丰和价值证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2011年8月24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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月19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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	丰和价值证券投资基金
基金简称	嘉实丰和价值封闭(深交所上市简称:基金丰和)
基金主代码	184721
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	2002年3月22日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2002年4月4日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为价值型证券投资基金,主要投资于依照有关区分股票价值、成长特征的指标所界定的价值型股票,通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"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。坚持价值型投资理念,确立以相对价值判断为核心,兼顾对公司内在价值评估的选股思路;同时,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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	李芳菲
	联系电话	(010)65215588	(010)66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65182266	(010)63201816

2.4信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	-9,042,424.97
本期利润	-574,291,390.16
加权平均基金份额本期利润	-0.1914
本期加权平均净值利润率	-17.32%
本期基金份额净值增长率	-15.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	5,101,938.61
期末可供分配基金份额利润	0.0017
期末基金资产净值	3,048,641,705.41
期末基金份额净值	1.0162
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	380.68%

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
过去一个月	3.65%	2.22%				
过去三个月	-6.82%	2.37%				
过去六个月	-15.53%	2.21%				
过去一年	11.27%	2.34%				
过去三年	36.15%	2.94%				
自基金合同生效起至今	380.68%	2.72%				

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

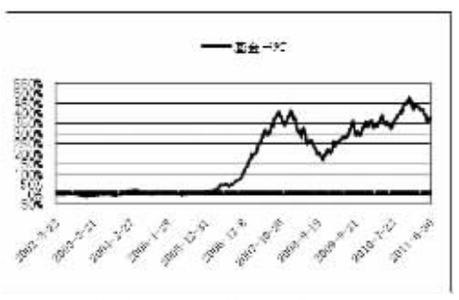

图:嘉实丰和价值封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图

(2002年3月22日至2011年6月30日)

注:按基金合同约定,本基金自基金合同生效日起3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(七、(四)投资组合)的有关约定:(1)本基金投资于股票、债券的比重不低于基金资产总值的80%,投资于国债的比重不低于基金资产净值的20%;(2)本基金投资于一家上市公司的股票,不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总和,不超过该证券的10%;(4)本基金股票投资组合的平均BP值高于沪深A股市场的平均BP值;(5)遵守中国证监会规定的其他比例限制。

§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。

截止2011年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式基金、23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、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长股票。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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
顾义河	本基金基金经理	2009年6月17日	-	10	曾任职于中银国际控股有限公司,2002年9月加盟嘉实基金管理有限公司,先后任分析师、高级分析师。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、《丰和价值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

回顾11年上半年,沪深300指数跑赢中证500指数近10%,我们认为主要基于以下几点原因:第一,通货膨胀压力引发了政府持续的紧缩政策,市场的流动性紧张,资本市场的资金供应受到压制;第二,中小市值上市公司的2011年第一季度业绩出现了较大幅度的低于预期的情形,而2010年小盘股又大幅度跑赢中大盘股,因此小盘股跌幅较大;第三,市场预期政府在严厉调控房地产的同时,为防止经济下滑,会增加保障房、中西部基础设施建设,以避免出现国内投资不足的风险,因此内需相关各板块表现较好;第四,欧债危机、美国QE3预期,以及中东、北非地缘政治风险等一系列因素推高国际原材料价格,资源股表现较好。

报告期内,鉴于市场估值在合理偏低的位置、对上市公司业绩低于预期的情况估计不足,且在3月的CPI阶段性的低于预期导致对4月的CPI抱有较为乐观的态度,判断政策可能不会进一步紧缩,本基金因此在操作中没有及时减仓,在整个报告期维持了中等偏高的仓位,前期蒙受了一定的亏损,尽管后期通过加强了对个股选择取得了一定的阶段性收益,但总体表现还是较差。报告期内,本组合主要超配了爆破服务、化工新材料、信息服务和信息设备行业,显著低配了金融行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金基金份额净值为1.0162元;本报告期基金份额净值增长率为-15.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们认为通胀状况依旧是政策的首要风向标。如果通胀指标在三季度不出现超预期高的情形,我们认为政策的基调将保持稳定,而在中西部投资消费发展、保障房建设、水利设施建设等方面将出现较为有利的财政政策支持。一方面,随着政策的相对宽松,资本市场的预期和资金供应压力有望缓解。另一方面,鉴于市场整体估值水平处于历史上中低位置,我们认为市场有较大的安全边际。因此,我们认为市场将可能会有一个相对较好的表现。我们将一方面关注估值处于历史低位且存在修复和提升空间的行业和个股,另一方面将同时兼顾新兴产业规划细则的出台对中小盘绩优股股带来的估值修复的空间。

