

嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

2018年第三季度报告

图：嘉实中证医药卫生ETF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
(2014年6月13日至2018年9月30日)

注：按基金合同和招募说明书约定，本基金自基金合同生效之日起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“(十二)投资范围和(七)投资限制”的有关约定。

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理年限	证券从业年限	说明
刘彤	基金经理	2016年03月24日	9年	2006年加入嘉实基金管理有限公司，曾任投资管理部高级研究员及基金经理。现任投资管理部基金经理。
何昊	基金经理	2014年6月13日	12年	2009年加入嘉实基金管理有限公司，曾任投资管理部高级研究员及基金经理。现任投资管理部基金经理。

注：(1)基金经理何昊任职日期指本基金基金合同生效之日起日；基金经理刘彤任职日期是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 管理人报告期内基金运作遵守信情况的说明
报告期内，本基金管理人严格遵守了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证医药卫生交易型开放式指数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，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，并未获得投资信息和投资建议实施投资决策方面享有不公平的机会；通过完善交易内公平交易制度的公平交易执行机制，严格的流程控制，持续的技术支持，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超过该证券当日成交量5%的，合计5次，均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
本报告期内，本基金日均跟踪误差率为0.04%，年化跟踪误差率为0.63%，符合基金合同约定的日均跟踪误差率不超过0.2%的限制。

本基金的跟踪标的指数为中证医药卫生行业指数，是中证行业指数系列的组成部分。中证行业指数的跟踪指数为中证医药卫生行业指数，是以行业内全部股票作为样本编制行业指数，能够反映沪深两个市场A股中不同行业公司股票的整体表现，为投资者提供行业投资及分析工具。中证行业系列跟踪的全市场覆盖度及个股集中度较低，具备较强的行业代表性及

投资性。

本基金主要采取完全复制法及其指数化投资技术构建基金的投资投资组合，以达到有效跟踪标的指数的目的；并根据标的指数成份及权重的变动对投资组合进行适时调整。

本基金作为一只投资于中证医药卫生指数的被动投资管理产品，继续秉承量化被动投资逻辑，积极应对市场波动，给投资者提供一个标准化的中证医药卫生行业指数的投资工具，进一步降低本基金跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证医药卫生行业指数的投资工具。

截至本报告期末本基金的业绩净值为1.4725元；本报告期基金份额净值增长率为-12.90%，业绩比较基准收益率为-12.90%。

4.6 报告期内基金持有人人数或基金资产净值披露说明
报告期内，本基金2018年7-9月2018-9-30连续三个工作日基金资产净值低于五千万，未达到连续20个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情况。

鉴于基金资产净值的下降主要受市场环境影响，本基金将继续运作。

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)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	54,130,748.00	98.34
2	固定收益	14,740,748.00	26.84
3	应收股利	-	-
4	应收利息	-	-
5	其他资产	-	-
6	资产支持证券	-	-
7	负债和净负债	-	-
8	未分配利润	-	-
9	其他	-	-
10	合计	54,130,748.00	100.00

注：股票投资的公允价值包含衍生金融资产公允价值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
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	81,581.04	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	国防军工、医药和生物产业	-	-
P	教育	-	-
Q	综合和其他行业	703,291.26	1.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	14,130,748.00	26.12

5.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2.2 报告期末非股权投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,706,127.60	21.62
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	1,322,569.40	2.45
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息技术业	227,269.20	0.42
J	金融业	-	-
K			