

嘉实服务增值行业证券投资基金

2015 年年度报告摘要

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 29 日

§ 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

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 2016 年 3 月 24 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 2015 年 1 月 1 日起至 2015 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，应阅读年度报告正文。

§ 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
基金主代码	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	433,881,435.91 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	沪深 300×80%+中债总指数×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	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942

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.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

§ 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	2015 年	2014 年	2013 年
本期已实现收益	1,561,372,961.31	81,112,159.22	1,181,624,895.15
本期利润	1,283,425,597.09	473,679,241.50	1,232,343,353.27
加权平均基金份额本期利润	2.2932	0.4402	0.7504
本期加权平均净值利润率	36.43%	10.65%	18.56%
本期基金份额净值增长率	37.83%	19.19%	20.60%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
期末可供分配利润	2,441,950,603.15	2,549,295,601.02	4,670,079,532.81
期末可供分配基金份额利润	5.6282	3.2590	3.0222
期末基金资产净值	3,085,732,510.65	4,044,333,651.63	6,719,075,309.96
期末基金份额净值	7.112	5.170	4.348
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末	2013 年末
基金份额累计净值增长率	764.82%	527.44%	426.43%

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	34.77%	1.98%	13.84%	1.34%	20.93%	0.64%
过去六个月	-0.25%	3.28%	-15.21%	2.19%	14.96%	1.09%
过去一年	37.83%	2.85%	16.79%	1.98%	21.04%	0.87%
过去三年	98.12%	1.92%	66.74%	1.40%	31.38%	0.52%

过去五年	64.72%	1.64%	36.48%	1.28%	28.24%	0.36%
自基金合同 生效起至今	764.82%	1.59%	223.28%	1.47%	541.54%	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×80%+中债总指数×20%。

沪深 300 指数是由中证指数有限公司编制，它的样本选自沪深两个证券市场 300 只股票，具备市场覆盖度广、代表性强、流动性强、指数编制方法透明等特点。它能够反映中国 A 股市场整体状况和发展趋势，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

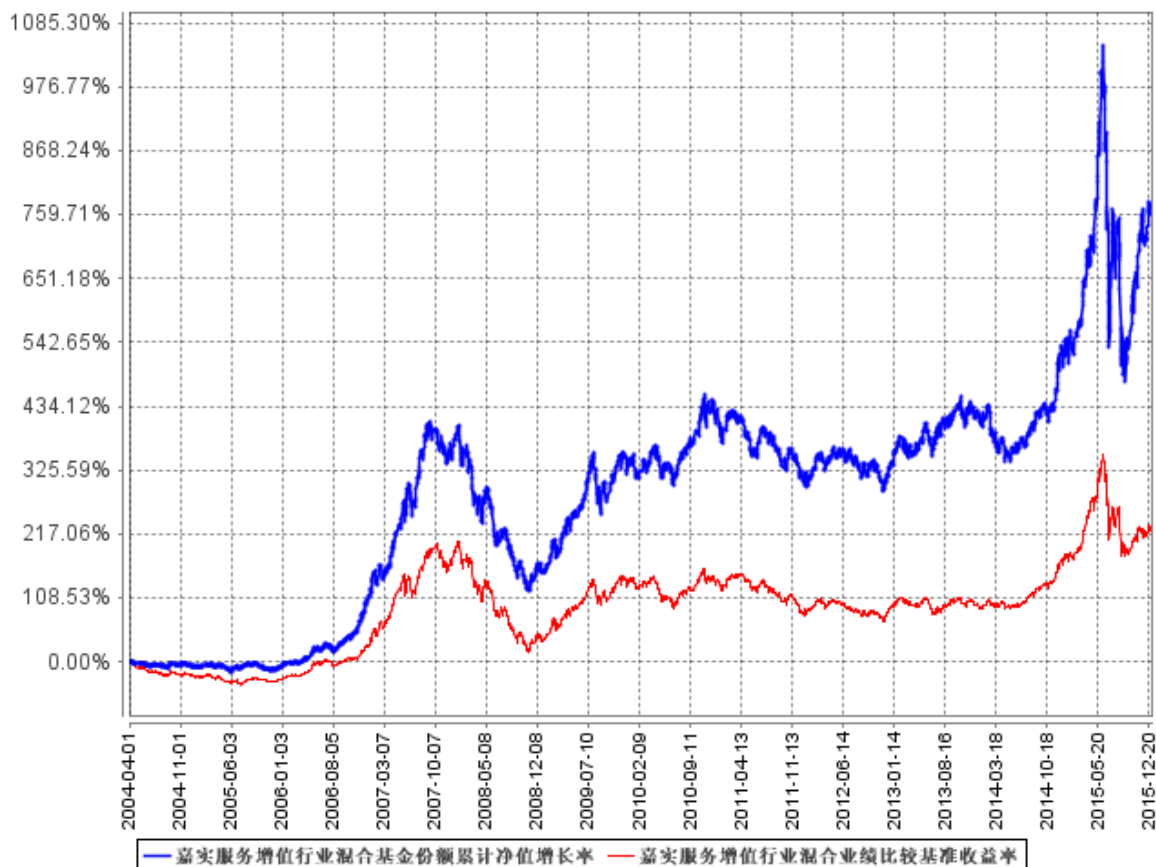
$$\text{Return}(t) = 80\% * \frac{\text{沪深 300 指数}(t)}{\text{沪深 300 指数}(t-1) - 1} + 20\% * \frac{\text{中国债券总指数}(t)}{\text{中国债券总指数}(t-1) - 1}$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) * \text{Benchmark}(t-1)$$

