

嘉实服务增值行业证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9月30日

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2010年10月26日

重要提示
基金管理人及基金托管人本报告所载数据不存在虚假记载、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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年10月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现,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。

本报告自2010年7月1日起至2010年9月30日止。

基金产品概况

基金名称:嘉实服务增值行业混合
基金代码:070066
基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2004年4月1日
报告期末基金资产总额:1,954,424,191.27份

投资目标:在力争资产安全性和流动性前提下,通过长期稳健增值,实现基金资产的长期增值。

投资策略:本基金投资于具有良好发展前景的上市公司股票,并适当配置于固定收益类资产,以分散股票资产的风险,提高基金资产的流动性。

业绩比较基准:中证500指数收益率*80%+中国国债指数收益率*20%
风险收益特征:本基金属于中等风险证券投资基金

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

主要财务指标
单位:人民币元
1.本期已实现收益:254,912,083.44
2.本期利润:1,153,393,732.23

3.期末基金份额净值:1.0601
4.期末基金资产净值:7,882,871,963.98

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.上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 本报告期末基金份额净值及其与同期业绩比较基准收益率的比较
3.2 基金净值表现

过去三个月 17.25% 0.95% 15.34% 1.06% 1.91% -0.11%

基金业绩比较基准:中证500指数收益率*80%+中国国债指数收益率*20%

注:本基金基金合同的约定,本基金自合同生效日起6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八(二)项投资范围及(八)项投资组合比例限制的规定。

4.1 管理人承诺
4.2 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预示其未来表现,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。

4.3 公平交易专项说明
4.4 报告期内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系统等手段进行日常监控,公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.5 异常交易专项说明
4.6 报告期内,本基金未发生异常交易行为。

4.7 流动性风险分析
4.8 报告期内,本基金未发生流动性风险事件。

4.9 投资组合报告
4.10 报告期末基金资产组合情况

1.权益投资 6,326,665,715.38 78.23
2.固定收益投资 1,062,944,000.00 13.13

3.金融衍生品投资 -- --
4.买入返售金融资产 -- --

5.银行存款和结算备付金合计 623,891,952.28 7.72
6.其他资产 71,579,680.72 0.89

7.负债合计 8,085,081,348.38 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

A 农林牧渔 71,105,315.40 0.89
B 采掘业 541,956,348.83 6.79

C 制造业 2,929,614,622.99 36.70
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 467,655,761.99 5.86

E 建筑业 16,990,809.08 0.21
F 交通运输、仓储业 0.73 0.01

G 信息技术 299,430,564.29 3.75
H 批发和零售业 288,957,940.95 3.58

I 金属、非金属 178,813,965.60 2.24
J 房地产业 699,112,482.31 8.76

K 社会服务业 -- --
L 综合类 605,487,463.43 7.57
M 其他制造业 316,591,717.84 3.97

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 -- --
E 建筑业 208,870,725.00 2.62

F 交通运输、仓储业 77,238,023.94 0.97
G 信息技术 677,645,668.01 8.49

H 批发和零售业 637,076,302.88 7.98
I 金属、非金属 969,895,927.20 12.15

J 房地产业 143,765,471.60 1.80
K 社会服务业 -- --

L 综合类 69,496,405.53 0.87
M 其他制造业 -- --

N 合计 6,326,665,715.38 79.23

报告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
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 601118 中国平安 7,927,727 49,297,481.03 5.23
2 600729 重庆百货 5,901,404 321,508,489.92 4.23

3 600225 联合集团 11,685,588 239,904,711.04 3.01
4 600406 国电南瑞 3,800,000 238,222,000.00 3.08

5 601166 兴业银行 8,156,809 188,585,424.08 2.36
6 600036 招商银行 12,975,953 168,038,591.35 2.16

7 600518 康美药业 8,257,366 154,082,449.56 1.93
8 002094 华邦制药 2,347,808 143,169,331.84 1.79

9 601169 北京银行 11,887,813 141,940,487.22 1.78
10 002410 广联达 2,568,786 133,576,872.00 1.67

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1011014 10国债01 3,800,000 380,874,000.00 4.77
2 1011130 10国债02 1,600,000 160,368,000.00 2.01

3 0810047 08央行票据47 1,400,000 101,380,000.00 1.27
4 0810117 08央行票据17 1,000,000 100,920,000.00 1.26

5 1011519 10国债03 900,000 90,144,000.00 1.13

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注
5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券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发生违法违规被处罚的情况。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成
序号 名称 金额(元)