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、交易、基金运营、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,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

根据本报告3.1本期利润为-574,291,390.16元,因此报告期内本基金未实施当期利润分配。

附说明:本基金的基金管理人于2011年3月28日发布《丰和价值证券投资基金2010年年度收益分配公告》,实施本基金2010年度利润分配,每10份基金份额派发现金红利0.44元,具体参见本报告"6.4.11 利润分配情况"。

§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

在托管丰和价值证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《丰和价值证券投资基金基金合同》、《丰和价值证券投资基金托管协议》的约定,对丰和价值证券投资基金管理人—嘉实基金管理有限公司2011年1月1日至2011年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司在丰和价值证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支、利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的丰和价值证券投资基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1资产负债表

会计主体:丰和价值证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
资 产:			
银行存款	6.4.7.1	154,712,288.23	64,572,178.55
结算备付金		1,954,295.11	8,153,242.85
存出保证金		1,160,000.00	1,160,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	2,942,710,015.15	3,726,226,543.32
其中:股票投资		2,322,171,606.55	2,950,065,943.32
基金投资		-	-
债券投资		620,538,408.60	776,160,600.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	886,352.99
应收利息	6.4.7.5	6,480,235.34	19,233,400.33
应收股利		419,933.64	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	260,790.04	-
资产总计		3,107,697,557.51	3,820,231,718.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		50,053,057.23	53,713,663.19
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,637,488.27	4,747,315.02
应付托管费		606,248.05	791,219.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,308,875.47	3,856,349.09
应交税费		1,340,076.02	1,340,076.02
应付利息		-	-
应付利润		132,000.00	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	978,107.06	850,000.00
负债合计		59,055,852.10	65,298,622.47
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	48,641,705.41	754,933,095.57
所有者权益合计		3,048,641,705.41	3,754,933,095.57
负债和所有者权益总计		3,107,697,557.51	3,820,231,718.04

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值1.0162元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

6.2 利润表

会计主体:丰和价值证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
一、收入		-534,658,173.03	-119,659,233.03
1.利息收入		10,971,471.61	9,258,668.93
其中:存款利息收入	6.4.7.11	320,227.22	807,033.85
债券利息收入		10,651,244.39	8,451,635.08
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		19,619,298.12	133,411,499.30
其中:股票投资收益	6.4.7.12	13,463,355.52	128,819,296.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-4,584,952.09	126,362.46
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	819,046.55
股利收益	6.4.7.15	10,740,894.69	3,646,794.20
3.公允价值变动收益	6.4.7.16	-565,248,965.19	-262,397,899.79
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	6.4.7.17	22.43	68,498.53
减:二、费用		39,633,217.13	36,830,212.07
1.管理人报酬		24,676,768.50	22,208,278.24
2.托管费		4,112,794.75	3,701,379.72
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.18	10,376,309.36	10,257,770.50
5.利息支出		96,827.50	425,586.55
其中:卖出回购金融资产支出		96,827.50	425,586.55
6.其他费用	6.4.7.19	370,517.02	237,197.06
三、利润总额		-574,291,390.16	-156,489,445.10
减:所得税费用		-	-
四、净利润		-574,291,390.16	-156,489,445.10

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:丰和价值证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30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)	3,000,000,000.00	754,933,095.57	3,754,933,095.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-574,291,390.16	-574,291,390.16
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	-	-132,000,000.00	-132,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	48,641,705.41	3,048,641,705.41
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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)	3,000,000,000.00	6,696,162.01	3,006,696,162.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-156,489,445.10	-156,489,445.10
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)	3,000,000,000.00	-149,793,283.09	2,850,206,716.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 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相一致。

6.4.2差错更正的说明

报告期内,本基金不存在重大会计差错事项。

6.4.3关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司(中国农业银行)	基金托管人
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

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	1,825,642,855.17	26.97%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	-	-	6,323,971.70	98.56%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.4.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券有限责任公司	-	-	50,000,000.00	100.00%

注:本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.4.1.4 权证交易

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30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	1,551,794.27	27.54%	1,054,077.78	35.04%

注:(1)本期(2011年1月1日至2011年6月30日),本基金无应支付关联方的佣金。

(2)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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	24,676,768.50	22,208,278.24
其中:支付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。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,112,794.75	3,701,379.72