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

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



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

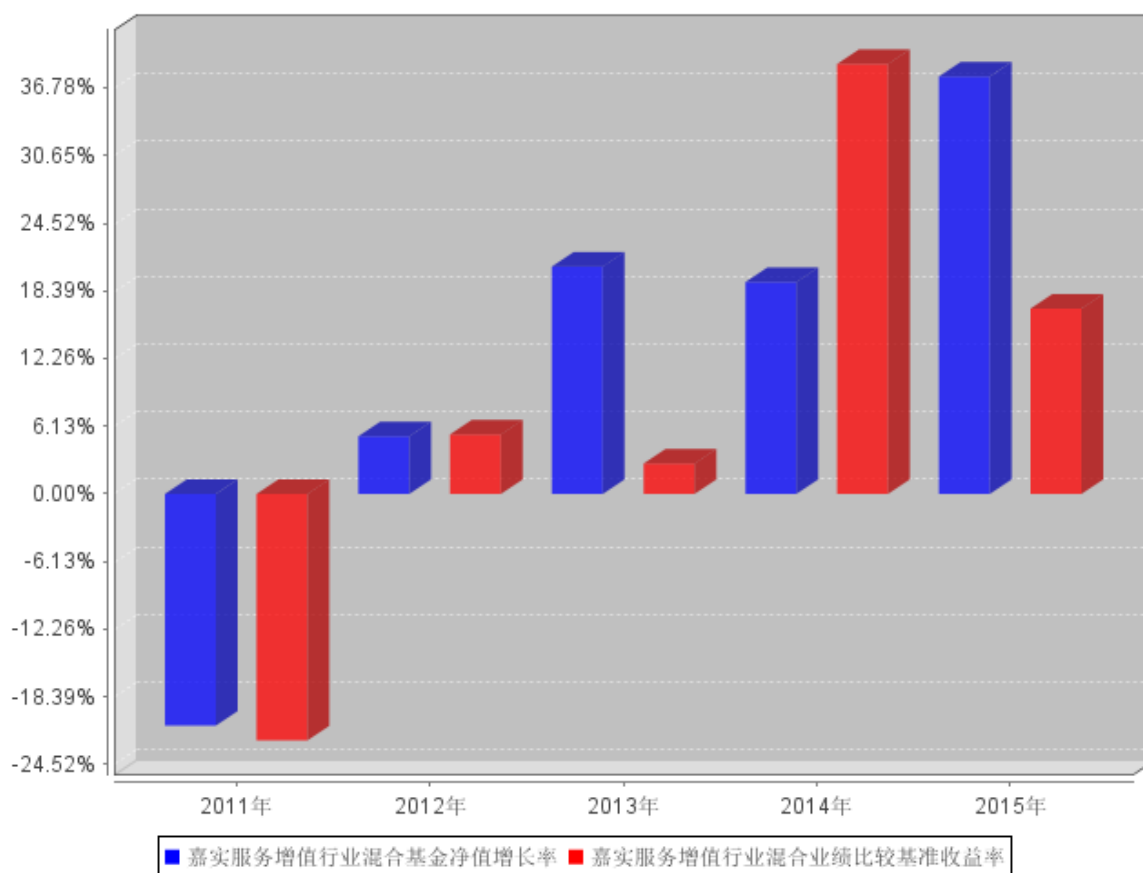
(2004年4月1日至2015年12月31日)

注 1：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。建仓期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公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。（4）法律法规规定的其他限制。

