

丰和价值证券投资基金

[2013] 年度报告摘要

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:2014年3月26日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、监事会对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、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。

本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2014年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置等内容，对年度报告的整体内容表示同意。

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摘要。

本报告期报告期为2013年1月1日起至2013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，应阅读年度报告全文。

§ 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 丰和丰和价值证券投资基金(场内简称:基金丰和)

基金主代码 184721

基金运作方式 约定封闭式

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

报告期本基金份额总额 3,000,000,000.00份

基金合同存续期 15年

基金上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2002-04-04

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法规组成、成长性好、盈利能力强的股票，通过基金资产的合理配置，在控制风险的前提下，追求基金资产的长期增值。

本基金采用“自下而上”相结合的选股方法，综合考虑宏观经济情况、政策取向、证券市场走势等多钟因素的分析，确定基金在股票、债券上的资产比例。

本基金的投资策略是：在综合考虑宏观经济情况、政策取向、证券市场走势等多钟因素的分析，确定基金在股票、债券上的资产比例的基础上，通过定期调整资产配置比例，实现基金资产的长期增值。

本基金将通过深入研究，精选具有投资价值、最能确定其所投股票，并以技术分析帮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 姚欣勇 李芳菲

联系电话 (010)65215588 (010)66000609

电子邮箱 service@fund.jrfund.com lifangfei@abcchina.com

客户服务电话 400-800-8800 95599

传真 (010)65182266 (010)63201816

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.jrfund.cn

基金年度报告备置地点 北京市建国门北大街9号华润大厦A座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 2013年末 2012年末 2011年末

本期已实现收益 243,432,187.06 -181,001,493.69 -263,918,831.26

本期利润 439,883,171.02 113,568,143.70 -973,334,379

加权平均基金份额本期利润 0.1466 0.0379 -0.3244

本期平均净值利润率 14.29% 4.18% -31.06%

本期基金份额净值增长率 15.92% 4.29% -26.59%

3.1.2 期末数据和指标 2013年末 2012年末 2011年末

期末可供分配基金份额 -187,343,774.31 -430,775,961.37 -350,252,239.22

期末可供分配基金份额 -0.6624 -0.1436 -0.1168

期末基金资产净值 3,203,199,075.50 2,763,315,904.48 2,649,747,760.78

期末基金份额净值 1.0677 0.9211 0.9832

3.1.3 累计期末指标 2013年末 2012年末 2011年末

基金份额累计净值增长率 405.04% 335.70% 317.77%

注:(1)本期已实现收益指基金本期收入，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，本期已实现收益加上本期平均净值益后，(2)当期基金净值益不包括本期可供分配的利润，即基金的未实现收益，以实现收益水平为所列数字；(3)期末可供分配基金份额益的平均数(即1/(期末基金总份额+本期利润)/2)。

3.2 基金的基本情况

3.2.1 基金份额净值增长率为与其同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 份额净值增长率为基 业绩比较基 准收益率(%)

份额净值增长率为基 业绩比较基 准收益率(%)

份额净值增长率为基 业绩比较基 准收益率(%)

过去三个月 -0.27% 2.38%

过去六个月 7.59% 2.11%

过去一年 15.92% 2.17%

过去三年 -11.25% 2.18%

自基金合同生 59.43% 2.49%

效起至今 405.04% 2.61%

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

(2002年3月22日至2013年12月31日)

图:嘉实丰和价值证券投资基金成立以来基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

注:按基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起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(第十九部分)规定的各项有关要求。(1)本基金投资组合的比例，债券投资比重不高于基金资产净值的10%，股票投资组合的平均市值不低于基金总资产的80%，并不得超过基金总资产的95%，不超过基金净资产的10%；(4)本基金投资组合的平均B/P值高于沪深A股市场的平均B/P值；(5)遵守中国证监会规定的其他比例限制。

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

(2002年3月22日至2013年12月31日)

图:嘉实丰和价值证券投资基金成立以来每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

注:按基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起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(第十九部分)规定的各项有关要求。(1)本基金投资组合的比例，债券投资比重不高于基金资产净值的10%，股票投资组合的平均市值不低于基金总资产的80%，并不得超过基金总资产的95%，不超过基金净资产的10%；(4)本基金投资组合的平均B/P值高于沪深A股市场的平均B/P值；(5)遵守中国证监会规定的其他比例限制。

3.2.4 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

(2002年3月22日至2013年12月31日)

图:嘉实丰和价值证券投资基金成立以来每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

注:按基金合同约定，本基金自基金合同生效之日起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(第十九部分)规定的各项有关要求。(1)本基金投资组合的比例，债券投资比重不高于基金资产净值的10%，股票投资组合的平均市值不低于基金总资产的80%，并不得超过基金总资产的95%，不超过基金净资产的10%；(4)本基金投资组合的平均B/P值高于沪深A股市场的平均B/P值；(5)遵守中国证监会规定的其他比例限制。

3.2.5 基金的资产配置

3.2.5.1 基金资产配置

3.2.5.2 基金资产配置

3.2.5.3 基金资产配置

3.2.5.4 基金资产配置

3.2.5.5 基金资产配置

3.2.5.6 基金资产配置

3.2.5.7 基金资产配置

3.2.5.8 基金资产配置

3.2.5.9 基金资产配置

3.2.5.10 基金资产配置

3.2.5.11 基金资产配置

3.2.5.12 基金资产配置

3.2.5.13 基金资产配置

3.2.5.14 基金资产配置

3.2.5.15 基金资产配置

3.2.5.16 基金资产配置

3.2.5.17 基金资产配置

3.2.5.18 基金资产配置

3.2.5.19 基金资产配置

3.2.5.20 基金资产配置

3.2.5.21 基金资产配置

3.2.5.22 基金资产配置

3.2.5.23 基金资产配置

3.2.5.24 基金资产配置

3.2.5.25 基金资产配置

3.2.5.26 基金资产配置

3.2.5.27 基金资产配置

3.2.5.28 基金资产配置

3.2.5.29 基金资产配置

3.2.5.30 基金资产配置

3.2.5.31 基金资产配置

3.2.5.32 基金资产配置

3.2.5.33 基金资产配置

3.2.5.34 基金资产配置

3.2.5.35 基金资产配置

3.2.5.36 基金资产配置

3.2.5.37 基金资产配置

3.2.5.38 基金资产配置

3.2.5.39 基金资产配置

3.2.5.40 基金资产配置

3.2.5.41 基金资产配置

3.2.5.42 基金资产配置

3.2.5.43 基金资产配置

3.2.5.44 基金资产配置

3.2.5.45 基金资产配置

3.2.5.46 基金资产配置

3.2.5.47 基金资产配置

3.2.5.48 基金资产配置

3.2.5.49 基金资产配置

3.2.5.50 基金资产配置

3.2.5.51 基金资产配置

3.2.5.52 基金资产配置

3.2.5.53 基金资产配置

3.2.5.54 基金资产配置

3.2.5.55 基金资产配置

3.2.5.56 基金资产配置

3.2.5.57 基金资产配置

3.2.5.58 基金资产配置

3.2.5.59 基金资产配置

3.2.5.60 基金资产配置

3.2.5.61 基金资产配置

3.2.5.62 基金资产配置

3.2.5.63 基金资产配置