

嘉实服务增值行业证券投资基金 2009 年年度报告

2009 年 12 月 31 日

基金管理人： 嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2010 年 3 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、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更新。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式	4
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§6 审计报告	11
§7 年度财务报表	12
7.1 资产负债表	12
7.2 利润表.....	13
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14

7.4 报表附注	15
§8 投资组合报告	32
8.1 期末基金资产组合情况	32
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	33
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	43
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	43
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	44
8.9 投资组合报告附注	44
§9 基金份额持有人信息	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	44
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	44
§10 开放式基金份额变动	44
§11 重大事件揭示	45
11.1 基金份额持有人大会决议	45
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
11.4 基金投资策略的改变	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
11.8 其他重大事件	47
§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	51

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实服务增值行业证券投资基金
基金简称	嘉实服务增值行业混合
交易主代码	070006
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
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,544,658,566.01 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩比较基准,在追求长期稳定增长的同时不放弃短期收益。
投资策略	在全面评估证券市场现阶段的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率并制定资产配置比例的基础上,制订本基金资产在股票、债券和现金等大类资产的配置比例、调整原则和调整范围。同时,根据合适的定性、定量指标选择服务业及其他产业内具有竞争优势的上市公司所发行的股票,获取稳定的长期回报。
业绩比较基准	投资基准指数=中信综合指数×80%+中信国债指数×20%
风险收益特征	本基金属于中等风险证券投资基金

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010) 65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010) 65182266	(010) 66594942
注册地址	上海市浦东新区富城路 99 号 震旦国际大楼 1702 室	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市建国门北大街 8 号 华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100005 (办公地址)	100818
法定代表人	王忠民	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
----------------	------------------------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层 嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市卢湾区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	1,871,616,326.03	-2,237,210,936.36	5,679,637,342.55
本期利润	2,549,460,444.42	-4,250,925,450.73	5,788,851,942.36
加权平均基金份额本期利润	1.6337	-2.0983	2.3177
本期加权平均净值利润率	51.51%	-70.41%	65.54%
本期基金份额净值增长率	77.01%	-47.30%	125.61%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	3,791,625,154.27	1,964,009,445.83	6,099,936,659.51
期末可供分配基金份额利润	2.4547	1.1657	2.6281
期末基金资产净值	5,921,798,218.06	3,648,860,522.17	10,121,936,084.56
期末基金份额净值	3.834	2.166	4.361
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率	345.41%	151.63%	377.45%

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）所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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.93%	1.39%	18.19%	1.40%	-0.26%	-0.01%
过去六个月	16.15%	1.86%	15.05%	1.68%	1.10%	0.18%
过去一年	77.01%	1.73%	80.22%	1.63%	-3.21%	0.10%
过去三年	110.47%	1.96%	86.98%	2.01%	23.49%	-0.05%
过去五年	376.89%	1.68%	219.79%	1.71%	157.10%	-0.03%
自基金合同生效起至今	345.41%	1.59%	141.16%	1.65%	204.25%	-0.06%

注：本基金业绩比较基准为中信综合指数×80%+中信国债指数×20%。本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$Benchmark_0 = 1000$$

$$Return_t = 80\% \times (\text{中信综合指数}_t / \text{中信综合指数}_{t-1} - 1) + 20\% \times (\text{中信国债指数}_t / \text{中信国债指数}_{t-1} - 1)$$

$$Benchmark_t = (1 + Return_t) \times Benchmark_{t-1}$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

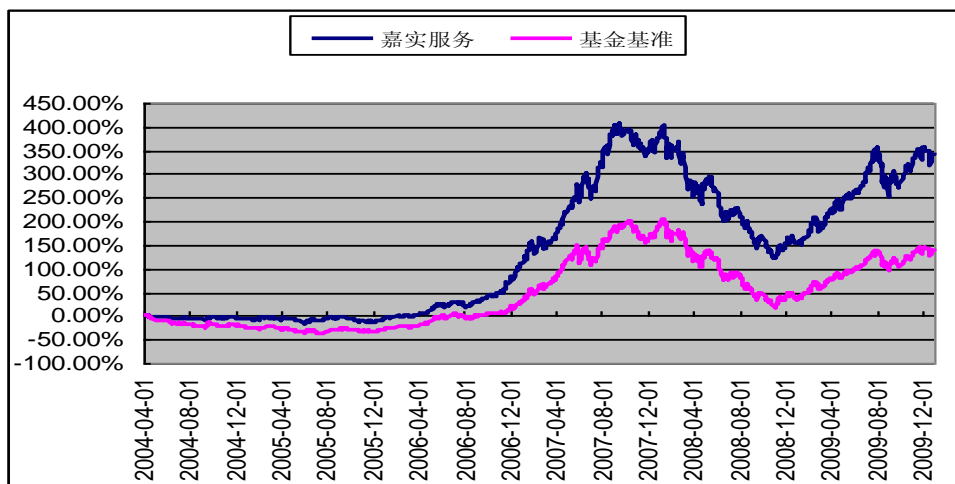


图 1：嘉实服务增值行业混合基金份额累计净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004 年 4 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)

注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第十八条（二）投资范围和（六）投资组合比例限制的约定：（1）在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围：股票资产 25%-95%；债券资产 0%-70%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中，基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的 80%。（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%。（3）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。（4）法律法规规定的其他限制。

3.2.3 过去五年以来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



图 2：嘉实服务增值行业混合净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009 年	-	-	-	-	-
2008 年	2.000	179,940,805.11	240,968,802.07	420,909,607.18	2007 年应分利润于 2008 年实施
2007 年	-	-	-	-	-
合计	2.000	179,940,805.11	240,968,802.07	420,909,607.18	-

§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。公司注册地在上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州设有分公司。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。

截至 2009 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式基金、17 只开放式基金，具体包括嘉实泰和封闭、嘉实丰和价值封闭、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业股票、嘉实货币、嘉实沪深 300 指数 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (QDII)、嘉实研究精选股票、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法股票、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列证券投资基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金基金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈勤	本基金基金经理	2008 年 3 月 20 日	-	7 年	曾任瑞士信贷第一波士顿投资银行证券分析师，华夏基金管理有限公司基金经理助理，银华基金管理有限公司投资管理部，曾任银华优势企业混合基金经理。2007 年 11 月加盟嘉实基金管理有限公司。工商管理硕士 (MBA)、经济学硕士、特许金融分析师

					(CFA), 具有基金从业资格, 国籍加拿大。
--	--	--	--	--	-------------------------

注: (1) 任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日; (2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实服务增值行业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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本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 系统和人工监控等方式进行日常监控, 公平对待旗下管理的所有基金和组合。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内本基金不存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在这送走“牛”年, 迎接“虎”年之际, 很有必要对过去一年的行情和操作做个总结, 以更好的面对新一年复杂的行情。2009 年总体上看是个 BETA 行情, 市场主要指数在 09 年 8 月前基本呈现单边向上的格局, 强周期类股票明显表现优于弱周期类, 充分体现了市场对经济复苏的乐观预期以及充裕的流动性的推动作用。尽管在这一阶段市场行情也有结构性的变化, 比如从一季度的新能源相关产业和其他主题性炒作, 到二季度的强周期类板块的大幅度上涨, 但如果一直保持较高股票仓位及选择高 BETA 品种则在上半年的行情中是能够取得良好收益的。市场对经济复苏和流动性的乐观预期在主要指数达到全年高点时告一段落, 随之而来的是对经济二次探底和流动性紧缩的担忧, 以及对没有业绩支撑的过高估值的修正。在市场调整过程中, 防御类板块和品种超出预期地取得了巨大的超额收益。随后市场在四季度呈现小幅震荡向上的格局, 权重股明显跑输中小市值股票。从行业角度看, 全年表现较好的板块有电子、机械设备、建材家具等, 表现相对较弱的行业是公用事业、建筑、文化传播等。