注 2：2015 年 3 月 12 日，本基金管理人发布《关于嘉实服务增值行业混合基金经理变更的公告》，陈勤先生不再担任本基金基金经理，聘请焦云女士担任本基金基金经理职务。

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

嘉实服务增值行业混合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
2015	0.1000	2,471,389.71	5,160,516.26	7,631,905.97	
2014	0.1000	5,492,745.16	9,334,336.05	14,827,081.21	
2013	1.0000	78,928,450.00	96,231,040.43	175,159,490.43	
合计	1.2000	86,892,584.87	110,725,892.74	197,618,477.61	

§ 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。公司注册地上海，公司总部设在北京，

在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。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。

截止 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、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、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 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、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
焦云	本基金基金经理	2015 年 3 月 12 日	-	11 年	曾任大成基金管理有限公司研究员，泰达宏利基金管理有限公司研究主管、基金经理，2014 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司。硕士研究生，具

					有基金从业资格，中国国籍。
陈勤	本基金基金经理	2008年3月20日	2015年3月12日	12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，2006年10月至2007年11月任银华优势企业基金基金经理。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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

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

2015 年是极其动荡的一年，市场演绎了疯狂的过山车行情，上证指数最高达到 5178、最大涨幅 60%，最终报收 3539、涨幅 9%；中小板最大涨幅 121%、最终涨幅 53.6%；创业板指数最大涨幅 175%、年终涨幅 85%。各个板块来看，涨幅靠前的分别为以互联网为代表的计算机板块、转型加行业景气度回升的轻工制造和纺织服装，以及景气度较好的休闲服务、传媒等；表现相对落后的是景气度较差同时 2014 年四季度表现相对较好的周期性行业如非银金融、银行、采掘、钢铁、建筑装饰等。

回顾 2015 年的行情，大起大落与政策主导的流动性变化密切相关。始自 2014 年 7 月份的央行下调官方回购利率到 2014 年 11 月份的正式降息，以及 2015 年 1 月份重启逆回购，整个上半年几乎每个月都有降准降息，在央行的大水漫灌下，居民储蓄出现了类似 06、07 年的疯狂搬家，风险偏好持续上升，各种加杠杆产品急速发行，催生了疯牛行情，各种题材一触即发。6 月初宽松预期开始生变，强行清理杠杆资金促发了 7、8 月份的惨烈的股灾，7 月份降准降息均落空、直到 8 月末才出现双降。而 811 开始的汇改，将市场的风险又叠加引入了外部风险，在汇率贬值周期启动、国内降息美国加息背景下，carry trade 方向出险逆转，中期来看市场进入波动较大的震荡市周期。当然国家在化解金融风险、稳住经济增长的情况下，也在积极推动各项改革，包括国

企改革、十三五规划、注册制落地和供给侧改革等，都显示政府改革的决心，为中长期经济增长的动力奠定基础。

本基金在运行过程中，上半年对于互联网配置不足导致业绩不甚理想，下半年仔细梳理各个行业的景气度，从景气度较好的行业挑选业绩增长确定性高的龙头，取得一定的成果。

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 7.112 元；本报告期基金份额净值增长率为 37.83%，业绩比较基准收益率为 16.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着开年 1 月份的类似 811 之后的惨烈下跌，我们认为短期市场风险释放较为充分，不少优质个股已经进入估值业绩较为匹配的位置。中期来看，由于汇率改革启动，国内市场开始转为一个对外部敞口扩大的阶段。同时 2012 年至汇改前外部资金呈现流入状态（国内低风险资产收益率高于美国、人民币汇率持续升值）；而汇改后叠加美元加息周期启动，资金流动开始逆转，对于股票市场将形成较为持续的影响。当然，居民大类资产配置的趋势仍将持续，市场进入中期称量阶段，优质个股将胜出。

在一季度，我们考虑到汇率风险大幅降低，市场估值降至合理水平，我们将保持积极的态度，从行业景气度、公司业绩增长的角度去选择优质个股。

4.6 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、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，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，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1) 本基金的基金管理人于 2015 年 1 月 19 日发布《嘉实服务增值行业证券投资基金 2014

年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2014 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.100 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

(2) 本基金的基金管理人于 2016 年 1 月 15 日发布《嘉实服务增值行业证券投资基金 2015 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2015 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.10 元，具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

