丰和价值证券投资基金 2008年半年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司　　基金托管人:中国建设银行股份有限公司

§1 重要提示

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根据本基金合同规定,于2008年8月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期为2008年1月1日起至2008年6月30日止,本报告财务资料未经审计。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。

§2 基金简介

2.1 基金基本资料

(1)基金名称	丰和价值证券投资基金
(2)基金简称	基金丰和
(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。
(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。
(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)信息披露负责人	胡勇钦
(3)联系电话	(010)65188866
(4)传真	(010)65185678
(5)电子邮箱	service@jsfund.cn

2.4 基金托管人

(1)名称	中国农业银行
(2)信息披露负责人	李芳菲
(3)联系电话	(010)68424199
(4)传真	(010)68424181
(5)电子邮箱	lifangfei@abchina.com

2.5 信息披露

(1)信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
(2)登载半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
(3)基金半年度报告置备地点	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

下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。

3.1 主要财务指标

序号	项目	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	-1,944,283,484.96
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-846,310,984.54
3	加权平均基金份额本期利润	-0.6481
4	期末可供分配利润	-670,605,325.79
5	期末可供分配基金份额利润	-0.2235
6	期末基金资产净值	2,329,394,674.21
7	期末基金份额净值	0.7765
8	加权平均净值利润率	-33.61%
9	本期基金份额净值增长率	-27.02%
10	份额累计净值增长率	253.14%

注:执行新会计准则后财务指标披露方面的主要变化

(1)增加"本期利润"指标,新会计准则实施之前相关期间内本指标的计算方法为当期净收益加上当期因对金融资产进行估值产生的未实现利得变动额。原"本期净收益"名称调整为"本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额"。

(2)原"加权平均份额本期净收益"名称调整为"加权平均份额本期利润",计算方法在原"加权平均基金份额本期净收益"公式($S_0+\sum_{i=1}^{n}\frac{\Delta S_i\times(n-i)}{n}$)的基础上,将P改为本期利润。原"加权平均净值收益率"名称调整为"加权平均净值利润率",计算方法在原公式的基础上,将P改为本期利润。

(3)原"期末可供分配收益"名称调整为"期末可供分配利润",如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。原"期末可供分配份额收益"名称调整为"期末可供分配份额利润",计算公式相应调整。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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	-11.54%	3.72%				
过去三个月	-12.63%	4.72%				
过去六个月	-27.02%	4.04%				
过去一年	-12.53%	3.64%				
过去三年	244.31%	3.01%				
自基金合同生效起至今	253.14%	2.59%				

3.2.2 本基金合同生效以来基金份额净值变动情况,及与同期业绩比较基准的变动比较

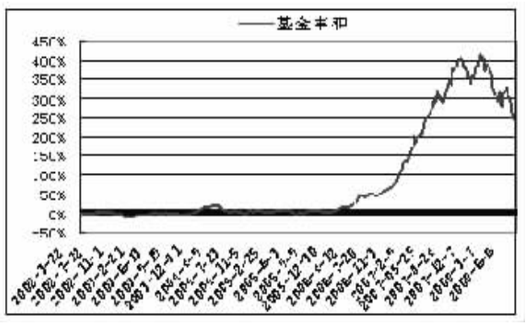

图:丰和基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2002年3月22日至2008年6月30日)

注:因基金合同中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。

§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,注册资本1亿元,注册地上海,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2008年6月30日,基金管理人共管理2只封闭式基金、13只开放式基金,具体包括基金泰和、基金丰和、嘉实成长收益基金、嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金、嘉实服务增值行业基金、嘉实优质企业基金(原嘉实浦安保本基金转型)、嘉实货币市场基金、嘉实沪深300指数基金、嘉实超短债基金、嘉实主题精选基金、嘉实策略增长基金、嘉实海外中国股票基金和嘉实研究精选基金,其中嘉实增长基金、嘉实稳健基金、嘉实债券基金3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金。同时,管理多个全国社保基金、企业年金基金、特定资产投资组合。

4.1.2 基金经理简介

王鹏先生,硕士研究生,5年证券、基金从业经历。曾任职于UBS公司中国研究部,2004年12月至今任职于嘉实基金管理有限公司,历任行业研究员、社保组合基金经理。2007年7月21日起任本基金基金经理。

4.2 报告期内基金运作的遵规守信情况说明

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、《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 公平交易专项说明

报告期内,本基金严格执行中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,无发生异常交易行为;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。