本基金总体上取得了优良的投资回报，特别是在第二季度及时抓住了主流板块上涨的机会，以及在第四季度通过自下而上的个股选择都取得了较好的回报。但也有些经验和教训值得汲取，比如在一季度开始阶段没有能够及时增加股票配置和对热点的把握，以及在三季度没能及时降低股票配置和转向防御类品种等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.834 元；本报告期基金份额净值增长率为 77.01%，业绩比较基准收益率为 80.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2010 年市场行情可能象国内外经济形势一样复杂。但可以肯定的是单边行情（BETA 行情）基本结束了，而且全年看市场波动性可能会比较大。首先，国内外经济形势可能起伏震荡将再次引起市场对经济阶段性向下调整的担忧，从而影响市场对企业盈利的预期。尽管近一时期国内外经济基本面和数据在不断向好，但我们也关注到发达国家较高的失业率，较低的企业信心指数，以及较低的投资活跃度等显示经济复苏仍处于不稳定状态。特别是随着各国开始从去年为拯救经济而采取的极端刺激政策中逐步撤出时，那些政策依赖强的行业未来的增长的不确定性大大增加了。在经济发展前景尚未明确，而各国开始回归正常的货币财政政策的过程中，局部国家、地区和行业的资产负债表或许成为潜在的风险点，至少会成为市场预期风险点。其次，在各国回归正常货币财政政策的过程中，流动性相对紧缩从全年看成为必然，因此，支持 09 年股市上涨的一个重要因素在未来一年很可能将不复存在。再次，在 09 年股市里相对“容易的钱”变得不容易后，股市财富效应将很快消失，从而使得股票市场在个人财富大类资产配置序列中的位置有所降低，将影响新增资金的流入。市场将更多体现的是存量资金间的博弈。

2010 年将是市场考验投资能力的关键一年，市场平均收益率将远低于 09 年水平。影响基金投资回报的因素不仅有选股，而且还有选时。此外，事件性的因素如股指期货等也会阶段性的影响市场走势和风格。

2010 年本基金的首要目标是寻找相对确定的 ALPHA，主要是通过自下而上的选股来完成。对于从全年看有比较确定的相对或绝对收益的投资标的将坚定持有。同时，通过对大盘相对中小盘，周期相对非周期，以及行业间的估值比较来把握市场风格和板块的轮动。对于股票仓位，在市场仍存在结构性机会的前提下，不与市场平均水平做大的偏离。而在没有大的结构性机会的情况下，将通过降低股票仓位来防范市场的系统性风险。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人重点开展了合规管理、内部审计、法律事务、制度建设、信息披露等

监察稽核工作，采取的主要措施如下：

(1) 差错管理：全面实施内部差错管理，每月进行统计分析，与业务部门及时沟通，提出改进或防范措施有效控制差错行为。以风险源头部门、风险控制部门为主重新改组了风险控制委员会人员构成，风控委员会定期召开会议，对主要风险和差错进行评估，提出改进措施，修正控制流程。

(2) 内控前置：在新产品设计、业务创新、市场营销、投资管理、信息披露、公司制度建设等方面，全面实施内控前置，紧跟公司业务发展战略，为业务部门及时提供法律支持以及合规风险、操作风险防范措施。

(3) “三条底线”的防范：认真对照“诚实信用、审慎勤勉、恪尽职守”12 字基本要求，积极倡导“主动合规”的内控文化，公司各项管理制度健全并严格执行，规范运作，审慎经营，公司管理的不同投资组合能够得到公平对待，坚守“三条底线”。

(4) 信息披露和投资者关系管理工作：完成 19 只基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、运营、风险管理、法律稽核等部门负责人以及基金经理组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国证券业协会等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 报告期内本基金未实施利润分配。

(2) 根据本报告 3.1.2“期末可供分配收益”为 3,791,625,154.27 元，以及本基金基金合同（二十三（二）收益分配原则 7 款“在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成”。

本基金管理人以截至 2009 年 12 月 31 日的可供分配收益为基准进行收益分配，权益登记日、

除息日为 2010 年 1 月 20 日，红利发放日为 2010 年 1 月 21 日，实施分配收益 77,190,741.81 元，符合本基金基金合同的约定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对嘉实服务增值行业证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20268 号

嘉实服务增值行业证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的嘉实服务增值行业证券投资基金(以下简称“嘉实服务增值基金”)的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是嘉实服务增值基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了嘉实服务增值基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

注册会计师曹银华

会计师事务所有限公司

注册会计师陈宇

中国·上海市

2010 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产			
银行存款	7.4.7.1	403,097,131.80	210,156,059.22
结算备付金		36,599,575.24	15,375,394.62
存出保证金		11,901,661.66	1,973,341.28
交易性金融资产	7.4.7.2	5,283,426,619.03	3,327,687,837.55
其中：股票投资		5,024,174,619.03	2,750,053,269.87

基金投资		-	-
债券投资		259,252,000.00	577,634,567.68
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		223,316,840.70	95,481,575.82
应收利息	7.4.7.5	711,053.11	15,492,869.73
应收股利		-	-
应收申购款		2,420,395.45	235,872.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,961,473,276.99	3,666,402,950.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
负 债			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		12,941,866.38	2,545,337.44
应付管理人报酬		7,561,637.19	4,775,770.21
应付托管费		1,260,272.87	795,961.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	16,018,330.03	7,980,857.08
应交税费		741,392.44	317,240.44
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,151,560.02	1,127,261.87
负债合计		39,675,058.93	17,542,428.76
所有者权益			
实收基金	7.4.7.9	1,544,658,566.01	1,684,851,076.34
未分配利润	7.4.7.10	4,377,139,652.05	1,964,009,445.83
所有者权益合计		5,921,798,218.06	3,648,860,522.17
负债和所有者权益总计		5,961,473,276.99	3,666,402,950.93

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.834 元，基金份额总额 1,544,658,566.01 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入		2,762,093,501.57	-3,974,896,426.01
1.利息收入		12,913,652.90	36,230,644.18
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,687,228.75	5,235,322.25
债券利息收入		9,226,424.15	30,951,162.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	44,159.57
其他利息收入		-	-
2.投资收益		2,068,956,191.98	-1,999,582,243.82
其中：股票投资收益	7.4.7.12	2,044,535,234.17	-2,032,716,296.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-503,632.64	-5,409,814.60
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	3,067,104.92
股利收益	7.4.7.15	24,924,590.45	35,476,762.07
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	677,844,118.39	-2,013,714,514.37
4.汇兑收益		-	-
5.其他收入	7.4.7.17	2,379,538.30	2,169,688.00
减：二、费用		212,633,057.15	276,029,024.72
1. 管理人报酬		73,620,817.33	91,371,179.47
2. 托管费		12,270,136.22	15,228,529.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	126,256,882.52	168,156,791.38
5. 利息支出		41,747.20	821,925.72
其中：卖出回购金融资产支出		41,747.20	821,925.72
6. 其他费用	7.4.7.19	443,473.88	450,598.27
三、利润总额		2,549,460,444.42	-4,250,925,450.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润		2,549,460,444.42	-4,250,925,450.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实服务增值行业证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,684,851,076.34	1,964,009,445.83	3,648,860,522.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,549,460,444.42	2,549,460,444.42

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-140,192,510.33	-136,330,238.20	-276,522,748.53
其中：1.基金申购款	1,075,990,368.81	2,467,505,277.92	3,543,495,646.73
2.基金赎回款	-1,216,182,879.14	-2,603,835,516.12	-3,820,018,395.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,544,658,566.01	4,377,139,652.05	5,921,798,218.06
项目	上年度可比期间		
	2008年1月1日至2008年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,321,021,331.86	7,800,914,752.70	10,121,936,084.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,250,925,450.73	-4,250,925,450.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-636,170,255.52	-1,165,070,248.96	-1,801,240,504.48
其中：1.基金申购款	299,139,286.32	713,869,012.82	1,013,008,299.14
2.基金赎回款	-935,309,541.84	-1,878,939,261.78	-2,814,248,803.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-420,909,607.18	-420,909,607.18
五、期末所有者权益（基金净值）	1,684,851,076.34	1,964,009,445.83	3,648,860,522.17