注:支付基金托管人中国农业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。

6.4.4.3 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 2011年1月1日至2011年6月30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
中国农业银行	9,714,223.77	19,893,889.32	-	-	-	-

注:上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 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 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
基金合同生效日(2002年3月22日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	12,010,000.00	12,010,000.00
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	12,010,000.00	12,010,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.40%	0.40%

注:基金管理人作为本基金发起人,于本基金发行期间2002年3月15日至2002年3月18日通过网下配售认购本基金份额6,000,000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6,010,000份,交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。

6.4.4.4.2 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 2011年6月30日		上年度末 2010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	6,000,000.00	0.20%	6,000,000.00	0.20%
立信投资有限责任公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%
广发证券股份有限公司	3,000,000.00	0.10%	3,000,000.00	0.10%

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)、吉林省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,均于本基金发行期间2002年3月15日至2002年3月18日通过网下配售各认购本基金份额6,000,000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。基金合同生效一年以后的存续期间,各基金发起人持有的基金份额不得低于其认购基金份额的50%。

(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3,000,000份转让给立信投资有限责任公司,于2008年3月31日在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司办理完过户手续。

6.4.4.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	154,712,288.23	276,024.09	58,779,814.53	770,077.89

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期(2011年1月1日至2011年6月30日)及上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日),本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.5期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.1.1 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
300239	东宝生物	2011年6月29日	2011年7月6日	未上市	9.00	9.00	500	4,500.00	4,500.00	-

6.4.5.1.2 受限证券类别:债券

本期末(2011年6月30日),本基金未持有流通受限的债券。

6.4.5.1.3 受限证券类别:其他

本期末(2011年6月30日),本基金未持有流通受限的其他证券。

6.4.5.2 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
002296	辉煌科技	2011年6月28日	筹划重大资产重组停牌	26.00	未知	未知	658,005	22,487,799.00	17,108,130.00	-

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2011年6月30日),本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2011年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 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	2,322,171,606.55	74.72
	其中:股票	2,322,171,606.55	74.72
2	固定收益投资	620,538,408.60	19.97
	其中:债券	620,538,408.60	19.97
	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	156,666,583.34	5.04
6	其他各项资产	8,320,959.02	0.27
7	合计	3,107,697,557.51	100.00

7.2 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	-	-
B	采掘业	250,562,823.61	8.22
C	制造业	1,259,472,077.76	41.31
C0	食品、饮料	157,306,135.80	5.16
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	332,847,915.40	10.92
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	170,089,106.18	5.58
C7	机械、设备、仪表	428,009,447.82	14.04
C8	医药、生物制品	171,219,472.56	5.62
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	116,822,061.69	3.83
F	交通运输、仓储业	164,283,853.60	5.39
G	信息技术业	238,618,323.23	7.83
H	批发和零售贸易	27,427,396.60	0.90
I	金融、保险业	68,289,704.67	2.24
J	房地产业	78,379,488.07	2.57
K	社会服务业	33,679,316.40	1.10
L	传播与文化产业	28,842,021.00	0.95
M	综合类	55,794,539.92	1.83
	合计	2,322,171,606.55	76.17

7.3 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	002152	广电运通	5,203,269	160,416,783.27	5.26
2	002037	久联发展	4,388,086	106,981,536.68	3.51
3	002063	远光软件	5,490,221	103,929,883.53	3.41
4	600104	上海汽车	5,208,152	97,600,768.48	3.20
5	600009	上海机场	6,749,656	86,395,596.80	2.83
6	002410	广联达	2,392,103	83,053,816.16	2.72
7	600458	时代新材	4,291,848	82,575,155.52	2.71
8	600887	伊利股份	4,940,572	82,260,523.80	2.70
9	002341	新纶科技	4,045,426	81,798,513.72	2.68
10	002430	杭氧股份	3,608,331	80,790,531.09	2.65

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)的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1累计买入金额前20名的股票明细

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	601318	中国平安	203,101,317.04	5.41
2	600036	招商银行	119,423,164.42	3.18
3	600009	上海机场	98,514,264.59	2.62
4	600104	上海汽车	98,387,601.07	2.62
5	600383	金地集团	94,458,639.68	2.52
6	002080	中材科技	87,897,210.62	2.34
7	601699	潞安环能	86,061,276.28	2.29
8	600028	中国石化	79,810,717.55	2.13
9	600048	保利地产	77,778,723.37	2.07
10	600497	驰宏锌锗	71,507,677.57	1.90
11	600720	祁连山