4.4 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

截至报告期末本基金份额净值为0.7765元,本报告期基金份额净值增长率为-27.02%。

报告期内,A股市场出现了大幅回调,沪深300指数今年一季度下跌幅度达到了29%,第二季度跌幅达到了26.35%。在巨大的市场下跌中,资产配置成为报告期内基金业绩分化的主要决定因素。从行业配置来看,通货膨胀背景下的上游资源品、医药等消费行业,以及在国际农产品价格大幅上涨的背景下,农业相关公司的表现相对强势,其他的绝大部分个股均出现大幅下跌。

今年第一季度,本基金为了准备2007年度的大额分红,从3月份开始逐步进行了减仓,由于分红金额相对组合净值而言比例巨大,在减仓过程中我们必须兼顾收益性要求和流动性要求,给本基金的操作带来了较大困难。在第二季度中我们对大额分红后的本基金组合进行了优化,在行业配置层面和个股配置层面进行了调整。我们充分利用了此次市场调整机会,买入一些基本面优秀且估值水平趋于合理的个股。

4.5 宏观经济、证券市场及行业走势简要展望

展望下半年,由于投资者的悲观情绪和宏观经济情况在短期内很难明朗,市场的估值水平很难得到所有投资者的认同,预计第三季度市场将依旧出现较大波动。下半年我们将保持本基金组合的行业结构和重点持仓品种的基本稳定,加强基本面研究,坚持自下而上的选股思路,力争获得更高的超额收益。

§5 托管人报告

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2008年1月1日至2008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。

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。

本托管人认为,丰和价值证券投资基金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。

中国农业银行托管业务部

2008年8月20日

§6 财务会计报告

6.1 基金会计报表

以下各项除特别注明外,金额单位为人民币元。

6.1.1 资产负债表

资产	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
银行存款		194,221,959.58	357,114,627.30
结算备付金		9,428,949.37	21,045,724.73
存出保证金		1,160,000.00	1,160,000.00
交易性金融资产	5.2.4(1)	2,102,634,036.17	8,724,889,557.24
其中:股票投资		1,544,463,058.67	6,810,084,472.94
债券投资		558,170,977.50	1,914,805,084.30
资产支持证券			
衍生金融资产	5.2.4(2)	956,349.80	31,400.18
买入返售金融资产			
应收证券清算款		22,755,122.69	
应收利息	5.2.4(3)	7,471,878.25	27,769,114.75
应收股利			
待摊费用		2,007,272.81	
其他资产			
资产总计		2,340,635,568.67	9,132,010,424.20
负债和所有者权益			
负债			
短期借款			
交易性金融负债			
衍生金融负债			
卖出回购金融资产款			
应付证券清算款			119,723,462.24
应付管理人报酬		2,989,687.50	10,885,415.16
应付托管费		498,281.25	1,814,235.84
应付交易费用	5.2.4(4)	5,429,307.41	13,678,201.97
应交税费		1,339,904.82	1,339,904.82
应付利息	5.2.4(5)		
应付利润			
其他负债	5.2.4(6)	983,713.48	891,045.00
负债合计		11,240,894.46	148,332,265.03
所有者权益			
实收基金	5.2.4(7)	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润		-670,605,325.79	5,983,678,159.17
所有者权益合计		2,329,394,674.21	8,983,678,159.17
负债和所有者权益总计		2,340,635,568.67	9,132,010,424.20
附注:基金份额总额(份)		3,000,000,000	3,000,000,000
基金份额净值		0.7765	2.9946

6.1.2 利润表

项目	附注	本期	上年同期
一、收入			
1.利息收入		22,719,748.88	25,342,910.71
其中:存款利息收入		1,727,968.36	1,564,033.14
债券利息收入		20,717,440.63	23,778,877.57
资产支持证券利息收入			
买入返售金融资产收入		274,339.89	
2.投资收益		-726,359,899.09	3,807,834,323.65
其中:股票投资收益	5.2.4(8)	-738,098,823.91	3,711,298,371.09
债券投资收益	5.2.4(9)	-4,842,136.04	30,548,667.20
资产支持证券投资收益			
衍生工具收益	5.2.4(10)	4,564,666.19	14,530,416.23
股利收益		12,016,394.67	51,456,869.13
3.公允价值变动收益	5.2.4(11)	-1,097,972,500.42	520,052,331.82
4.其他收入	5.2.4(12)		
收入合计		-1,801,612,650.63	4,353,229,566.18
二、费用			
1.管理人报酬		42,995,913.38	59,619,563.37
2.托管费		7,169,074.83	9,936,593.97
3.交易费用	5.2.4(13)	86,163,354.29	36,623,133.94
4.利息支出		5,101,051.16	7,271,348.13
其中:卖出回购金融资产支出		5,101,051.16	7,271,348.13
5.其他费用	5.2.4(14)	1,241,440.67	1,244,141.39
费用合计		142,670,834.33	114,694,780.80
利润总额		-1,944,283,484.96	4,238,534,785.38