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人赵学军， 主管会计工作负责人李松林， 会计机构负责人王红。

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实服务增值行业证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]第16号《关于同意嘉实服务增值行业证券投资基金设立的批复》核准，由基金发起人嘉实基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》发起，并于2004年4月1日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集9,030,372,620.15元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2004)第055号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金资产配置的比例范围是：股票资产25%-95%；

债券资产0%-70%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，基金投资于服务业股票的比例不低于基金股票资产的80%。本基金的业绩比较基准为中信综合指数 X 80% + 中信标普国债指数 X 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司于 2010 年 3 月 22 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或红利再投资形式。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产

生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种的公允价值，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2009 年 6 月 11 日颁布了《企业会计准则解释第 3 号》。根据《企业会计准则解释第 3 号》对分部报告的相关要求，本基金自 2009 年起，按照内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。于 2009 年 1 月 1 日以前，本基金主要按业务分部披露分部信息。本基金的内部管理和报告按照基金投资组合进行，按经营分部为基础披露的分部信息与以前年度按业务分部为基础披露的分部报告并无差异。《企业会计准则解释第 3 号》的其他要求不适用于本基金。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

报告期内本基金无涉及会计估计变更事项。

7.4.5.3 差错更正的说明

报告期内本基金无涉及重大会计差错事项。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日

活期存款	403,097,131.80	210,156,059.22
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月-1年	-	-
其他存款	-	-
合计	403,097,131.80	210,156,059.22

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,715,545,330.44	5,024,174,619.03	308,629,288.59	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	259,307,000.00	259,252,000.00	-55,000.00
	合计	259,307,000.00	259,252,000.00	-55,000.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,974,852,330.44	5,283,426,619.03	308,574,288.59	
项目	上年度末 2008年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,122,266,877.29	2,750,053,269.87	-372,213,607.42	
债券	交易所市场	25,239,970.06	13,997,567.68	-11,242,402.38
	银行间市场	549,450,820.00	563,637,000.00	14,186,180.00
	合计	574,690,790.06	577,634,567.68	2,943,777.62
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	3,696,957,667.35	3,327,687,837.55	-369,269,829.80	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末（2009年12月31日）及上年度末（2008年12月31日），本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末（2009年12月31日）及上年度末（2008年12月31日），本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末（2009年12月31日）及上年度末（2008年12月31日），本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	98,405.81	48,453.35
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	12,809.80	6,918.90
应收债券利息	599,554.27	15,437,427.86
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	234.83	7.32
其他	48.40	62.30
合计	711,053.11	15,492,869.73

7.4.7.6 其他资产

本期末（2009 年 12 月 31 日）、上年度末（2008 年 12 月 31 日），本基金未持有其他资产（其他应收款、待摊费用等）。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	16,016,619.54	7,978,832.08
银行间市场应付交易费用	1,710.49	2,025.00
合计	16,018,330.03	7,980,857.08

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00	1,000,000.00
预提费用	120,000.00	120,000.00
应付赎回费	31,560.02	7,261.87
合计	1,151,560.02	1,127,261.87

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,684,851,076.34	1,684,851,076.34
本期申购	1,075,990,368.81	1,075,990,368.81
本期赎回	-1,216,182,879.14	-1,216,182,879.14
本期末	1,544,658,566.01	1,544,658,566.01

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,108,097,170.71	-144,087,724.88	1,964,009,445.83
本期利润	1,871,616,326.03	677,844,118.39	2,549,460,444.42
本期基金份额交易产生的变动数	-188,088,342.47	51,758,104.27	-136,330,238.20
其中：基金申购款	2,116,540,252.65	350,965,025.27	2,467,505,277.92
基金赎回款	-2,304,628,595.12	-299,206,921.00	-2,603,835,516.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,791,625,154.27	585,514,497.78	4,377,139,652.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
活期存款利息收入	3,236,496.58	4,849,770.23
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	408,788.56	380,950.72
其他	41,943.61	4,601.30
合计	3,687,228.75	5,235,322.25

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	41,535,594,010.90	28,998,361,917.33
减：卖出股票成本总额	39,491,058,776.73	31,031,078,213.54
买卖股票差价收入	2,044,535,234.17	-2,032,716,296.21

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
卖出债券、债转股及债券到期兑付成交金额	1,156,515,415.85	1,786,317,291.06
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	1,137,300,545.51	1,759,778,996.72
减：应收利息总额	19,718,502.98	31,948,108.94
债券投资收益	-503,632.64	-5,409,814.60

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
卖出权证成交金额	-	18,445,656.31

减：卖出权证成本总额	-	15,378,551.39
买卖权证差价收入	-	3,067,104.92

注：本期及上年度可比期间没有权证行权。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	24,924,590.45	35,476,762.07
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	24,924,590.45	35,476,762.07

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
1.交易性金融资产	677,844,118.39	-2,013,011,514.39
——股票投资	680,842,896.01	-2,012,398,844.18
——债券投资	-2,998,777.62	-612,670.21
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2.衍生工具	-	-702,999.98
——权证投资	-	-702,999.98
3.其他	-	-
合计	677,844,118.39	-2,013,714,514.37

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	2,028,144.75	1,615,263.37
基金转出费收入	326,393.55	416,583.26
印花税手续费返还	-	137,841.37
其他	25,000.00	-
合计	2,379,538.30	2,169,688.00

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	126,252,257.52	168,145,041.38
银行间市场交易费用	4,625.00	11,750.00
合计	126,256,882.52	168,156,791.38

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日

信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	120,000.00	120,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	5,373.88	11,698.27
其他	100.00	900.00
合计	443,473.88	450,598.27

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

报告期内，本基金不存在或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2010年1月16日，本基金管理人发布《嘉实服务增值行业证券投资基金2009年年度收益分配公告》，以截至2009年12月31日的可供分配收益为基准，向基金份额持有人进行收益分配：每10份基金份额派发红利0.50元，红利发放日为2010年1月21日。

7.4.9 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	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	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	与基金管理人同受重大影响的公司、基金代销机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2009年1月1日至2009年12月31日）、上年度可比期间（2008年1月1日至2008年12月31日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	73,620,817.33	91,371,179.47
其中：支付销售机构的客户维护费	4,401,889.25	4,468,674.06

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,270,136.22	15,228,529.88

注:支付基金托管人中国银行的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。其计算公式为:日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期						
2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	-	158,386,928.77	-	-	190,000,000.00	36,413.22
上年度可比期间						
2008年1月1日至2008年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	474,411,370.17	535,999,221.81	-	-	565,410,000.00	607,905.72

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期(2009年1月1日至2009年12月31日)、上年度可比期间(2008年1月1日至2008年12月31日),基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2009年12月31日)、上年度末(2008年12月31日),其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2009年1月1日至2009年12月31日		2008年1月1日至2008年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	403,097,131.80	3,236,496.58	210,156,059.22	4,849,770.23

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

报告期内,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.11 利润分配情况

报告期内,本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券	证券	成功	可流通日	流通受限	认购	期末估	数量	期末	期末估值总额	备注

