

嘉实服务增值行业证券投资基金

2016 年第 3 季度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2016 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

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 10 月 20 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代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 嘉实服务增值行业混合 |
| 交易代码 | 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 428,303,371.27 份 |
| 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 |
| 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 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2016年7月1日—2016年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 121,591,378.19 |
| 2. 本期利润 | -148,921,615.38 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.3452 |
| 4. 期末基金资产净值 | 2,679,606,412.77 |
| 5. 期末基金份额净值 | 6.256 |

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。

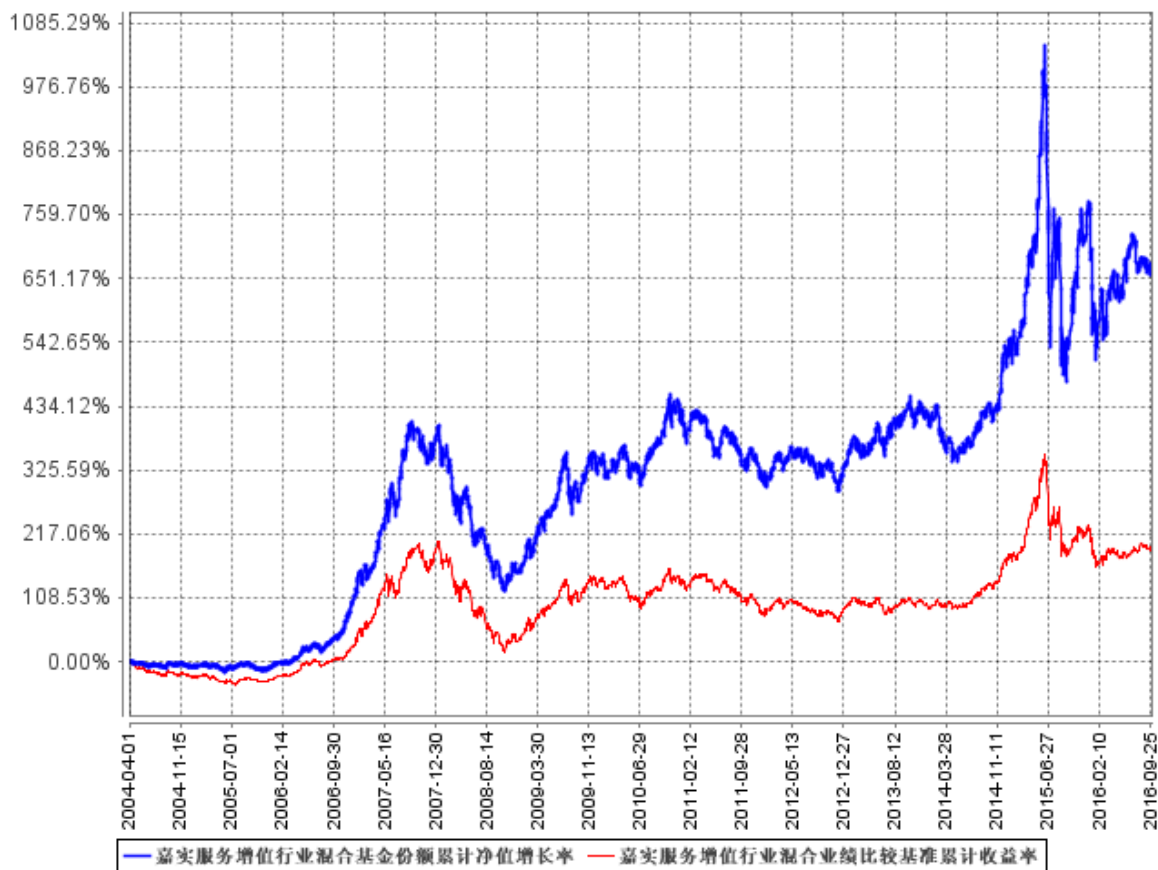
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 ④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -5.24% | 1.02% | 2.94% | 0.64% | -8.18% | 0.38% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

