

嘉实服务增值行业证券投资基金 2006年第四季度报告

1.1 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2007年1月18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。

基金投资人认购或申购基金份额获得的基金份额净值，均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。

本报告期为2006年10月1日起至2006年12月31日止。本报告期的财务资料未经审计。

1.2 基金产品概况

(1) 基金简称	嘉实服务增值行业基金(深交所净值揭示代码：嘉实服务)
(2) 基金代码	070006(深交所净值揭示代码：160706)
(3) 基金运作方式	契约型开放式
(4) 基金合同生效日	2004年4月1日
(5) 报告期末基金份额总额	2,130,190,942.12份
(6) 投资目标	在力争实现本金安全和流动性前提下超过行业比较基准，在追求长期稳定的前提下争取相对收益。

在全面评估证券市场阶段性的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上，通过资产配置比例的调整，调整资产配置，同时根据合同约定的弹性，适时地调整投资策略，提高回报率。

(7) 投资策略

本基金在充分评估证券市场的系统性风险和预测证券市场中长期预期收益率的基础上，通过资产配置比例的调整，调整资产配置，同时根据合同约定的弹性，适时地调整投资策略，提高回报率。

(8) 业绩比较基准

投资基准指数=中证行业指数×80%+中债国债指数×20%

(9) 风险收益特征

本基金属于中等风险证券投资基金。

(10) 基金管理人

嘉实基金管理有限公司

(11) 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

单位：元

序号	主要财务指标	2006年10月1日至2006年12月31日
1	基金本期净收益	562,631,467.52
2	基金本期份额净值	0.2480
3	期末基金资产净值	4,116,896,629.84
4	期末基金份额净值	1.933

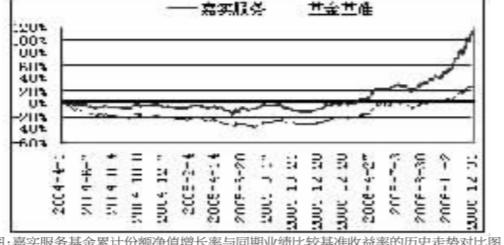
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

(1) 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)	收益差额(④)	①-③	②-④
过去三个月	49.87%	1.55%	24.25%	1.09%	26.62%	0.46%

(2) 自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动进行比较



图：嘉实服务增值行业证券投资基金 2006年第四季度报告净值走势图

3.3 资产负债表

截至2006年12月31日，本基金总资产为4,116,896,629.84元，总负债为1,160,000.00元，净资产为4,115,736,629.84元。

3.4 报告期内按行业分类的股票投资组合

单位：元

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例	备注
1	060095	深证交易所债券	24,286,484.64	1.00%	被动持有
2	060018	国债	562,631,467.52	98.99%	
3	060019	企业债	317,991,406.69	7.55%	
4	060048	可转换债券	2,486,484.60	0.06%	
5	060050	货币市场基金	187,285,406.21	4.48%	
6	060051	短期融资券	2,130,190,942.12	51.61%	
7	060052	权证	0.00	0.00%	
8	060053	资产支持证券	0.00	0.00%	
9	060054	股票	0.00	0.00%	
10	060055	其他资产	0.00	0.00%	

3.5 报告期内按行业分类的债券投资组合情况

单位：元

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例	备注
1	060095	深证交易所债券	24,286,484.64	1.00%	被动持有
2	060018	国债	562,631,467.52	98.99%	
3	060019	企业债	317,991,406.69	7.55%	
4	060048	可转换债券	2,486,484.60	0.06%	
5	060050	货币市场基金	187,285,406.21	4.48%	
6	060051	短期融资券	2,130,190,942.12	51.61%	
7	060052	权证	0.00	0.00%	
8	060053	资产支持证券	0.00	0.00%	
9	060054	股票	0.00	0.00%	
10	060055	其他资产	0.00	0.00%	

3.6 报告期内按行业分类的股票投资组合

单位：元

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例	备注
1	060095	深证交易所债券	24,286,484.64	1.00%	被动持有
2	060018	国债	562,631,467.52	98.99%	
3	060019	企业债	317,991,406.69	7.55%	
4	060048	可转换债券	2,486,484.60	0.06%	
5	060050	货币市场基金	187,285,406.21	4.48%	
6	060051	短期融资券	2,130,190,942.12	51.61%	
7	060052	权证	0.00	0.00%	
8	060053	资产支持证券	0.00	0.00%	
9	060054	股票	0.00	0.00%	
10	060055	其他资产	0.00	0.00%	

3.7 报告期内按行业分类的债券投资组合情况

单位：元

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例	备注
1	060095	深证交易所债券	24,286,484.64	1.00%	被动持有
2	060018	国债	562,631,467.52	98.99%	
3	060019	企业债	317,991,406.69	7.55%	
4	060048	可转换债券	2,486,484.60	0.06%	
5	060050	货币市场基金	187,285,406.21	4.48%	
6	060051	短期融资券	2,130,190,942.12	51.61%	
7	060052	权证	0.00	0.00%	
8	060053	资产支持证券	0.00	0.00%	
9	060054	股票	0.00	0.00%	
10	060055	其他资产	0.00	0.00%	

3.8 报告期内按行业分类的股票投资组合

单位：元

序号	代码	债券名称	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例	备注
1	060095	深证交易所债券	24,286,484.64	1.00%	被动持有
2	060018	国债	562,631,467.52	98.99%	
3	060019	企业债	317,991,406.69	7.55%	
4	060048	可转换债券	2,486,484.60	0.06%	
5	060050	货币市场基金	187,285,406.21	4.48%	
6	060051	短期融资券	2,130,190,942.12	51.61%	
7	060052	权证			