代码	名称	认购日		类型	价格	值单价	(单位: 股)	成本总额		
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	未上市	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
600239	云南城投	2009-04-14	2010-04-12	非公开发行 流通受限	15.18	22.79	2,100,000	21,252,000.00	47,859,000.00	-
600522	中天科技	2009-03-06	2010-03-04	非公开发行 流通受限	8.60	22.24	2,470,000	21,242,000.00	54,932,800.00	-
002303	美盈森	2009-10-22	2010-02-03	IPO网下锁 3个月	25.36	31.50	51,415	1,303,884.40	1,619,572.50	-
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	IPO网下锁 3个月	60.00	113.99	9,651	579,060.00	1,100,117.49	-
002330	得利斯	2009-12-25	2010-01-06	未上市	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	-
002122	天马股份	2009-02-17	2010-02-22	非公开发行 流通受限	47.00	28.54	1,000,000	23,500,000.00	28,540,000.00	-
300003	乐普医疗	2009-09-29	2010-02-01	IPO网下锁 3个月	29.00	51.20	70,615	2,047,835.00	3,615,488.00	-
300004	南风股份	2009-09-29	2010-02-01	IPO网下锁 3个月	22.89	39.16	81,702	1,870,158.78	3,199,450.32	-
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	IPO网下锁 3个月	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	-
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	IPO网下锁 3个月	28.58	55.43	55,467	1,585,246.86	3,074,535.81	-

注: (1) 本基金于 2009 年 4 月 14 日参与认购云南城投非公开发行股票, 认购数量 1,400,000 股, 该股票于 2009 年 6 月 16 日实施 2008 年度资本公积金转增股本, 按每 10 股转增 5 股, 新增 700,000 股。(2) 本基金于 2009 年 2 月 17 日参与认购天马股份非公开发行股票, 认购数量 500,000 股, 该股票于 2009 年 4 月 2 日实施 2008 年度利润分配及资本公积转增股本, 按每 10 股转增 10 股, 新增 500,000 股。

7.4.12.1.2 受限证券类别: 债券

期末(2009 年 12 月 31 日) 本基金未持有流通受限的债券。

7.4.12.1.3 受限证券类别: 其他

期末(2009 年 12 月 31 日) 本基金未持有流通受限的其他证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代 码	股票 名称	停牌 日期	停牌 原因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600423	柳化股份	09-11-27	筹划重大 收购事项	14.17	10-01-04	13.61	2,672,350	32,855,047.82	37,867,199.50	-
000709	唐钢股份	09-12-16	吸收合并	7.09	10-01-25	6.60	4,000,000	30,782,629.67	28,360,000.00	复牌后 更名为 河北钢铁

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

期末本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

期末本基金无交易所债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，属于中高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，在力争资本本金安全和流动性前提下超过业绩基准，在追求长期稳定增长的同时不放弃短期收益。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险管理与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、副总经理、督察长、总经理助理以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	403,097,131.80	-	-	-	403,097,131.80
结算备付金	36,599,575.24	-	-	-	36,599,575.24
存出保证金	138,549.12	-	-	11,763,112.54	11,901,661.66
交易性金融资产	259,252,000.00	-	-	5,024,174,619.03	5,283,426,619.03
应收证券清算款	-	-	-	223,316,840.70	223,316,840.70
应收利息	-	-	-	711,053.11	711,053.11
应收申购款	112,468.83	-	-	2,307,926.62	2,420,395.45
资产总计	699,199,724.99	-	-	5,262,273,552.00	5,961,473,276.99
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,941,866.38	12,941,866.38
应付管理人报酬	-	-	-	7,561,637.19	7,561,637.19
应付托管费	-	-	-	1,260,272.87	1,260,272.87
应付交易费用	-	-	-	16,018,330.03	16,018,330.03
应交税费	-	-	-	741,392.44	741,392.44
其他负债	-	-	-	1,151,560.02	1,151,560.02
负债总计	-	-	-	39,675,058.93	39,675,058.93
利率敏感度缺口	699,199,724.99	-	-	5,222,598,493.07	5,921,798,218.06
上年度末 2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	210,156,059.22	-	-	-	210,156,059.22
结算备付金	15,375,394.62	-	-	-	15,375,394.62
存出保证金	138,549.12	-	-	1,834,792.16	1,973,341.28

交易性金融资产	350,627,000.00	227,007,567.68	-	2,750,053,269.87	3,327,687,837.55
应收证券清算款		-	-	95,481,575.82	95,481,575.82
应收利息		-	-	15,492,869.73	15,492,869.73
应收申购款	3,479.14	-	-	232,393.57	235,872.71
资产总计	576,300,482.10	227,007,567.68	-	2,863,094,901.15	3,666,402,950.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,545,337.44	2,545,337.44
应付管理人报酬	-	-	-	4,775,770.21	4,775,770.21
应付托管费	-	-	-	795,961.72	795,961.72
应付交易费用	-	-	-	7,980,857.08	7,980,857.08
应交税费	-	-	-	317,240.44	317,240.44
其他负债	-	-	-	1,127,261.87	1,127,261.87
负债总计	-	-	-	17,542,428.76	17,542,428.76
利率敏感度缺口	576,300,482.10	227,007,567.68	-	2,845,552,472.39	3,648,860,522.17

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.38% (2008 年 12 月 31 日：15.83%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2008 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 25%-95%，债券投资比例为 0%-70%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基

金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 (2009年12月31日)		上年度末 (2008年12月31日)	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,024,174,619.03	84.84	2,750,053,269.87	75.37
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,024,174,619.03	84.84	2,750,053,269.87	75.37

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币万元)	
		本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
	业绩比较基准上升 5%	增加约 29,846	增加约 14,132
	业绩比较基准下降 5%	减少约 29,846	减少约 14,132

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项：无

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,024,174,619.03	84.28
	其中：股票	5,024,174,619.03	84.28
2	固定收益投资	259,252,000.00	4.35
	其中：债券	259,252,000.00	4.35
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	439,696,707.04	7.38
6	其他资产	238,349,950.92	4.00
	合计	5,961,473,276.99	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	205,768,642.71	3.47
C	制造业	1,842,123,672.19	31.11
C0	食品、饮料	321,036,029.37	5.42
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,619,572.50	0.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	268,931,829.83	4.54
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	554,896,441.81	9.37
C7	机械、设备、仪表	404,006,704.08	6.82
C8	医药、生物制品	291,633,094.60	4.92
C99	其他制造业	-	-
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	148,044,486.87	2.50
G	信息技术业	621,460,692.09	10.49
H	批发和零售贸易	450,876,389.41	7.61
I	金融、保险业	1,243,814,201.19	21.00
J	房地产业	244,645,123.35	4.13
K	社会服务业	85,466,815.70	1.44
L	传播与文化产业	3,074,535.81	0.05
M	综合类	178,900,059.71	3.02
	合计	5,024,174,619.03	84.84

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600729	重庆百货	8,460,373	339,683,975.95	5.74
2	600036	招商银行	17,268,145	311,690,017.25	5.26
3	600406	国电南瑞	4,370,461	213,977,770.56	3.61
4	601166	兴业银行	4,625,341	186,447,495.71	3.15
5	601318	中国平安	3,230,464	177,966,261.76	3.01
6	600519	贵州茅台	1,033,042	175,431,192.44	2.96
7	600030	中信证券	4,661,754	148,103,924.58	2.50
8	600887	*ST 伊利	5,456,878	144,498,129.44	2.44
9	600067	冠城大通	10,292,999	143,999,056.01	2.43
10	600015	华夏银行	11,522,857	143,113,883.94	2.42