6.1.3 所有者权益(基金净值)变动表

项目	本期		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	5,983,678,159.17	8,983,678,159.17
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)		-1,944,283,484.96	-1,944,283,484.96
本期基金份额交易产生的基金净值变动数			
其中:基金申购款			
基金赎回款			
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		-4,710,000,000.00	-4,710,000,000.00
期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	-670,605,325.79	2,329,394,674.21
项目	上年同期		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	3,218,936,747.24	6,218,936,747.24
本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)		4,239,395,765.70	4,239,395,765.70
本期基金份额交易产生的基金净值变动数			
其中:基金申购款			
基金赎回款			
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数		1,170,000,000.00	1,170,000,000.00
期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	6,288,332,512.94	9,288,332,512.94

6.2 半年度会计报表附注

6.2.1 会计政策、会计估计及其变更

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度7月1日至12月31日会计报表一致。自2007年7月1日起,本基金执行新企业会计准则(财政部2006年2月15日颁布)、《证券投资基金会计核算业务指引》(中国证券业协会2007年5月15日颁布)以及修改后的本基金基金合同和中国证监会允许的基金行业实务操作的相关规定。本基金按照《企业会计准则第38号-首次执行企业会计准则》的相关规定,对2007年1月1日起至2007年6月30日止期间的财务报表予以追溯调整。

按新会计准则调整原会计准则的所有者权益及净损益

项目	2007年年初所有者权益	2007-1-1至2007-6-30净收益/利润总额	2007年上半年末所有者权益
按原会计准则列报的金额	6,218,936,747.24	3,718,482,453.56	9,288,332,512.94
金融资产公允价值变动的调整数		520,052,331.82	
按新会计准则列报的金额	6,218,936,747.24	4,238,534,785.38	9,288,332,512.94

6.2.2 重大会计差错内容和更正金额

本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.2.3 关联方关系及关联方交易

(一)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	基金发起人、基金管理人
中国农业银行	基金托管人
中诚信托有限责任公司	基金发起人、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	同受重大影响的公司
吉林省信托投资有限责任公司	基金发起人
北京证券有限责任公司	基金发起人
广发证券股份有限公司	基金发起人

(二)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(金额单位:人民币元)。

1.通过关联方席位进行的交易

	本期		上年同期	
	成交量	占本年成交量的比例	成交量	占本年成交量的比例
国都证券:				
买卖股票	5,802,782,108.53	24.43%		
买卖债券	522,944,871.20	88.14%		
	佣金	占本年佣金总量的比例	佣金	占本年佣金总量的比例
国都证券	7,328,532.75	32.86%		

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、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。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。

2.关联方报酬

(1)基金管理费

支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理费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。计算公式:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

本基金本报告期需支付基金管理费42,995,913.38元(上年同期:59,619,563.37元)。

(2)基金托管费

支付基金托管人中国农业银行的基金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。计算公式:日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

本基金本报告期需支付基金托管费7,169,074.83元(上年同期:9,936,593.97元)。

3.与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金与基金托管人中国农业银行通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易如下(单位:元):

项目	本期	上年同期
买入债券结算金额		10,185,946.58
卖出债券结算金额	77,620,936.39	
卖出回购证券结算金额		
卖出回购证券利息支出		

4.由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,基金托管人于2008年6月30日保管的银行存款余额为194,221,959.58元(2007年6月30日:1,463,141,561.98元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为1,431,634.25元(上年同期:1,448,391.95元)。

5.关联方投资本基金情况

(1)基金管理人投资本基金情况

项目	本期			上年同期		
	数量(份)	占基金总份额比例	适用费率	数量(份)	占基金总份额比例	适用费率
报告期期初持有基金份额	12,010,000	0.40%		12,010,000	0.40%	
报告期间买入基金份额						
报告期间卖出基金份额						
报告期末持有基金份额	12,010,000	0.40%		12,010,000	0.40%	

(2)基金管理人主要股东投资本基金情况

持有人名称	本期		上年同期	
	期末持有基金份额(份)	占基金总份额的比例	期末持有基金份额(份)	占基金总份额的比例
中诚信托有限责任公司	6,000,000	0.20%	6,000,000	0.20%