1 存保证金 5,833,659.34
2 应收证券清算款 46,896,590.29

3 应收股利 -- --
4 应收利息 13,078,203.82

5 应收申购款 5,771,129.27
6 其他应收款 -- --

7 待摊费用 -- --
8 其他 -- --

9 合计 71,579,680.72

5.9 开放式基金份额变动
单位:份
本报告期初基金份额总额 1,814,624,359.31

本报告期间基金总申购份额 295,707,543.01
本报告期间基金总赎回份额 159,702,710.05

本报告期间基金净申购份额 136,004,832.96
本报告期末基金份额总额 1,954,424,191.27

注:报告期内基金申购赎回份额及红利分配数据,基金总申购份额含红利再投资份额,基金总赎回份额含赎回费用。

5.10 基金业绩比较基准
5.11 基金管理人承诺
5.12 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预示其未来表现,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。

5.13 公平交易专项说明
5.14 报告期内,本基金未发生异常交易行为。

5.15 流动性风险分析
5.16 报告期内,本基金未发生流动性风险事件。

5.17 投资组合报告
5.18 报告期末基金资产组合情况

1.权益投资 10,707,867,785.44 85.83
2.固定收益投资 10,707,867,785.44 85.83

3.金融衍生品投资 604,489,687.20 4.85
4.买入返售金融资产 604,489,687.20 4.85

5.银行存款和结算备付金合计 1,744,728.24 0.01
6.其他资产 -- --

7.负债合计 91,842,189.42 0.74
8.其他资产 91,842,189.42 0.74

9.合计 12,475,376,314.93 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600887 伊利股份 19,262,340 807,669,916.20 6.61
2 600476 江中制药 11,402,477 714,821,283.13 5.85

3 600750 江中药业 13,291,300 548,797,777.00 4.49
4 600079 人福医药 20,731,170 468,939,065.40 3.84

5 600518 康美药业 24,459,458 463,877,486.20 3.80
6 600570 恒生电子 27,989,511 455,949,134.19 3.73

7 000423 苏宁电器 8,002,217 394,349,253.76 3.23
8 000060 中金岭南 22,502,082 382,535,394.00 3.13

9 600118 中国卫星 13,965,617 380,423,407.00 3.12
10 600537 海通集团 10,156,602 355,481,070.00 2.91

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110008 11国债08 3,000,000 300,000,000.00 2.57
2 113001 11央行票据 1,364,000 206,825,374.00 1.69

3 0810126 08央行票据26 900,000 50,530,000.00 0.41
4 0810125 08央行票据25 300,000 29,412,000.00 0.24

5 126019 09央行票据 29,610 2,429,500.50 0.02

注:报告期内基金申购赎回份额及红利分配数据,基金总申购份额含红利再投资份额,基金总赎回份额含赎回费用。

5.1 基金业绩比较基准
5.2 基金管理人承诺
5.3 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预示其未来表现,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。

5.4 公平交易专项说明
5.5 报告期内,本基金未发生异常交易行为。

5.6 流动性风险分析
5.7 报告期内,本基金未发生流动性风险事件。

5.8 投资组合报告
5.9 报告期末基金资产组合情况

1.权益投资 10,707,867,785.44 85.83
2.固定收益投资 10,707,867,785.44 85.83

3.金融衍生品投资 604,489,687.20 4.85
4.买入返售金融资产 604,489,687.20 4.85

5.银行存款和结算备付金合计 1,744,728.24 0.01
6.其他资产 -- --

7.负债合计 91,842,189.42 0.74
8.其他资产 91,842,189.42 0.74

9.合计 12,475,376,314.93 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600887 伊利股份 19,262,340 807,669,916.20 6.61
2 600476 江中制药 11,402,477 714,821,283.13 5.85

3 600750 江中药业 13,291,300 548,797,777.00 4.49
4 600079 人福医药 20,731,170 468,939,065.40 3.84

5 600518 康美药业 24,459,458 463,877,486.20 3.80
6 600570 恒生电子 27,989,511 455,949,134.19 3.73

7 000423 苏宁电器 8,002,217 394,349,253.76 3.23
8 000060 中金岭南 22,502,082 382,535,394.00 3.13

9 600118 中国卫星 13,965,617 380,423,407.00 3.12
10 600537 海通集团 10,156,602 355,481,070.00 2.91

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110008 11国债08 3,000,000 300,000,000.00 2.57
2 113001 11央行票据 1,364,000 206,825,374.00 1.69

3 0810126 08央行票据26 900,000 50,530,000.00 0.41
4 0810125 08央行票据25 300,000 29,412,000.00 0.24