嘉实服务增值行业证券投资基金 2015 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师许康玮、洪磊签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2016)第 20286 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 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：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	94,148,848.83	197,514,028.80
结算备付金		11,671,435.99	9,882,150.00
存出保证金		2,999,430.42	881,308.93
交易性金融资产	7.4.7.2	2,984,290,003.75	3,969,619,388.87
其中：股票投资		2,834,113,003.75	3,789,548,388.87
基金投资		-	-
债券投资		150,177,000.00	180,071,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
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		5,005,985.59	-
应收利息	7.4.7.5	2,497,903.09	5,365,747.47
应收股利		-	-
应收申购款		7,544,572.11	1,540,175.37
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,108,158,179.78	4,184,802,799.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 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		8,034,275.26	111,242,998.73
应付赎回款		3,801,889.60	15,987,739.09
应付管理人报酬		3,858,299.89	5,122,133.52
应付托管费		643,049.98	853,688.88
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	4,897,187.33	6,064,860.65
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,190,967.07	1,197,726.94
负债合计		22,425,669.13	140,469,147.81
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	433,881,435.91	782,238,397.58
未分配利润	7.4.7.10	2,651,851,074.74	3,262,095,254.05
所有者权益合计		3,085,732,510.65	4,044,333,651.63
负债和所有者权益总计		3,108,158,179.78	4,184,802,799.44

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.112 元，基金份额总额 433,881,435.91 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		1,406,176,203.21	595,150,432.15
1. 利息收入		8,431,321.35	12,769,475.01
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,279,062.52	3,022,153.94
债券利息收入		6,152,258.83	9,680,033.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	67,287.74
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		1,674,344,852.86	187,562,861.46
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,664,045,160.10	144,579,866.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-99,310.00	1,549,890.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	10,399,002.76	41,433,105.10
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-277,947,364.22	392,567,082.28
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	1,347,393.22	2,251,013.40
减：二、费用		122,750,606.12	121,471,190.65
1. 管理人报酬		52,738,786.96	67,153,982.63
2. 托管费		8,789,797.82	11,192,330.38

3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	60,721,627.41	42,618,468.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	500,393.93	506,409.35
三、利润总额		1,283,425,597.09	473,679,241.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润		1,283,425,597.09	473,679,241.50

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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	782,238,397.58	3,262,095,254.05	4,044,333,651.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,283,425,597.09	1,283,425,597.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-348,356,961.67	-1,886,037,870.43	-2,234,394,832.10
其中：1. 基金申购款	133,291,607.40	757,158,037.79	890,449,645.19
2. 基金赎回款	-481,648,569.07	-2,643,195,908.22	-3,124,844,477.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-7,631,905.97	-7,631,905.97
五、期末所有者权益（基金净值）	433,881,435.91	2,651,851,074.74	3,085,732,510.65
项目	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	1,545,243,292.78	5,173,832,017.18	6,719,075,309.96
二、本期经营活动产生的	-	473,679,241.50	473,679,241.50

基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-763,004,895.20	-2,370,588,923.42	-3,133,593,818.62
其中：1. 基金申购款	167,608,603.30	564,295,414.17	731,904,017.47
2. 基金赎回款	-930,613,498.50	-2,934,884,337.59	-3,865,497,836.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-14,827,081.21	-14,827,081.21
五、期末所有者权益（基金净值）	782,238,397.58	3,262,095,254.05	4,044,333,651.63

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：

 赵学军 王红 常旭
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 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
-----------------	----------

7.4.4 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。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,738,786.96	67,153,982.63
其中：支付销售机构的客户维护费	4,378,427.74	4,867,095.57

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 1.5% 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 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,789,797.82	11,192,330.38

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。

7.4.4.3 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

上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	-	10,025,141.64	-	-	-	-
------	---	---------------	---	---	---	---

注：本期（2015年1月1日至2015年12月31日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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（2015年1月1日至2015年12月31日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年12月31日），基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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（2015年12月31日）及上年度末（2014年12月31日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	94,148,848.83	1,918,481.35	197,514,028.80	2,761,388.11

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015年1月1日至2015年12月31日）及上年度可比期间（2014年1月1日至2014年12月31日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末（2015年12月31日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 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
000796	凯撒旅游	2015年11月9日	重大事项停牌	27.46	-	-	2,825,510	75,549,155.32	77,588,504.60	-
000876	新希望	2015年8月17日	重大事项停牌	17.61	2016年3月2日	17.09	6,156,610	109,938,191.11	108,417,902.10	-
002049	同方国芯	2015年12月11日	重大事项停牌	63.22	2016年3月11日	54.14	2,364,531	98,980,846.60	149,485,649.82	-