11	002004	华邦制药	3,014,285	133,472,539.80	2.25
12	600582	天地科技	3,448,234	119,826,131.50	2.02
13	000060	中金岭南	4,245,025	118,436,197.50	2.00
14	600269	赣粤高速	13,572,323	117,943,486.87	1.99
15	002080	中材科技	3,210,092	115,242,302.80	1.95
16	600141	兴发集团	4,772,164	99,308,732.84	1.68
17	002095	生意宝	2,612,730	96,592,628.10	1.63
18	000612	焦作万方	3,313,574	92,780,072.00	1.57
19	600823	世茂股份	5,564,138	92,698,539.08	1.57
20	600050	中国联通	12,132,105	88,443,045.45	1.49
21	600518	康美药业	8,188,166	87,040,204.58	1.47
22	002002	*ST 琼花	6,556,644	73,106,580.60	1.23
23	601628	中国人寿	1,999,992	63,379,746.48	1.07
24	600016	民生银行	7,999,983	63,279,865.53	1.07
25	600223	ST 鲁置业	5,040,702	62,655,925.86	1.06
26	000937	金牛能源	1,471,684	61,222,054.40	1.03
27	600720	祁连山	3,499,910	60,548,443.00	1.02
28	600000	浦发银行	2,789,935	60,513,690.15	1.02
29	600169	太原重工	3,448,041	59,995,913.40	1.01
30	000990	诚志股份	3,447,743	59,990,728.20	1.01
31	000877	天山股份	2,815,153	59,765,698.19	1.01
32	002205	国统股份	2,973,723	59,474,460.00	1.00
33	600028	中国石化	4,217,359	59,422,588.31	1.00
34	600138	中青旅	3,699,990	59,014,840.50	1.00
35	000402	金融街	4,847,251	58,797,154.63	0.99
36	600688	S 上石化	5,346,337	58,649,316.89	0.99
37	600837	海通证券	3,040,755	58,352,088.45	0.99
38	600511	国药股份	2,272,377	58,172,851.20	0.98
39	600079	人福科技	4,077,472	57,737,003.52	0.97
40	002065	东华软件	2,447,705	56,884,664.20	0.96
41	600522	中天科技	2,470,000	54,932,800.00	0.93
42	600583	海油工程	4,800,000	54,720,000.00	0.92
43	600859	王府井	1,437,234	53,019,562.26	0.90
44	600239	云南城投	2,100,000	47,859,000.00	0.81
45	002208	合肥城建	2,108,493	45,290,429.64	0.76
46	000839	中信国安	3,097,826	45,135,324.82	0.76
47	600517	置信电气	2,403,789	44,830,664.85	0.76
48	600423	柳化股份	2,672,350	37,867,199.50	0.64
49	600485	中创信测	2,038,500	35,245,665.00	0.60
50	601169	北京银行	1,601,201	30,967,227.34	0.52
51	601857	中国石油	2,200,000	30,404,000.00	0.51
52	600118	中国卫星	1,248,918	30,248,793.96	0.51

53	601111	中国国航	3,100,000	30,101,000.00	0.51
54	600157	鲁润股份	1,511,977	29,286,994.49	0.49
55	000537	广宇发展	2,046,228	29,220,135.84	0.49
56	002122	天马股份	1,000,000	28,540,000.00	0.48
57	000709	唐钢股份	4,000,000	28,360,000.00	0.48
58	000888	峨眉山A	1,913,581	24,493,836.80	0.41
59	600425	青松建化	899,347	20,289,268.32	0.34
60	600750	江中药业	480,139	11,129,622.02	0.19
61	300003	乐普医疗	70,615	3,615,488.00	0.06
62	300004	南风股份	81,702	3,199,450.32	0.05
63	300027	华谊兄弟	55,467	3,074,535.81	0.05
64	300015	爱尔眼科	38,568	1,882,118.40	0.03
65	002303	美盈森	51,415	1,619,572.50	0.03
66	002304	洋河股份	9,651	1,100,117.49	0.02
67	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.00
68	002330	得利斯	500	6,590.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 的股票明细

金额单位：人民币元

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 (%)
1	601318	中国平安	1,049,699,515.78	28.77
2	601166	兴业银行	975,641,401.50	26.74
3	600048	保利地产	853,728,201.37	23.40
4	600030	中信证券	712,517,348.85	19.53
5	601601	中国太保	697,933,596.25	19.13
6	601169	北京银行	688,606,353.65	18.87
7	600016	民生银行	594,898,907.40	16.30
8	600348	国阳新能	524,125,643.74	14.36
9	000002	万科A	507,598,642.65	13.91
10	600519	贵州茅台	505,400,191.24	13.85
11	600036	招商银行	500,358,307.01	13.71
12	601699	潞安环能	468,273,100.72	12.83
13	601398	工商银行	461,628,970.62	12.65
14	000792	盐湖钾肥	426,819,709.04	11.70
15	601001	大同煤业	410,825,760.54	11.26
16	601088	中国神华	407,045,808.03	11.16
17	600015	华夏银行	399,710,779.59	10.95
18	002024	苏宁电器	387,214,658.23	10.61
19	601328	交通银行	382,652,127.69	10.49
20	000063	中兴通讯	370,954,052.08	10.17

21	600895	张江高科	360,587,789.77	9.88
22	600028	中国石化	358,736,688.20	9.83
23	600104	上海汽车	338,037,115.30	9.26
24	600729	重庆百货	332,994,938.31	9.13
25	600383	金地集团	318,586,239.91	8.73
26	601186	中国铁建	314,271,593.90	8.61
27	600582	天地科技	310,994,604.23	8.52
28	601939	建设银行	292,947,147.51	8.03
29	000825	太钢不锈	286,349,510.25	7.85
30	600001	邯郸钢铁	281,437,326.75	7.71
31	600089	特变电工	275,252,159.48	7.54
32	600642	申能股份	265,185,446.70	7.27
33	000402	金融街	261,330,066.21	7.16
34	600031	三一重工	253,134,177.88	6.94
35	600518	康美药业	244,317,751.00	6.70
36	000651	格力电器	234,789,760.56	6.43
37	600887	*ST 伊利	233,192,163.27	6.39
38	601766	中国南车	232,703,484.76	6.38
39	600837	海通证券	230,272,930.75	6.31
40	000422	湖北宣化	229,642,276.50	6.29
41	600029	南方航空	228,401,019.50	6.26
42	600269	赣粤高速	225,654,552.39	6.18
43	600000	浦发银行	223,834,221.51	6.13
44	000839	中信国安	223,038,791.55	6.11
45	002202	金风科技	222,609,761.36	6.10
46	600231	凌钢股份	221,558,748.04	6.07
47	600406	国电南瑞	221,544,149.75	6.07
48	600966	博汇纸业	215,451,747.88	5.90
49	000562	宏源证券	213,856,381.69	5.86
50	600881	亚泰集团	207,026,511.40	5.67
51	600690	青岛海尔	206,585,931.26	5.66
52	600067	冠城大通	206,520,520.49	5.66
53	000709	唐钢股份	202,061,639.38	5.54
54	601390	中国中铁	199,484,919.60	5.47
55	600325	华发股份	196,724,860.02	5.39
56	600005	武钢股份	194,726,477.25	5.34
57	000060	中金岭南	194,043,999.08	5.32
58	000690	宝新能源	193,501,555.41	5.30
59	601628	中国人寿	189,015,067.34	5.18
60	000758	中色股份	185,891,259.82	5.09
61	002242	九阳股份	183,368,704.18	5.03
62	600590	泰豪科技	176,889,484.98	4.85