(3)基金管理人主要股东中诚信托有限责任公司控制的机构投资本基金情况:无

6.2.4 报告期末流通转让受到限制的基金资产

以下各项除特别注明外,金额单位为人民币元。

(1)报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的股票

序号	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(股)	期末成本总额	期末估值总额
1	002223	鱼跃医疗	08-04-10	08-07-18	新股流通受限	9.48	20.00	19,071	180,793.08	381,420.00
2	002227	奥特迅	08-04-24	08-08-06	新股流通受限	14.37	14.05	24,134	346,805.58	339,082.70
3	002228	合兴包装	08-04-24	08-08-08	新股流通受限	10.15	10.74	26,049	264,397.35	279,766.26
4	002229	鸿博股份	08-04-24	08-08-08	新股流通受限	13.88	13.58	19,853	275,559.64	269,603.74
5	002230	科大讯飞	08-04-29	08-08-12	新股流通受限	12.66	30.09	17,585	222,626.10	529,132.65
6	002231	奥维通信	08-04-29	08-08-12	新股流通受限	8.46	8.50	21,837	184,741.02	185,614.50
7	002232	启明信息	08-04-29	08-08-11	新股流通受限	9.44	12.65	23,382	220,726.08	295,782.30
8	002233	塔牌集团	08-05-08	08-08-18	新股流通受限	10.03	9.70	81,297	815,408.91	788,580.90
9	002234	民和股份	08-05-08	08-08-18	新股流通受限	10.61	20.24	16,147	171,319.67	326,815.28
10	002238	天威视讯	08-05-14	08-08-26	新股流通受限	6.98	12.25	39,463	275,451.74	483,421.75
11	002239	金飞达	08-05-14	08-08-22	新股流通受限	9.33	8.98	26,180	244,259.40	235,096.40
12	002242	九阳股份	08-05-20	08-08-28	新股流通受限	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
13	002243	通产丽星	08-05-20	08-08-28	新股流通受限	7.78	8.02	39,414	306,640.92	316,100.28
14	002245	澳洋顺昌	08-05-28	08-09-05	新股流通受限	16.38	16.02	10,566	173,071.08	169,267.32
15	002249	大洋电机	08-06-10	08-09-19	新股流通受限	25.60	24.21	29,830	763,648.00	722,184.30
16	002250	联化科技	08-06-10	08-09-19	新股流通受限	10.52	12.80	26,001	273,530.52	332,812.80
17	000401	冀东水泥	08-06-30	09-07-01	非公开发行流通受限	11.83	11.83	2,000,000	23,660,000.00	23,660,000.00
合计									29,449,358.61	31,235,095.90

报告期末本基金持有的因认购新发或增发而流通受限的债券、权证:无

(2)报告期末本基金持有的暂时停牌股票:无

(3)报告期末债券正回购交易中作为质押的债券:无

§7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	1,544,463,058.67	65.98%
债券	558,170,977.50	23.85%
权证	956,349.80	0.04%
资产支持证券		
银行存款及清算备付金合计	203,650,908.95	8.70%
其他资产	33,394,273.75	1.43%
合计	2,340,635,568.67	100%

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	股票市值(元)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	816,315.28	0.04%
B 采掘业	307,427,597.37	13.20%
C 制造业	624,844,963.15	26.82%
C0 食品、饮料	200,517,047.56	8.61%
C1 纺织、服装、皮毛	49,405,211.13	2.12%
C2 木材、家具		
C3 造纸、印刷	18,637,370.00	0.80%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	681,793.08	0.03%
C5 电子	203,157.80	0.01%
C6 金属、非金属	24,448,580.90	1.05%
C7 机械、设备、仪表	156,565,844.68	6.72%
C8 医药、生物制品	174,356,658.00	7.49%
C99 其他制造业	29,300.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业		
E 建筑业		
F 交通运输、仓储业	72,509,005.50	3.11%
G 信息技术业	4,766,529.45	0.20%
H 批发和零售贸易	83,063,609.32	3.57%
I 金融、保险业	164,184,811.50	7.05%
J 房地产业	36,750,000.00	1.58%
K 社会服务业	249,531,055.35	10.71%
L 传播与文化产业	569,171.75	0.02%
M 综合类		
合计	1,544,463,058.67	66.30%

7.3 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票简称	数量(股)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	000538	云南白药	6,436,200	174,356,658.00	7.49%
2	601318	中国平安	3,333,025	164,184,811.50	7.05%
3	000069	华侨城A	15,555,073	157,261,788.03	6.75%
4	000895	双汇发展	3,000,065	111,902,424.50	4.80%
5	600054	黄山旅游	6,000,000	92,100,000.00	3.95%
6	002242	九阳股份	2,222,222	89,866,657.68	3.86%
7	600519	贵州茅台	600,080	83,159,086.40	3.57%
8	000061	农产品	4,099,882	83,063,609.32	3.57%
9	600583	海油工程	3,699,985	80,622,673.15	3.46%
10	600547	山东黄金	1,500,013	77,325,670.15	3.32%