002696	百洋股份	2015年12月2日	重大事项停牌	26.36	-	-	631,000	15,613,762.33	16,633,160.00	-
002707	众信旅游	2015年11月16日	重大事项停牌	52.62	2016年3月15日	47.36	359,452	11,253,317.61	18,914,364.24	-
300043	互动娱乐	2015年12月17日	重大事项停牌	15.80	-	-	3,702,410	57,746,318.31	58,498,078.00	-
300054	鼎龙股份	2015年11月23日	重大事项停牌	24.66	2016年3月14日	22.19	3,037,100	48,244,368.19	74,894,886.00	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末（2015年12月31日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015年12月31日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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	2,834,113,003.75	91.18
	其中：股票	2,834,113,003.75	91.18
2	固定收益投资	150,177,000.00	4.83
	其中：债券	150,177,000.00	4.83
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	105,820,284.82	3.40
7	其他各项资产	18,047,891.21	0.58
	合计	3,108,158,179.78	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	256,916,073.14	8.33
B	采矿业	32,851,839.56	1.06
C	制造业	1,882,865,464.54	61.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,691,200.00	0.05
F	批发和零售业	59,248,508.12	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	6,135,771.60	0.20
H	住宿和餐饮业	77,588,504.60	2.51
I	信息传输、软件和信息技术服务业	295,183,331.13	9.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	18,914,364.24	0.61
M	科学研究和技术服务业	70,354,694.90	2.28
N	水利、环境和公共设施管理业	91,868,187.44	2.98
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	40,495,064.48	1.31
S	综合	-	-
	合计	2,834,113,003.75	91.85

8.3 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

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	300006	莱美药业	4,005,169	160,206,760.00	5.19
2	002049	同方国芯	2,364,531	149,485,649.82	4.84
3	600211	西藏药业	3,300,096	144,478,202.88	4.68
4	002111	威海广泰	4,452,637	135,137,532.95	4.38
5	000998	隆平高科	5,548,614	131,779,582.50	4.27
6	000547	航天发展	6,237,548	118,825,289.40	3.85
7	002234	民和股份	6,034,668	108,503,330.64	3.52
8	000876	新希望	6,156,610	108,417,902.10	3.51

9	600536	中国软件	2,575,744	92,932,843.52	3.01
10	600172	黄河旋风	3,663,721	92,728,778.51	3.01

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（<http://www.jsfund.cn>）的年度报告正文。

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	300251	光线传媒	417,028,896.33	10.31
2	002376	新北洋	388,507,483.06	9.61
3	000969	安泰科技	312,794,395.43	7.73
4	000712	锦龙股份	304,576,172.72	7.53
5	601021	春秋航空	298,547,581.65	7.38
6	601857	中国石油	293,729,343.43	7.26
7	300157	恒泰艾普	286,828,224.25	7.09
8	600115	东方航空	280,012,715.25	6.92
9	600880	博瑞传播	238,318,936.54	5.89
10	000998	隆平高科	226,735,265.23	5.61
11	002074	国轩高科	211,440,729.00	5.23
12	000547	航天发展	209,060,016.99	5.17
13	002234	民和股份	208,861,476.62	5.16
14	600588	用友网络	206,840,527.15	5.11
15	002063	远光软件	206,783,317.88	5.11
16	000920	南方汇通	206,123,547.76	5.10
17	300450	先导智能	199,403,083.33	4.93
18	300224	正海磁材	197,684,933.92	4.89
19	002714	牧原股份	193,859,528.60	4.79
20	000999	华润三九	185,987,484.64	4.60
21	601111	中国国航	179,830,335.10	4.45
22	000970	中科三环	179,375,627.46	4.44
23	601766	中国中车	178,361,120.90	4.41
24	000807	云铝股份	175,765,419.09	4.35
25	600688	上海石化	170,351,958.58	4.21
26	000796	凯撒旅游	169,636,663.73	4.19

