2,762,093,501.57
1.利息收入		19,842,430.74	12,913,652.90
其中:存款利息收入	7.4.7.11	5,616,014.31	3,687,228.75
债券利息收入		13,703,977.67	9,226,424.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		522,438.76	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益		1,441,013,871.98	2,068,956,191.98
其中:股票投资收益	7.4.7.12	1,392,466,964.97	2,044,535,234.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	4,006,338.13	-503,632.64
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	44,540,568.88	24,924,590.45
3.公允价值变动收益	7.4.7.17	129,634,708.71	677,844,118.39
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.18	2,868,834.43	2,379,538.30
减:二、费用		216,650,459.76	212,633,057.15
1.管理人报酬		107,797,140.22	73,620,817.33
2.托管费		17,966,190.02	12,270,136.22
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	89,611,703.69	126,256,882.52
5.利息支出		800,830.92	41,747.20
其中:卖出回购金融资产支出		800,830.92	41,747.20
6.其他费用	7.4.7.20	474,594.91	443,473.88
三、利润总额		1,376,709,386.10	2,549,460,444.42
减:所得税费用		-	-
四、净利润		1,376,709,386.10	2,549,460,444.42

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实服务增值行业证券投资基金

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)	1,544,658,566.01	4,377,139,652.05	5,921,798,218.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,376,709,386.10	1,376,709,386.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	662,312,891.55	1,961,349,641.38	2,623,662,532.93
其中:1.基金申购款	1,415,959,888.47	4,312,457,508.35	5,728,417,396.82
2.基金赎回款	-753,646,996.92	-2,351,107,866.97	-3,104,754,863.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-77,190,741.81	-77,190,741.81
五、期末所有者权益(基金净值)	2,206,971,457.56	7,638,007,937.72	9,844,979,395.28
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)	1,684,851,076.34	1,964,009,445.83	3,648,860,522.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,549,460,444.42	2,549,460,444.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-140,192,510.33	-136,330,238.20	-276,522,748.53
其中:1.基金申购款	1,075,990,368.81	2,467,505,277.92	3,543,495,646.73
2.基金赎回款	-1,216,182,879.14	-2,603,835,516.12	-3,820,018,395.26
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)	1,544,658,566.01	4,377,139,652.05	5,921,798,218.06

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:下述关联方交易均按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,本基金均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	107,797,140.22	73,620,817.33
其中:支付给销售机构的客户维护费	5,349,393.19	4,401,889.25

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1.50%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 X 1.50%/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	17,966,190.02	12,270,136.22

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 X 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	99,650,000.00	-	-	-	405,272,000.00	270,607.35
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	-	158,386,928.77	-	-	190,000,000.00	36,413.22

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,本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	536,907,650.18	5,173,166.93	403,097,131.80	3,236,496.58

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
002241	歌尔声学	2010年10月20日	2011年10月21日	非公开发行流通受限	33.01	37.68	800.000	26,408,000.00	30,144,000.00	-
600406	国电南瑞	2010年10月25日	2011年10月21日	非公开发行流通受限	52.00	56.13	228.887	11,902,124.00	12,847,427.31	-
300126	锐奇股份	2010年9月27日	2011年1月13日	IPO网下锁定三个月	34.00	38.68	89.893	3,056,362.00	3,477,061.24	-
601118	海南橡胶	2010年12月30日	2011年1月7日	未上市	5.99	5.99	6.000	35,940.00	35,940.00	-
300157	恒泰艾普	2010年12月29日	2011年1月7日	未上市	57.00	57.00	500.000	28,500.00	28,500.00	-
002535	林州重机	2010年12月31日	2011年1月11日	未上市	25.00	25.00	1,000	25,000.00	25,000.00	-
300155	安居宝	2010年12月30日	2011年1月7日	未上市	49.00	49.00	500	24,500.00	24,500.00	-

7.4.5.1.2 受限证券关联: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 受限证券关联: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
600315	上海家化	2010年12月6日	筹划国资改革事宜	37.13	未知	未知	8,471.353	312,825,890.72	314,541,336.89	-
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	8,707.289	141,628,114.30	171,620,666.19	-

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	8,882,961,011.22	89.74
	其中:股票	8,882,961,011.22	89.74
2	固定收益投资	259,208,000.00	2.62
	其中:债券	259,208,000.00	2.62
	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	575,238,259.28	5.81
6	其他各项资产	181,611,179.96	1.83
7	合计	9,899,018,450.46	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	155,457,660.54	1.58
B	采掘业	206,535,739.12	2.10
C	制造业	4,938,701,374.23	50.16
C0	食品、饮料	1,669,392,810.97	16.96
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	423,326,158.49	4.30
C5	电子	301,940,873.67	3.07
C6	金属、非金属	423,974,943.57	4.31
C7	机械、设备、仪表	1,104,694,787.13	11.22
C8	医药、生物制品	1,015,371,800.40	10.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	94,129,035.66	0.96
E	建筑业	293,270,808.45	2.98
F	交通运输、仓储业	177,662,040.42	1.80
G	信息技术业	959,765,163.82	9.75
H	批发和零售贸易	845,734,878.27	8.59
I	金融、保险业	923,210,787.70	9.38
J	房地产业	92,889,608.58	0.94
K	社会服务业	195,603,914.43	1.99
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	8,882,961,011.22	90.23

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	600315	上海家化	8,471.353	314,541,336.89	3.19
2	000895	双汇发展	3,422.587	297,765,069.00	3.02
3	600406	国电南瑞	4,158.024	295,981,039.53	3.01
4	000568	泸州老窖	7,184,200	293,833,780.00	2.98
5	600970	中材国际	7,025,855	286,022,557.05	2.91
6	600887	伊利股份	7,013,222	268,325,873.72	2.73
7	600729	重庆百货	5,505,380	242,236,720.00	2.46
8	000060	中金岭南	10,059,509	226,338,952.50	2.30
9	000651	格力电器	11,418,499	207,017,386.87	2.10
10	000876	新希望	9,801,438	205,340,126.10	2.09

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	600000	浦发银行	676,707,172.43	11.43
2	000858	五粮液	475,565,202.82	8.03
3	601166	兴业银行	440,591,012.60	7.44
4	601318	中国平安	433,708,207.62	7.32
5	000568	泸州老窖	433,474,464.03	7.32
6	600315	上海家化	415,757,888.65	7.02
7	000651	格力电器	412,331,965.14	6.96
8	600015	华夏银行	412,221,352.48	6.96
9	601169	北京银行	408,803,007.74	6.90
10	000792	盐湖钾肥	403,327,779.58	6.81
11	000423	东阿阿胶	368,613,663.01	6.22
12	000963	华东医药	360,676,036.66	6.09
13	600525	长园集团	341,571,137.60	5.77
14	002024	苏宁电器	337,433,499.54	5.70
15	600036	招商银行	327,167,425.75	5.52
16	601