(2004 年 4 月 1 日至 2016 年 9 月 30 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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业年 | 说明 |
|----|----|-------------|-------|----|
|----|----|-------------|-------|----|

| | | 任职日期 | 离任日期 | 限 | |
|----|---------|-----------------|------|------|---|
| 焦云 | 本基金基金经理 | 2015 年 3 月 12 日 | - | 12 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。 |

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，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；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投资组合。

4.3.2 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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

上证综指报收 3004 点左右，涨幅 2.4%，沪深 300 涨幅 3.15%，创业板指数下跌 3.5%。本季度指数波动幅度不大，以结构性行情为主。主题方面，PPP 由于业绩逐步进入兑现期而表现卓著，而二季度表现相对较好的板块包括农业、半导体、计算机等在三季度表现相对较差，体现出明显的熊市特征。

从宏观经济角度来看，通胀下行，汇率平稳，部分短端利率在央行干预下小幅回升，同时地产价格飙升，存在行政调控压力。

三季度我们对于市场的结构性行情把握不够，在熊市反转行情下没有能够及时转向，对当期业绩造成一定压力。

4.5 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 6.256 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.24%，业绩比较基准收益率为 2.94%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 2,523,007,379.19 | 92.85 |
| | 其中：股票 | 2,523,007,379.19 | 92.85 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 140,000,000.00 | 5.15 |
| | 其中：债券 | 140,000,000.00 | 5.15 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 51,029,765.52 | 1.88 |
| 8 | 其他资产 | 3,292,960.35 | 0.12 |
| 9 | 合计 | 2,717,330,105.06 | 100.00 |

5.2 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、渔业 | 53,867,384.31 | 2.01 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 1,849,467,261.21 | 69.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 83,180,986.35 | 3.10 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 70,204,095.30 | 2.62 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 227,929,641.16 | 8.51 |
| J | 金融业 | 131,439,071.76 | 4.91 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 106,918,939.10 | 3.99 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,523,007,379.19 | 94.16 |

5.3 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 | 000911 | 南宁糖业 | 8,356,451 | 186,599,550.83 | 6.96 |
| 2 | 000547 | 航天发展 | 8,096,037 | 130,589,076.81 | 4.87 |
| 3 | 300359 | 全通教育 | 4,690,290 | 125,934,286.50 | 4.70 |
| 4 | 300232 | 洲明科技 | 6,745,580 | 111,706,804.80 | 4.17 |
| 5 | 300302 | 同有科技 | 3,437,975 | 101,970,338.50 | 3.81 |
| 6 | 600211 | 西藏药业 | 2,037,473 | 100,162,172.68 | 3.74 |
| 7 | 002023 | 海特高新 | 5,530,032 | 90,969,026.40 | 3.39 |
| 8 | 002450 | 康得新 | 5,023,651 | 90,827,610.08 | 3.39 |
| 9 | 000525 | 红太阳 | 5,288,086 | 84,556,495.14 | 3.16 |
| 10 | 000651 | 格力电器 | 3,641,500 | 80,914,130.00 | 3.02 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 140,000,000.00 | 5.22 |
| | 其中：政策性金融债 | 140,000,000.00 | 5.22 |
| 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 | - | - |
| 10 | 合计 | 140,000,000.00 | 5.22 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 160209 | 16 国开 09 | 1,400,000 | 140,000,000.00 | 5.22 |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

5.6 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

报告期末，本基金未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|----|-------|
|----|----|-------|

| | | |
|---|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,041,664.17 |
| 2 | 应收证券清算款 | 143,973.89 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,829,449.62 |
| 5 | 应收申购款 | 277,872.67 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,292,960.35 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 000547 | 航天发展 | 130,589,076.81 | 4.87 | 重大事项停牌 |
| 2 | 300359 | 全通教育 | 125,934,286.50 | 4.70 | 重大事项停牌 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 433,208,047.70 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 9,061,685.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 13,966,361.43 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 428,303,371.27 |

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 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招募说明书》；
- (4) 《嘉实服务增值行业证券投资基金基金托管协议》；
- (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。

8.2 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

8.3 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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016 年 10 月 25 日