27	601328	交通银行	167,920,224.46	4.15
28	601336	新华保险	165,483,453.11	4.09
29	000002	万科A	163,315,680.44	4.04
30	300369	绿盟科技	160,069,296.92	3.96
31	600519	贵州茅台	159,714,415.57	3.95
32	601166	兴业银行	152,881,983.93	3.78
33	601006	大秦铁路	152,471,590.38	3.77
34	601992	金隅股份	148,788,489.61	3.68
35	601333	广深铁路	147,952,429.83	3.66
36	300295	三六五网	147,874,724.55	3.66
37	300142	沃森生物	147,394,729.00	3.64
38	002111	威海广泰	144,469,812.77	3.57
39	000060	中金岭南	144,186,568.39	3.57
40	300186	大华农	142,633,970.96	3.53
41	000681	视觉中国	142,129,667.19	3.51
42	300337	银邦股份	142,051,994.42	3.51
43	600211	西藏药业	141,153,367.72	3.49
44	601398	工商银行	140,290,532.06	3.47
45	002403	爱仕达	138,929,439.89	3.44
46	300070	碧水源	138,520,648.79	3.43
47	601628	中国人寿	138,212,530.07	3.42
48	600559	老白干酒	137,536,018.71	3.40
49	600074	保千里	137,024,357.27	3.39
50	600547	山东黄金	134,223,138.65	3.32
51	300006	莱美药业	130,818,297.14	3.23
52	002664	信质电机	130,504,108.10	3.23
53	000728	国元证券	127,181,482.83	3.14
54	300232	洲明科技	126,870,830.17	3.14
55	000733	振华科技	126,623,756.95	3.13
56	300291	华录百纳	124,575,508.32	3.08
57	600172	黄河旋风	119,632,548.43	2.96
58	600366	宁波韵升	118,023,223.19	2.92
59	000166	申万宏源	117,608,865.07	2.91
60	600583	海油工程	116,541,229.37	2.88
61	600090	啤酒花	116,315,305.59	2.88
62	300124	汇川技术	115,765,531.72	2.86

63	600654	中安消	113,176,243.19	2.80
64	002292	奥飞动漫	112,100,264.09	2.77
65	002477	雏鹰农牧	110,307,234.58	2.73
66	000876	新希望	109,938,191.11	2.72
67	300228	富瑞特装	109,175,624.67	2.70
68	300176	鸿特精密	109,042,102.82	2.70
69	300065	海兰信	108,215,373.48	2.68
70	600340	华夏幸福	107,225,171.34	2.65
71	002049	同方国芯	105,481,048.85	2.61
72	300143	星河生物	105,117,844.15	2.60
73	002192	*ST 融捷	104,749,060.41	2.59
74	601788	光大证券	104,692,553.53	2.59
75	600096	云天化	101,684,012.01	2.51
76	000975	银泰资源	98,745,899.55	2.44
77	600436	片仔癀	97,110,980.30	2.40
78	000024	招商地产	93,827,107.50	2.32
79	002055	得润电子	91,336,150.18	2.26
80	601601	中国太保	89,862,224.00	2.22
81	300072	三聚环保	89,012,098.34	2.20
82	002153	石基信息	88,858,435.52	2.20
83	603588	高能环境	87,396,904.89	2.16
84	300054	鼎龙股份	87,336,846.98	2.16
85	002170	芭田股份	86,805,424.99	2.15
86	000783	长江证券	86,156,172.10	2.13
87	300388	国祯环保	85,722,136.20	2.12
88	002572	索菲亚	85,448,078.61	2.11
89	600536	中国软件	85,077,559.23	2.10
90	600606	绿地控股	84,875,067.65	2.10
91	002086	东方海洋	82,928,229.31	2.05
92	600029	南方航空	81,635,722.25	2.02

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300251	光线传媒	394,815,435.93	9.76
2	601021	春秋航空	346,162,553.34	8.56
3	002376	新北洋	341,551,621.61	8.45
4	600588	用友网络	335,958,242.80	8.31
5	000783	长江证券	299,735,979.76	7.41
6	002063	远光软件	295,859,588.04	7.32
7	600115	东方航空	292,317,564.56	7.23
8	300157	恒泰艾普	277,142,832.19	6.85
9	000712	锦龙股份	276,456,307.82	6.84
10	601857	中国石油	267,822,343.49	6.62
11	300124	汇川技术	261,975,394.60	6.48
12	300224	正海磁材	258,552,790.27	6.39
13	002714	牧原股份	245,562,072.03	6.07
14	002074	国轩高科	230,697,123.91	5.70
15	000969	安泰科技	225,925,376.36	5.59
16	002366	台海核电	213,992,802.37	5.29
17	000975	银泰资源	212,863,061.83	5.26
18	601166	兴业银行	206,593,561.52	5.11
19	000807	云铝股份	201,020,695.59	4.97
20	000681	视觉中国	200,175,025.91	4.95
21	300070	碧水源	199,090,806.05	4.92
22	600074	保千里	197,543,415.79	4.88
23	000728	国元证券	194,075,623.49	4.80
24	300291	华录百纳	192,192,439.56	4.75
25	000970	中科三环	190,936,049.46	4.72
26	600547	山东黄金	188,819,259.71	4.67
27	300450	先导智能	186,853,169.91	4.62
28	600880	博瑞传播	185,473,821.14	4.59
29	601933	永辉超市	183,151,508.01	4.53
30	000920	南方汇通	181,678,064.96	4.49
31	601111	中国国航	181,620,863.87	4.49
32	600559	老白干酒	178,344,792.69	4.41
33	601766	中国中车	178,054,277.26	4.40
34	601398	工商银行	174,858,834.05	4.32
35	000998	隆平高科	170,771,181.67	4.22
36	600340	华夏幸福	169,196,992.48	4.18
37	601600	中国铝业	168,772,737.45	4.17
38	601328	交通银行	166,628,151.48	4.12