5 126019 09央行票据 29,610 2,429,500.50 0.02

注:报告期内基金申购赎回份额及红利分配数据,基金总申购份额含红利再投资份额,基金总赎回份额含赎回费用。

5.1 基金业绩比较基准
5.2 基金管理人承诺
5.3 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预示其未来表现,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。

5.4 公平交易专项说明
5.5 报告期内,本基金未发生异常交易行为。

5.6 流动性风险分析
5.7 报告期内,本基金未发生流动性风险事件。

5.8 投资组合报告
5.9 报告期末基金资产组合情况

1.权益投资 10,707,867,785.44 85.83
2.固定收益投资 10,707,867,785.44 85.83

3.金融衍生品投资 604,489,687.20 4.85
4.买入返售金融资产 604,489,687.20 4.85

5.银行存款和结算备付金合计 1,744,728.24 0.01
6.其他资产 -- --

7.负债合计 91,842,189.42 0.74
8.其他资产 91,842,189.42 0.74

9.合计 12,475,376,314.93 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600887 伊利股份 19,262,340 807,669,916.20 6.61
2 600476 江中制药 11,402,477 714,821,283.13 5.85

3 600750 江中药业 13,291,300 548,797,777.00 4.49
4 600079 人福医药 20,731,170 468,939,065.40 3.84

5 600518 康美药业 24,459,458 463,877,486.20 3.80
6 600570 恒生电子 27,989,511 455,949,134.19 3.73

7 000423 苏宁电器 8,002,217 394,349,253.76 3.23
8 000060 中金岭南 22,502,082 382,535,394.00 3.13

9 600118 中国卫星 13,965,617 380,423,407.00 3.12
10 600537 海通集团 10,156,602 355,481,070.00 2.91

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110008 11国债08 3,000,000 300,000,000.00 2.57
2 113001 11央行票据 1,364,000 206,825,374.00 1.69

3 0810126 08央行票据26 900,000 50,530,000.00 0.41
4 0810125 08央行票据25 300,000 29,412,000.00 0.24

5 126019 09央行票据 29,610 2,429,500.50 0.02

注:报告期内基金申购赎回份额及红利分配数据,基金总申购份额含红利再投资份额,基金总赎回份额含赎回费用。

5.1 基金业绩比较基准
5.2 基金管理人承诺
5.3 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预示其未来表现,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。

5.4 公平交易专项说明
5.5 报告期内,本基金未发生异常交易行为。

5.6 流动性风险分析
5.7 报告期内,本基金未发生流动性风险事件。

5.8 投资组合报告
5.9 报告期末基金资产组合情况

1.权益投资 10,707,867,785.44 85.83
2.固定收益投资 10,707,867,785.44 85.83

3.金融衍生品投资 604,489,687.20 4.85
4.买入返售金融资产 604,489,687.20 4.85

5.银行存款和结算备付金合计 1,744,728.24 0.01
6.其他资产 -- --

7.负债合计 91,842,189.42 0.74
8.其他资产 91,842,189.42 0.74

9.合计 12,475,376,314.93 100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合
序号 股票代码 股票名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 600887 伊利股份 19,262,340 807,669,916.20 6.61
2 600476 江中制药 11,402,477 714,821,283.13 5.85

3 600750 江中药业 13,291,300 548,797,777.00 4.49
4 600079 人福医药 20,731,170 468,939,065.40 3.84

5 600518 康美药业 24,459,458 463,877,486.20 3.80
6 600570 恒生电子 27,989,511 455,949,134.19 3.73

7 000423 苏宁电器 8,002,217 394,349,253.76 3.23
8 000060 中金岭南 22,502,082 382,535,394.00 3.13

9 600118 中国卫星 13,965,617 380,423,407.00 3.12
10 600537 海通集团 10,156,602 355,481,070.00 2.91

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
序号 债券代码 债券名称 数量(元) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 110008 11国债08 3,000,000 300,000,000.00 2.57
2 113001 11央行票据 1,364,000 206,825,374.00 1.69

3 0810126 08央行票据26 900,000 50,530,000.00 0.41
4 0810125 08央行票据25 300,000 29,412,000.00 0.24

5 126019 09央行票据 29,610 2,429,500.50 0.02

注:报告期内基金申购赎回份额及红利分配数据,基金总申购份额含红利再投资份额,基金总赎回份额含赎回费用。

5.1 基金业绩比较基准
5.2 基金管理人承诺
5.3 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预示其未来表现,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。

5.4 公平交易专项说明
5.5 报告期内,本基金未发生异常交易行为。

5.6 流动性风险分析
5.7 报告期内,本基金未发生流动性风险事件。