63	600432	吉恩镍业	176,323,934.20	4.83
64	000623	吉林敖东	174,402,530.78	4.78
65	600362	江西铜业	174,066,930.82	4.77
66	002080	中材科技	172,367,931.67	4.72
67	000898	鞍钢股份	172,240,828.92	4.72
68	600307	酒钢宏兴	170,008,635.88	4.66
69	601168	西部矿业	169,976,343.54	4.66
70	000686	东北证券	169,954,332.66	4.66
71	600169	太原重工	169,671,886.85	4.65
72	600795	国电电力	167,512,839.48	4.59
73	600835	上海机电	167,281,229.44	4.58
74	600809	山西汾酒	164,675,945.60	4.51
75	600050	中国联通	159,906,844.54	4.38
76	600997	开滦股份	159,894,207.87	4.38
77	601668	中国建筑	159,839,113.77	4.38
78	000527	美的电器	158,810,913.16	4.35
79	600511	国药股份	158,004,905.98	4.33
80	000069	华侨城A	156,016,213.54	4.28
81	000157	中联重科	151,618,502.78	4.16
82	002007	华兰生物	151,269,032.09	4.15
83	000983	西山煤电	150,322,319.43	4.12
84	600546	山煤国际	149,910,969.50	4.11
85	600208	新湖中宝	147,300,464.60	4.04
86	600196	复星医药	146,735,635.43	4.02
87	000009	中国宝安	146,293,173.44	4.01
88	601958	金钼股份	142,685,157.00	3.91
89	000932	华菱钢铁	142,542,701.18	3.91
90	000895	双汇发展	142,530,546.47	3.91
91	600657	信达地产	140,706,535.97	3.86
92	000401	冀东水泥	139,000,693.58	3.81
93	600058	五矿发展	138,356,505.09	3.79
94	600973	宝胜股份	137,215,548.09	3.76
95	600223	ST 鲁置业	133,536,319.90	3.66
96	000937	金牛能源	132,189,115.95	3.62
97	601666	平煤股份	131,810,092.10	3.61
98	600551	时代出版	131,558,629.89	3.61
99	000597	东北制药	127,084,216.23	3.48
100	600487	亨通光电	126,870,494.87	3.48
101	601919	中国远洋	126,414,472.99	3.46
102	600970	中材国际	125,521,747.90	3.44
103	000528	柳 工	125,123,163.67	3.43
104	600486	扬农化工	124,719,245.00	3.42

105	600290	华仪电气	119,999,928.05	3.29
106	000027	深圳能源	119,334,256.08	3.27
107	000877	天山股份	119,253,767.47	3.27
108	600983	合肥三洋	117,207,620.77	3.21
109	002004	华邦制药	116,836,816.64	3.20
110	000858	五粮液	116,163,873.96	3.18
111	600720	祁连山	114,772,526.48	3.15
112	601857	中国石油	110,684,867.48	3.03
113	000961	中南建设	107,607,683.12	2.95
114	600068	葛洲坝	107,124,014.14	2.94
115	600251	冠农股份	104,881,179.13	2.87
116	600141	兴发集团	103,908,274.48	2.85
117	000625	长安汽车	103,164,629.65	2.83
118	600900	长江电力	103,021,924.97	2.82
119	600823	世茂股份	102,106,647.58	2.80
120	600185	格力地产	101,321,303.70	2.78
121	600859	王府井	100,386,649.28	2.75
122	600359	新农开发	100,277,171.82	2.75
123	600276	恒瑞医药	99,960,370.01	2.74
124	600655	豫园商城	99,451,760.81	2.73
125	600697	欧亚集团	97,262,826.67	2.67
126	600550	天威保变	95,432,486.32	2.62
127	601006	大秦铁路	94,285,962.58	2.58
128	600688	S上石化	94,126,321.65	2.58
129	600312	平高电气	93,695,229.84	2.57
130	600354	敦煌种业	93,071,379.89	2.55
131	000783	长江证券	92,800,542.85	2.54
132	002095	生意宝	91,126,818.79	2.50
133	600510	黑牡丹	90,609,796.18	2.48
134	600557	康缘药业	90,069,135.44	2.47
135	000910	大亚科技	88,861,001.42	2.44
136	000612	焦作万方	88,309,796.66	2.42
137	000667	名流置业	88,301,887.18	2.42
138	600707	彩虹股份	88,143,532.61	2.42
139	002065	东华软件	87,225,873.43	2.39
140	601899	紫金矿业	86,940,300.79	2.38
141	000059	辽通化工	86,331,243.01	2.37
142	600635	大众公用	85,206,898.20	2.34
143	000425	徐工机械	84,910,226.07	2.33
144	002122	天马股份	84,454,733.45	2.31
145	000990	诚志股份	83,605,322.01	2.29
146	002002	*ST琼花	82,716,921.40	2.27

147	002132	恒星科技	82,513,752.01	2.26
148	600100	同方股份	82,069,010.57	2.25
149	000550	江铃汽车	79,521,166.08	2.18
150	600694	大商股份	78,896,574.35	2.16
151	600027	华电国际	77,370,614.59	2.12
152	002121	科陆电子	77,102,017.64	2.11
153	600816	安信信托	77,046,706.36	2.11
154	600675	中华企业	77,028,304.61	2.11
155	600458	时代新材	76,924,369.84	2.11
156	000878	云南铜业	76,347,328.66	2.09
157	002063	远光软件	75,948,811.85	2.08
158	002123	荣信股份	75,754,545.13	2.08
159	600962	国投中鲁	75,630,129.77	2.07
160	600426	华鲁恒升	75,521,193.48	2.07
161	600598	北大荒	75,374,380.91	2.07
162	000965	天保基建	74,711,232.86	2.05
163	600097	开创国际	73,495,785.91	2.01
164	600717	天津港	72,893,036.14	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

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 (%)
1	601166	兴业银行	994,329,337.46	27.25
2	601318	中国平安	951,057,701.50	26.06
3	600048	保利地产	942,008,035.71	25.82
4	600016	民生银行	759,607,876.86	20.82
5	601601	中国太保	759,547,873.84	20.82
6	601169	北京银行	756,805,131.49	20.74
7	600030	中信证券	705,408,205.46	19.33
8	600348	国阳新能	594,958,839.05	16.31
9	601699	潞安环能	591,762,461.75	16.22
10	000002	万科A	580,400,248.04	15.91
11	000792	盐湖钾肥	548,788,330.73	15.04
12	601398	工商银行	494,943,240.30	13.56
13	601328	交通银行	494,459,495.44	13.55
14	601088	中国神华	489,017,643.93	13.40
15	002024	苏宁电器	478,458,054.52	13.11
16	600383	金地集团	419,649,463.06	11.50
17	600519	贵州茅台	419,647,420.51	11.50
18	600015	华夏银行	400,675,728.44	10.98
19	601001	大同煤业	385,722,347.69	10.57
20	000063	中兴通讯	385,694,536.80	10.57
21	600104	上海汽车	372,452,815.57	10.21

22	600895	张江高科	358,399,185.07	9.82
23	000651	格力电器	353,559,234.29	9.69
24	600415	小商品城	351,339,203.65	9.63
25	600325	华发股份	341,770,066.21	9.37
26	600028	中国石化	317,522,353.72	8.70
27	601186	中国铁建	309,415,579.50	8.48
28	002202	金风科技	300,904,311.50	8.25
29	000825	太钢不锈	296,753,391.85	8.13
30	601939	建设银行	293,593,028.24	8.05
31	600089	特变电工	285,848,525.63	7.83
32	600001	邯郸钢铁	283,072,808.94	7.76
33	600031	三一重工	257,129,247.63	7.05
34	600966	博汇纸业	251,025,290.02	6.88
35	600795	国电电力	246,964,722.90	6.77
36	600029	南方航空	246,193,274.08	6.75
37	600551	时代出版	244,747,002.55	6.71
38	600642	申能股份	241,249,864.18	6.61
39	000422	湖北宜化	241,096,443.67	6.61
40	600582	天地科技	240,276,309.37	6.58
41	601766	中国南车	239,273,501.09	6.56
42	600231	凌钢股份	237,844,703.04	6.52
43	600005	武钢股份	228,507,769.36	6.26
44	000562	宏源证券	227,320,303.65	6.23
45	600690	青岛海尔	223,350,475.46	6.12
46	600432	吉恩镍业	222,505,404.01	6.10
47	600036	招商银行	217,800,661.50	5.97
48	600518	康美药业	217,056,022.78	5.95
49	000623	吉林敖东	211,828,165.32	5.81
50	600546	山煤国际	210,421,541.69	5.77
51	601390	中国中铁	209,363,015.72	5.74
52	000709	唐钢股份	204,466,969.06	5.60
53	000686	东北证券	202,926,737.27	5.56
54	601168	西部矿业	201,122,340.88	5.51
55	002242	九阳股份	198,814,324.33	5.45
56	000839	中信国安	195,739,794.90	5.36
57	000690	宝新能源	195,171,172.68	5.35
58	000758	中色股份	190,653,787.79	5.23
59	600590	泰豪科技	188,184,505.06	5.16
60	002007	华兰生物	187,679,161.64	5.14
61	600809	山西汾酒	185,710,007.85	5.09
62	600837	海通证券	185,231,870.92	5.08
63	000597	东北制药	182,774,408.01	5.01