39	600366	宁波韵升	166,408,703.14	4.11
40	601333	广深铁路	166,332,653.76	4.11
41	600436	片仔癀	165,678,907.78	4.10
42	601006	大秦铁路	163,738,519.84	4.05
43	000002	万科A	163,395,647.62	4.04
44	601336	新华保险	162,544,971.36	4.02
45	601601	中国太保	160,930,394.92	3.98
46	300142	沃森生物	160,917,260.62	3.98
47	300369	绿盟科技	159,515,293.53	3.94
48	300186	大华农	153,571,888.37	3.80
49	300065	海兰信	151,719,825.85	3.75
50	601788	光大证券	151,458,777.98	3.74
51	601628	中国人寿	151,283,732.95	3.74
52	300388	国祯环保	151,252,262.72	3.74
53	002403	爱仕达	148,115,340.49	3.66
54	002292	奥飞动漫	147,648,066.46	3.65
55	000401	冀东水泥	141,366,085.46	3.50
56	600519	贵州茅台	137,574,468.20	3.40
57	600654	中安消	136,172,205.34	3.37
58	600217	*ST 秦岭	133,055,101.15	3.29
59	000999	华润三九	131,656,849.15	3.26
60	600036	招商银行	129,045,036.16	3.19
61	600392	盛和资源	128,171,128.23	3.17
62	300295	三六五网	126,224,122.06	3.12
63	600875	东方电气	124,855,228.00	3.09
64	300337	银邦股份	124,147,822.27	3.07
65	300143	星河生物	122,593,114.69	3.03
66	000733	振华科技	122,581,428.35	3.03
67	000796	凯撒旅游	121,506,517.18	3.00
68	002385	大北农	119,285,585.93	2.95
69	000630	铜陵有色	119,282,071.66	2.95
70	002664	信质电机	119,009,865.77	2.94
71	600688	上海石化	117,480,802.91	2.90
72	000060	中金岭南	117,220,335.19	2.90
73	601992	金隅股份	115,379,882.88	2.85
74	600999	招商证券	115,250,454.14	2.85
75	002155	湖南黄金	112,480,293.90	2.78
76	002456	欧菲光	112,281,125.88	2.78

77	600096	云天化	110,504,734.44	2.73
78	600030	中信证券	108,563,385.16	2.68
79	600015	华夏银行	107,802,026.65	2.67
80	002477	雏鹰农牧	106,075,486.33	2.62
81	600029	南方航空	104,883,011.87	2.59
82	300072	三聚环保	102,563,532.15	2.54
83	000166	申万宏源	102,491,223.28	2.53
84	600606	绿地控股	98,940,201.18	2.45
85	002283	天润曲轴	97,728,813.40	2.42
86	002086	东方海洋	94,523,431.07	2.34
87	002234	民和股份	93,359,585.51	2.31
88	600643	爱建集团	92,178,762.36	2.28
89	600583	海油工程	91,381,373.88	2.26
90	600000	浦发银行	91,256,697.72	2.26
91	600172	黄河旋风	90,494,764.90	2.24
92	002572	索菲亚	89,824,569.09	2.22
93	600098	广州发展	89,567,107.81	2.21
94	603077	和邦生物	86,534,515.81	2.14
95	000625	长安汽车	85,647,446.71	2.12
96	000024	招商地产	85,643,395.14	2.12
97	600489	中金黄金	85,005,793.30	2.10
98	300079	数码视讯	83,649,156.37	2.07
99	600666	奥瑞德	83,526,974.20	2.07
100	300041	回天新材	83,454,864.51	2.06
101	000802	北京文化	82,528,602.96	2.04
102	601688	华泰证券	82,392,180.74	2.04
103	600581	八一钢铁	81,567,076.73	2.02
104	000758	中色股份	81,358,209.04	2.01

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	21,615,804,238.63
卖出股票收入（成交）总额	23,957,171,969.63

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”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	-	-
3	金融债券	150,177,000.00	4.87
	其中：政策性金融债	150,177,000.00	4.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
	合计	150,177,000.00	4.87

