

丰和价值证券投资基金

2006 年年度报告摘要

\$1 告知事项
基金管理人的董事会及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责任。本基金报告已经全部独立董事签字确认，并由董事长签章。

基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定，于2007年3月29日复核了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、投资组合报告等内容，保证这些内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

基金经理的过往业绩并不代表未来表现，投资者在作出投资决策前应仔细阅读该读本基金的招募说明书。

本报告中的财务数据未经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留审慎性的审计报告。

本年度报告摘要请见年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

\$2 基金简介

2.1 基金的基本资料

(1) 基金名称	丰和价值证券投资基金
(2) 基金简称	丰和丰和
(3) 基金交易代码	184721
(4) 基金运作方式	契约型封闭式
(5) 基金合同生效日	2002年3月22日
(6) 报告期末基金份额总额	30亿份
(7) 基金合同存续期	15年
(8) 基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
(9) 上市日期	2002年4月4日

2.2 基金产品说明

(1) 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、成长特征的基金所规定的股票型基金，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。

(2) 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，在综合宏观经济情况、政策影响、证券市场走势等多种因素的基础上，确定基金在股票、债券的比例，坚持价值型投资理念，确立以相对价值判断为核心，兼顾对公司在价值评价上的选股思路；同时，以基本面分析为基础，重视数量分析，系统考察上市公司投资价值，最终确定所投资的股票，并以技术分析帮助个股投资的时机选择。

(3) 业绩比较基准

无

(4) 风险收益特征

无

2.3 基金管理人

(1) 名称

嘉实基金管理有限公司

(2) 注册地址

上海市浦东新区富城路99号震旦国际大楼1702室

(3) 办公地址

北京市建国门北大街8号华润大厦A座(100005)

(4) 互联网网址

http://www.jsfundcn

(5) 法定代表人

王忠民

(6) 总经理

赵学军

(7) 信息披露负责人

胡明娟

(8) 联系电话

(010) 65188866

(9) 传真

(010) 65189678

(10) 电子邮箱

service@sfundcn

2.4 基金托管人

(1) 名称

中国农业银行

(2) 注册地址

北京市西三环北路100号金玉大厦7-8层(100037)

(3) 办公地址

北京市西三环北路100号金玉大厦7-8层(100037)

(4) 互联网网址

http://www.abchina.com

(5) 法定代表人

杨晓生

(6) 托管部门总经理

张国洲

(7) 信息披露负责人

李芳菲

(8) 联系电话

(010) 68424199

(9) 传真

(010) 68424181

(10) 电子邮箱

lifangj@abchina.com

2.5 信息披露

《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2.6 登载年度报告的管理人

http://www.jsfundcn

2.7 登载年度报告备查地点

北京市建国门北大街8号华润大厦B座嘉实基金管理有限公司

3.3 基金财务指标、基金净值表现及费用情况

下述基金财务指标不包括持有人认购、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。

3.1 主要财务指标

单位：元

序号	项目	2006年	2005年	2004年
1	基金本期总收益	1,580,697,037.50	-11,166,215.30	127,840,194.57
2	基金本期利润	0.5269	-0.0037	0.0046
3	期末可供分配基金份额	0.4284	0.0196	0.0236
4	期末基金资产净值	6,218,936,747.24	3,140,835,532.00	3,064,756,282.59
5	期末基金资产净值增长率	207.6%	104.9%	102.6%
6	本期基金资产净值增长率	115.8%	44.6%	-25.7%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

单位：元

阶段	净增长百分比	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
过去三个月	42.2%	22%	①
过去六个月	55.17%	23%	②
过去一年	115.8%	22%	③
过去三年	119.6%	23%	④
自基金成立以来	133.6%	21%	⑤

3.2.2 基金份额净值表现与同期业绩比较基准的变动比较

图1：基金总收益和累计的净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势图

(2002年3月22日至2006年12月31日)

注：因基金合同没有规定业绩比较基准，所以基金净值表现未与同期业绩比较基准进行比较。

3.2.3 本基金合同有效以来的净值增长率与同期业绩比较基准的收益的折价/溢价率

图2：基金净值增长率与业绩比较历史收益对比图

(2002年3月22日至2006年12月31日)

注：因基金合同没有规定业绩比较基准，所以基金净值表现未与同期业绩比较基准进行比较。

3.3 过三年每年的基金收益分配情况

单位：元

年度	每10份基金份额分红数(元)	备注
2006年	1.000	2006年9月1日实施
2005年	0.190	2006年4月13日实施
2004年	0.200	2005年4月6日实施
合计	1.390	

3.4 基金费用

4.1 基金管理人及其他基金费用

本基金费用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人之一，注册资本1亿元，注册地在北京，并在深圳、成都设有分公司。

公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理资格，2006年公司从新股东获得企业年金资产管理(亚洲)有限公司的委托，一注资本金1亿元，注册地在北京，公司总部设在北京，并在深圳、成都设有分公司。

公司获得首批企业年金投资管理资格，2006年公司从新股东获得企业年金资产管理(亚洲)有限公司的委托，一注资本金1亿元，注册地在北京，公司总部设在北京，并在深圳、成都设有分公司。

公司获得首批企业年金投资管理资格，2006年公司从新股东获得企业年金资产管理(亚洲)有限公司的委托，一注资本金1亿元，注册