64	600000	浦发银行	178,218,221.00	4.88
65	600307	酒钢宏兴	177,619,062.30	4.87
66	600362	江西铜业	177,127,517.08	4.85
67	000402	金融街	174,969,069.31	4.80
68	000157	中联重科	173,541,428.38	4.76
69	000069	华侨城 A	172,072,263.66	4.72
70	600487	亨通光电	169,905,509.85	4.66
71	000527	美的电器	169,037,277.55	4.63
72	600881	亚泰集团	167,407,083.73	4.59
73	000983	西山煤电	162,386,113.41	4.45
74	002038	双鹭药业	160,339,389.25	4.39
75	600835	上海机电	159,430,062.02	4.37
76	600657	信达地产	158,915,157.62	4.36
77	000009	中国宝安	158,488,153.95	4.34
78	600997	开滦股份	154,790,926.40	4.24
79	600196	复星医药	154,479,518.74	4.23
80	600649	城投控股	153,511,553.71	4.21
81	000401	冀东水泥	152,865,890.29	4.19
82	601666	平煤股份	150,116,669.63	4.11
83	000932	华菱钢铁	148,407,116.87	4.07
84	600058	五矿发展	147,662,757.85	4.05
85	601958	金铂股份	147,441,334.63	4.04
86	600068	葛洲坝	146,390,487.87	4.01
87	000877	天山股份	146,387,457.40	4.01
88	600208	新湖中宝	145,596,080.23	3.99
89	000895	双汇发展	145,237,869.39	3.98
90	600973	宝胜股份	145,137,790.56	3.98
91	601919	中国远洋	142,006,091.20	3.89
92	600290	华仪电气	141,384,564.07	3.87
93	600970	中材国际	140,885,701.31	3.86
94	000528	柳工	135,889,297.14	3.72
95	000858	五粮液	125,973,078.81	3.45
96	000898	鞍钢股份	125,939,422.00	3.45
97	600486	扬农化工	125,783,610.97	3.45
98	000961	中南建设	125,466,853.95	3.44
99	600983	合肥三洋	125,367,913.33	3.44
100	000965	天保基建	123,025,931.99	3.37
101	000027	深圳能源	119,217,282.93	3.27
102	601668	中国建筑	115,136,881.23	3.16
103	000024	招商地产	112,960,026.39	3.10
104	600729	重庆百货	111,704,404.51	3.06
105	600655	豫园商城	109,743,250.43	3.01

106	000625	长安汽车	109,728,374.02	3.01
107	600816	安信信托	108,853,289.16	2.98
108	600269	赣粤高速	108,486,672.36	2.97
109	600511	国药股份	107,977,580.94	2.96
110	601628	中国人寿	105,380,939.77	2.89
111	600510	黑牡丹	104,236,440.90	2.86
112	600185	*ST海星	103,629,286.55	2.84
113	600276	恒瑞医药	102,892,960.84	2.82
114	600354	敦煌种业	101,496,404.17	2.78
115	600887	*ST伊利	99,727,977.66	2.73
116	600489	中金黄金	99,525,698.37	2.73
117	600022	济南钢铁	98,830,377.04	2.71
118	600169	太原重工	98,709,681.28	2.71
119	600675	中华企业	98,662,112.81	2.70
120	601006	大秦铁路	97,590,243.86	2.67
121	600359	新农开发	97,200,881.32	2.66
122	000910	大亚科技	96,843,032.68	2.65
123	600251	冠农股份	96,385,385.54	2.64
124	000783	长江证券	95,868,526.65	2.63
125	600697	欧亚集团	95,584,522.97	2.62
126	000878	云南铜业	94,975,013.66	2.60
127	600707	彩虹股份	94,180,330.57	2.58
128	600900	长江电力	92,284,792.12	2.53
129	600027	华电国际	92,187,799.44	2.53
130	000059	辽通化工	91,922,785.41	2.52
131	600458	时代新材	91,786,305.96	2.52
132	600635	大众公用	91,041,668.36	2.50
133	600312	平高电气	90,832,241.82	2.49
134	601899	紫金矿业	90,652,377.39	2.48
135	600550	天威保变	90,525,020.44	2.48
136	600557	康缘药业	89,611,053.67	2.46
137	600426	华鲁恒升	87,686,185.70	2.40
138	002123	荣信股份	87,654,754.04	2.40
139	002132	恒星科技	87,232,845.00	2.39
140	600100	同方股份	87,021,568.48	2.38
141	600694	大商股份	86,832,883.73	2.38
142	601857	中国石油	85,362,556.37	2.34
143	000425	徐工机械	85,116,352.89	2.33
144	002122	天马股份	84,853,628.78	2.33
145	002121	科陆电子	84,740,945.82	2.32
146	000667	名流置业	84,133,633.91	2.31
147	600598	北大荒	81,829,432.58	2.24

148	002063	远光软件	80,601,123.24	2.21
149	600050	中国联通	80,252,333.01	2.20
150	000060	中金岭南	80,185,039.10	2.20
151	000718	苏宁环球	78,222,483.98	2.14
152	000550	江铃汽车	77,724,434.93	2.13
153	601998	中信银行	76,222,576.88	2.09
154	600258	首旅股份	75,582,795.89	2.07
155	600221	海南航空	74,550,985.32	2.04
156	600962	国投中鲁	74,231,864.18	2.03
157	002152	广电运通	74,085,177.16	2.03
158	600717	天津港	73,076,479.11	2.00
159	600223	ST 鲁置业	72,848,097.90	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	41,084,337,229.88
卖出股票收入（成交）总额	41,535,594,010.90

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入成本”、“卖出收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	209,307,000.00	3.53
3	金融债券	49,945,000.00	0.84
	其中：政策性金融债	49,945,000.00	0.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	资产支持证券	-	-
8	其他	-	-
	合计	259,252,000.00	4.38

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0901065	09 央行票据 65	1,100,000	109,637,000.00	1.85
2	0901063	09 央行票据 63	1,000,000	99,670,000.00	1.68
3	090404	09 农发 04	500,000	49,945,000.00	0.84

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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受到公开谴责和处罚。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	11,901,661.66
2	应收证券清算款	223,316,840.70
3	应收股利	-
4	应收利息	711,053.11
5	应收申购款	2,420,395.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	238,349,950.92

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
95,508	16,173.08	444,457,893.64	28.77	1,100,200,672.37	71.23

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,299,781.89	0.08

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年4月1日)基金份额总额	9,033,444,910.92
报告期期初基金份额总额	1,684,851,076.34
报告期期间基金总申购份额	1,075,990,368.81
减:报告期期间基金总赎回份额	1,216,182,879.14
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,544,658,566.01

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费 120,000.00 元,该审计机构连续 6 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
长城证券有限责任公司	2	9,016,605,789.68	10.93	7,485,590.42	10.81	新增 1 个
光大证券股份有限公司	1	2,589,970,236.06	3.14	2,201,448.73	3.18	新增
中信建投证券有限责任公司	2	4,297,975,143.68	5.21	3,589,853.18	5.19	新增 1 个
兴业证券股份有限公司	1	2,402,364,472.52	2.91	2,041,991.11	2.95	-
中银国际证券有限责任公司	2	3,357,230,068.80	4.07	2,743,128.01	3.96	新增 1 个
国泰君安证券股份有限公司	4	3,893,207,423.73	4.72	3,273,785.26	4.73	新增