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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	150413	15 农发 13	800,000	80,088,000.00	2.60
2	150311	15 进出 11	600,000	60,060,000.00	1.95
3	150211	15 国开 11	100,000	10,029,000.00	0.33

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。

8.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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、处罚。

8.12.2

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。

8.12.3 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	2,999,430.42
2	应收证券清算款	5,005,985.59
3	应收股利	-
4	应收利息	2,497,903.09
5	应收申购款	7,544,572.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	18,047,891.21

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002049	同方国芯	149,485,649.82	4.84	重大事项停牌
2	000876	新希望	108,417,902.10	3.51	重大事项停牌

§ 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

54,444	7,969.32	15,941,211.72	3.67%	417,940,224.19	96.33%
--------	----------	---------------	-------	----------------	--------

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	89,580.66	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 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
本报告期期初基金份额总额	782,238,397.58
本报告期基金总申购份额	133,291,607.40
减：本报告期基金总赎回份额	481,648,569.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	433,881,435.91

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、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

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2015年3月12日，本基金管理人发布《关于嘉实服务增值行业混合基金经理变更的公告》，陈勤先生不再担任本基金基金经理，聘请焦云女士担任本基金基金经理。

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 137,000.00 元，该审计机构已连续 12 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

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
广发证券股份有限公司		54,155,830,085.40	9.12%	2,909,104.97	9.12%	-
海通证券股份有限公司		23,886,731,748.39	8.53%	2,720,734.54	8.53%	-
中信建投证券		23,437,648,012.43	7.54%	2,406,365.66	7.54%	-

股份有限公司						
东兴证券股份 有限公司	13,429,550,001.34	7.53%	2,400,685.03	7.53%	-	
兴业证券股份 有限公司	33,259,872,401.31	7.15%	2,281,916.74	7.15%	-	
安信证券股份 有限公司	32,963,078,132.00	6.50%	2,074,154.71	6.50%	-	
华创证券有限 责任公司	22,822,220,528.45	6.19%	1,975,569.09	6.19%	-	
民生证券股份 有限公司	22,727,549,892.01	5.99%	1,909,299.44	5.99%	-	
中信证券股份 有限公司	32,402,963,653.82	5.27%	1,682,084.94	5.27%	-	
国泰君安证券 股份有限公司	42,186,015,990.21	4.80%	1,530,222.40	4.80%	-	
光大证券股份 有限公司	12,028,959,130.15	4.45%	1,420,271.36	4.45%	-	
宏信证券有限 责任公司	21,947,849,221.26	4.27%	1,363,501.49	4.27%	新增 1 个	
长江证券股份 有限公司	11,580,839,870.04	3.47%	1,106,596.08	3.47%	-	
东方证券股份 有限公司	41,241,203,998.35	2.72%	868,848.14	2.72%	新增 2 个	
申万宏源证券 有限公司	21,198,952,635.86	2.63%	839,269.71	2.63%	-	
招商证券股份 有限公司	21,179,703,259.94	2.59%	825,800.46	2.59%	-	
齐鲁证券有限 公司	11,006,740,629.55	2.21%	704,723.87	2.21%	-	
中银国际证券 有限责任公司	2 761,729,856.35	1.67%	533,214.78	1.67%	-	
中国银河证券 股份有限公司	2 662,799,365.25	1.45%	463,961.96	1.45%	-	
中国国际金融 有限公司	2 660,642,202.97	1.45%	462,451.38	1.45%	-	
新时代证券有 限责任公司	1 659,992,261.15	1.45%	461,994.59	1.45%	-	
国元证券股份 有限公司	1 411,137,151.93	0.90%	287,796.00	0.90%	-	
国信证券股份 有限公司	1 318,259,759.95	0.70%	222,781.82	0.70%	-	
瑞银证券有限 责任公司	1 308,183,119.12	0.68%	215,728.18	0.68%	-	

宏源证券股份 有限公司	1	210,054,841.69	0.46%	147,038.39	0.46%	-
方正证券股份 有限公司	3	90,591,155.41	0.20%	63,413.81	0.20%	-
东北证券股份 有限公司	2	33,877,303.93	0.07%	23,714.11	0.07%	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	新增 1 个
华西证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限 责任公司	4	-	-	-	-	-
天源证券经纪 有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	3	-	-	-	-	-
浙商证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国民族证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券	2	-	-	-	-	-

有限责任公司						
中信证券（浙江）有限责任公司	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，能及时提供准确的信息资讯服务。

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：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中航证券有限公司退租上海交易单元 1 个。

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
2016 年 3 月 29 日