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(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

(1)报告期内累计买入价值前20名的股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600015	华夏银行	1,225,848,118.45	13.65%
2	601186	中国铁建	686,710,484.50	7.64%
3	600019	宝钢股份	661,153,150.59	7.36%
4	600050	中国联通	485,876,075.01	5.41%
5	601318	中国平安	363,635,167.79	4.05%
6	600036	招商银行	327,661,458.56	3.65%
7	000878	云南铜业	298,598,799.70	3.32%
8	600547	山东黄金	260,058,299.03	2.89%
9	000895	双汇发展	240,981,943.49	2.68%
10	601601	中国太保	230,167,618.21	2.56%
11	600054	黄山旅游	221,445,435.02	2.46%
12	000061	农产品	199,709,078.39	2.22%
13	000951	中国重汽	173,077,930.25	1.93%
14	000069	华侨城A	159,364,273.68	1.77%
15	600859	王府井	153,168,276.93	1.70%
16	000002	万科A	144,552,631.02	1.61%
17	600761	安徽合力	142,903,069.20	1.59%
18	000538	云南白药	139,849,985.92	1.56%
19	600519	贵州茅台	133,276,512.14	1.48%
20	000001	深发展A	130,193,354.46	1.45%

(2)报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的所有股票明细

序号	股票代码	股票简称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	952,111,798.55	10.60%
2	600015	华夏银行	903,557,668.50	10.06%
3	600019	宝钢股份	704,064,524.57	7.84%
4	600383	金地集团	689,961,286.18	7.68%
5	601186	中国铁建	627,252,761.43	6.98%
6	600050	中国联通	461,985,309.73	5.14%
7	000063	中兴通讯	444,517,524.78	4.95%
8	000061	农产品	398,430,502.44	4.44%
9	601390	中国中铁	397,209,573.47	4.42%
10	000792	盐湖钾肥	384,639,029.10	4.28%
11	000069	华侨城A	334,740,279.67	3.73%
12	000651	格力电器	314,321,220.03	3.50%
13	000878	云南铜业	297,622,457.22	3.31%
14	000423	东阿阿胶	294,442,183.79	3.28%
15	601318	中国平安	264,739,314.44	2.95%
16	600428	中远航运	251,840,008.43	2.80%
17	000538	云南白药	245,898,332.43	2.74%
18	600123	兰花科创	217,150,188.10	2.42%
19	600858	银座股份	208,398,692.98	2.32%
20	601601	中国太保	195,566,234.15	2.18%
21	000568	泸州老窖	187,439,937.61	2.09%

(3)报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额(元)	卖出股票收入总额(元)
10,201,617,918.36	13,627,520,918.59

7.5 报告期末按券种分类的债券投资组合

债券品种	市值(元)	市值占基金资产净值比例
国债	9,233,742.20	0.40%
金融债	123,356,400.00	5.30%
央行票据	420,792,000.00	18.06%
企业债	1,642,159.00	0.07%
可转换债券	3,146,676.30	0.13%
资产支持证券		
其他		
合计	558,170,977.50	23.96%

7.6 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券简称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	0801032	08央行票据32	99,910,000.00	4.29%
2	0801038	08央行票据38	99,890,000.00	4.29%
3	0801049	08央行票据49	96,080,000.00	4.12%
4	050221	05国开21	48,860,000.00	2.10%
5	0801016	08央行票据16	48,045,000.00	2.06%

7.7 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	580021	青啤CWB1	956,349.80	0.04%

7.8 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细:无

7.9 投资组合报告附注

(1)报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(2)本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

(3)其他资产构成

序号	项目	期末余额(元)
1	存出保证金	1,160,000.00
2	应收证券清算款	22,755,122.69
3	应收股利	
4	应收利息	7,471,878.25
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	2,007,272.81
8	其他	
合计		33,394,273.75

(4)持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	110078	澄星转债	1,484,941.50	0.06%
2	125960	银业转债	1,661,734.80	0.07%

(5)报告期内获得的权证资产

序号	权证代码	权证简称	数量(份)	成本总额(元)	类别(被动持有或主动投资)
1	580017	赣粤CWB1	445,137	1,831,811.69	被动持有
2	580018	中远CWB1	500,878	3,093,514.91	被动持有
3	580019	石化CWB1	9,299,070	21,537,348.47	被动持有
4	580021	青啤CWB1	160,300	483,758.57	被动持有

§8 基金份额持有人情况

8.1 报告期末基金份