华泰联合证券有限责任公司	2	2,582,050,699.71	3.13	2,194,732.74	3.17	新增
海通证券股份有限公司	2	5,228,978,817.66	6.34	4,444,612.82	6.42	新增 1 个
中国国际金融有限公司	2	1,422,958,031.36	1.72	1,208,187.69	1.75	新增 1 个
广发华福证券有限责任公司	1	1,665,511,480.56	2.02	1,415,686.91	2.05	-
江南证券有限责任公司	1	1,198,367,212.03	1.45	1,018,602.98	1.47	-
中国银河证券股份有限公司	2	570,536,541.56	0.69	481,033.71	0.69	新增 1 个
北京高华证券有限责任公司	1	5,234,982,402.02	6.34	4,449,717.22	6.43	-
长江证券股份有限公司	1	5,905,903,760.37	7.16	4,798,608.31	6.93	-
安信证券股份有限公司	3	6,377,975,964.83	7.73	5,421,245.70	7.83	新增 2 个
招商证券股份有限公司	1	1,088,595,818.45	1.32	884,494.53	1.28	新增
中信证券股份有限公司	3	3,928,316,775.01	4.76	3,281,405.78	4.74	新增
申银万国证券股份有限公司	2	3,006,089,769.33	3.64	2,502,936.93	3.62	新增
齐鲁证券有限公司	1	1,420,008,950.61	1.72	1,153,766.02	1.67	新增
湘财证券有限责任公司	1	1,192,663,674.06	1.45	1,013,766.73	1.46	新增
国金证券股份有限公司	2	1,613,132,575.85	1.95	1,371,156.47	1.98	新增
华宝证券经纪有限责任公司	1	780,662,537.03	0.95	663,553.08	0.96	新增
中信金通证券有限责任公司	1	2,563,140,719.98	3.11	2,178,658.70	3.15	新增
渤海证券股份有限公司	1	265,846,930.57	0.32	225,963.17	0.33	新增
浙商证券有限责任公司	1	142,589,179.77	0.17	121,198.95	0.18	新增
东海证券有限责任公司	1	268,698,803.04	0.33	228,393.66	0.33	新增
中国建银投资证券有限责任公司	2	1,405,044,440.30	1.70	1,159,576.20	1.68	新增
瑞银证券有限责任公司	1	1,197,519,722.20	1.45	1,017,886.98	1.47	新增
平安证券有限责任公司	2	1,037,631,697.33	1.26	860,427.43	1.24	新增
华泰证券股份有限公司	2	5,934,646,532.49	7.19	4,996,184.63	7.22	新增
广发证券股份有限公司	1	935,137,340.79	1.13	794,864.33	1.15	新增
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
英大证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
大通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1: 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2: 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为;
- (2) 公司财务状况良好;
- (3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;
- (4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;
- (5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议, 并通知基金托管人。

注 3: 报告期内, 本基金退租以下交易单元: 光大证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、海通证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司上海席位各 1 个; 中银国际证券有限责任公司、信泰证券有限责任公司深圳席位各 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		备注
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	
光大证券股份有限公司	2,472,509.60	0.58	-
中信建投证券有限责任公司	49,295,317.26	11.64	-
国泰君安证券股份有限公司	137,000,779.24	32.34	-
海通证券股份有限公司	19,959,812.60	4.71	-
广发华福证券有限责任公司	17,130,743.86	4.04	-
长江证券股份有限公司	9,574,275.92	2.26	-
安信证券股份有限公司	36,575,635.61	8.63	-
中信证券股份有限公司	29,007,374.23	6.85	-
申银万国证券股份有限公司	4,638,687.10	1.10	-
国金证券股份有限公司	36,475,103.24	8.61	-
华宝证券经纪有限责任公司	6,628,389.40	1.56	-
中信金通证券有限责任公司	30,386,469.43	7.17	-
浙商证券有限责任公司	10,976,961.65	2.59	-
瑞银证券有限责任公司	16,923,373.30	4.00	-
平安证券有限责任公司	4,553,840.10	1.08	-
华泰证券股份有限公司	12,011,917.60	2.84	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于旗下基金投资海油工程非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年1月5日
2	关于旗下基金通过深圳发展银行开办定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年1月12日
3	关于提示投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月7日
4	关于旗下基金投资天马股份非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月18日
5	关于成立嘉实国际资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月19日
6	关于成立福州、南京分公司的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月19日
7	关于旗下基金参加中国工商银行开展基智定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月26日
8	关于通过交通银行网上银行申购嘉实旗下基金费率优惠调整的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月27日
9	嘉实基金管理有限公司关于电话总机变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年2月27日
10	关于增加天相投资顾问有限公司为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年3月7日
11	关于旗下基金投资中天科技非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年3月7日
12	关于旗下开放式基金通过宁波银行、山西证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年3月19日
13	关于增加东莞银行为嘉实旗下开放式基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年3月20日
14	关于通过中国工商银行个人网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年4月1日
15	关于对广发银行理财通卡和中行广东分行借记卡持有人开通嘉实网上定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年4月9日
16	关于旗下基金投资云南城投非公开发行的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年4月16日
17	关于旗下基金参加中国银行开展的基金定投和网上银行基金交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年5月6日
18	关于旗下开放式基金通过恒泰证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年5月8日
19	关于旗下开放式基金通过光大证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年5月9日
20	关于旗下开放式基金通过中山证券开办定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年5月20日
21	关于增加广发银行为嘉实成长收益混合等开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年5月20日
22	关于增加中国民族证券为嘉实旗下开放式	中国证券报、上海证券报、	2009年6月2

	基金代销机构的公告	证券时报、管理人网站	日
23	关于旗下开放式基金通过广发银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年6月3日
24	关于增加厦门证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年6月5日
25	关于增加江海证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年6月25日
26	关于旗下开放式基金通过厦门证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月1日
27	关于增加爱建证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月3日
28	关于增加华宝证券为嘉实旗下开放式基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月3日
29	关于增加临商银行为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月15日
30	关于增加徽商银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月15日
31	关于对建行龙卡持卡人开通嘉实直销网上定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月24日
32	关于增加杭州银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月25日
33	关于增加方正证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月29日
34	关于旗下开放式基金通过徽商银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月29日
35	关于增加英大证券和宏源证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年7月30日
36	关于增加温州银行为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年8月6日
37	关于旗下开放式基金通过安信证券和东莞证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年8月8日
38	关于增加杭州银行为嘉实旗下基金代销机构并开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年8月19日
39	关于增加西南证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年9月4日
40	关于通过中国农业银行网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年9月4日
41	关于增加南京银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年9月10日
42	关于增加上海银行为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年9月14日
43	关于增加上海农商银行作为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009年9月17日
44	关于旗下证券投资基金投资创业板证券的	中国证券报、上海证券报、	2009年9月

	提示公告	证券时报、管理人网站	23 日
45	关于通过中国工商银行借记卡在嘉实网上申购基金的费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 10 月 10 日
46	关于增加浙商银行作为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 10 月 16 日
47	关于增加日信证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 10 月 27 日
48	关于增加广发华福证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 4 日
49	关于对直销的个人投资者提供网上直销汇款支付业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 4 日
50	关于增加信达证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 6 日
51	关于旗下开放式基金通过广发华福证券开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 9 日
52	关于旗下开放式基金通过南京银行开办定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 13 日
53	关于增加东兴证券为嘉实旗下开放式基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 11 月 20 日
54	关于嘉实基金网上直销汇款支付业务开通范围增加建行龙卡及农行金穗卡持卡人的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 1 日
55	关于增加江苏银行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 2 日
56	关于通过广东发展银行网上银行申购嘉实旗下开放式基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 17 日
57	关于旗下开放式基金参加工商银行等代销机构开办定投费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、管理人网站	2009 年 12 月 31 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实服务增值行业证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实服务增值行业证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实服务增值行业证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实服务增值行业证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实服务增值行业证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2010年3月30日