

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:2012年3月30日

重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构不存在虚假记载、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法律责任。
基金管理人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2012年3月22日披露了本基金的财务报告,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。

基金简介

Table with 2 columns: 基金名称, 非和价值证券投资基金; 基金简称, 嘉实非和价值封闭(深交所上市简称:基金非和); 基金代码, 184721; 基金运作方式, 契约封闭式; 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
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格、成长性指标所界定的价值股票,通过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增值。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with 2 columns: 项目, 基金管理人; 名称, 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; 信息披露负责人, 姓名: 胡勇欣, 联系电话: 010 65215588, 电子邮箱: service@jfund.cn; 客户服务电话, 400-600-8800; 官方网站, 010 65182266.

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的互联网网址: http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点: 北京市建国门外大街甲9号嘉实大厦8层

3 主要财务指标和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

Table with 4 columns: 3.1.1 期间数据和指标, 2011年, 2010年, 2009年; 3.1.2 期末数据和指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末; 3.1.3 累计期末指标, 2011年末, 2010年末, 2009年末.

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

Table with 5 columns: 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标准差③, ①-③, ②-③.

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

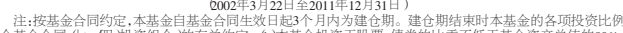


图:嘉实非和价值封闭累计份额净值增长率的历史走势对比图

注:按基金合同约定,本基金基金合同自2002年3月22日起生效。建仓期结束前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,债券的市值不低于基金资产净值的80%,投资于国债的比例不低于基金资产净值的20%;②本基金投资于国内、外上市公司的股票,不超过基金资产净值的10%;③本基金与由本基金管理的其他基金持有一家公司发行的证券和,不超过该证券的10%;④本基金投资资产组合的平均剩余存续期高于国家规定的90日;⑤遵守中国证监会规定的其他投资限制。

3.2.3 过去三年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

Table with 4 columns: 年度, 每100份基金份额净值增长率, 同期业绩比较基准收益率, 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率差.

3.3 过去三年基金的利润分配情况

Table with 4 columns: 年度, 每100份基金份额分配次数, 现金形式发放总额, 年度利润分配合计.

4 基金管理人及基金托管人

4.1 基金管理人及基金托管人的基本情况

4.1.1 基金管理人: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。总行在北京,在全国设有30个分公司,管理资产规模超过10000亿元人民币。

4.1.2 基金托管人:中国农业银行股份有限公司,成立于1985年,是中国最大的国有商业银行之一,资产规模超过100000亿元人民币。

4.2 基金管理人及基金托管人的主要人员情况

4.2.1 基金管理人:基金管理人主要人员情况,包括董事长、副董事长、高级管理人员等。

4.2.2 基金托管人:基金托管人主要人员情况,包括行长、副行长、高级管理人员等。

4.3 基金管理人及基金托管人的内部控制制度

4.3.1 基金管理人:基金管理人内部控制制度,包括风险管理、合规管理、信息披露等。

4.3.2 基金托管人:基金托管人内部控制制度,包括资产保管、资金清算、会计核算等。

4.4 基金管理人及基金托管人的基金托管业务

4.4.1 基金管理人:基金管理人基金托管业务,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.4.2 基金托管人:基金托管人基金托管业务,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.5 基金管理人及基金托管人的基金销售业务

4.5.1 基金管理人:基金管理人基金销售业务,包括基金产品的推广、销售、服务等。

4.5.2 基金托管人:基金托管人基金销售业务,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.6 基金管理人及基金托管人的基金投资业务

4.6.1 基金管理人:基金管理人基金投资业务,包括股票、债券、衍生品等的投资。

4.6.2 基金托管人:基金托管人基金投资业务,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.7 基金管理人及基金托管人的基金风险管理

4.7.1 基金管理人:基金管理人基金风险管理,包括市场风险、信用风险、流动性风险等。

4.7.2 基金托管人:基金托管人基金风险管理,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.8 基金管理人及基金托管人的基金信息披露

4.8.1 基金管理人:基金管理人基金信息披露,包括基金净值、财务报告、重大事项等。

4.8.2 基金托管人:基金托管人基金信息披露,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.9 基金管理人及基金托管人的基金其他业务

4.9.1 基金管理人:基金管理人其他业务,包括资产管理、咨询、培训等。

4.9.2 基金托管人:基金托管人其他业务,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.10 基金管理人及基金托管人的基金其他事项

4.10.1 基金管理人:基金管理人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.10.2 基金托管人:基金托管人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.11 基金管理人及基金托管人的基金其他事项

4.11.1 基金管理人:基金管理人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.11.2 基金托管人:基金托管人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.12 基金管理人及基金托管人的基金其他事项

4.12.1 基金管理人:基金管理人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.12.2 基金托管人:基金托管人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.13 基金管理人及基金托管人的基金其他事项

4.13.1 基金管理人:基金管理人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.13.2 基金托管人:基金托管人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.14 基金管理人及基金托管人的基金其他事项

4.14.1 基金管理人:基金管理人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

4.14.2 基金托管人:基金托管人其他事项,包括基金资产的保管、估值、清算等。

丰和价值证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

7.4.1.2 债券交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年1月1日至2010年12月31日; 成交金额, 占当期债券成交总额的比例.

7.4.1.3 债券回购交易

Table with 4 columns: 关联方名称, 2011年1月1日至2011年12月31日, 2010年1月1日至2010年12月31日; 回购成交金额, 占当期债券回购成交总额的比例.

7.4.1.4 权证交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.1.5 支付关联方佣金

Table with 4 columns: 关联方名称, 当期佣金, 占当期佣金总额的比例, 期末应付佣金余额, 占期末应付佣金总额的比例.

7.4.1.6 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.7 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.8 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.9 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.10 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.11 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.12 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.13 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.14 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.15 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.16 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.17 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.18 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.19 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.20 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.21 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.22 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.23 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.24 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.25 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.26 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.27 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.28 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.29 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.30 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.31 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.32 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.33 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.34 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.35 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.36 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.37 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.38 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.39 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.40 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.41 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.42 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.43 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.44 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.45 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.46 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.47 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.48 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.49 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.50 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.51 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.52 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.53 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.54 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.55 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.56 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.57 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.1.58 关联方交易

注:本期(2011年1月1日至2011年12月31日),本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读披露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 累计买入金额前20名的股票明细

Table with 6 columns: 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(%)

8.4.2 累计卖出金额前20名的股票明细

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 本期累计卖出金额, 占期初基金资产净值比例(%)

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本-成交总额, 6,116,769,897.51

8.4.4 卖出股票的成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.5 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.6 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.7 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.8 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.9 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.10 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.11 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.12 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.13 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.14 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.15 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.16 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.17 买入股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.18 卖出股票成本-成交总额, 6,206,308,521.52

8.4.19 买入股票成本-成交总额, 6,206