

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:2015年10月27日

基金管理人的董事会及董事保证本报告不存在虚假记载、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2015年10月23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。

本报告期的财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证医药卫生ETF
场内简称	医药卫生
基金代码	612610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年1月13日
报告期末基金份额总额	69,640,597.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年化跟踪误差不超过0.5%。
投资策略	本基金采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及权重进行复制,并定期调整,但本基金在被动式指数化投资时,基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合,以达到跟踪标的指数的目的。
业绩比较基准	中证医药卫生指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、同类基金基本相同的收益与风险特征。
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

报告期(2015年7月1日 - 2015年9月30日)	
1.本期已实现收益	4,676,082.92
2.本期利润	-27,556,476.26
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4052
4.期末基金份额净值	82,154,701.50
5.期末基金份额净值	82,154,701.50

注: (1) 本期已实现收益指本基金本期利息收入、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,计价费用实际影响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(%)	净值增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率标准差(%)	① - ③	② - ④
过去三个月	-22.25%	3.30%	-23.89%	3.64%	1.14%	-0.34%

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



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

嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

2015年9月30日

2015 第三季度报告

(2014年6月13日至2015年9月30日)

注:按本基金合同和招募说明书的约定,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(十三)(二)投资范围和(七)投资限制)的有关规定。

§ 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	证券从业年限	说明
何丽	嘉实中证医药卫生ETF基金经理	2014年6月13日	9年	曾任彭士达(Alexander Investments Inc.)、富兰克林坦能投资管理公司(Franklin Templeton Investments Corp.)、2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,担任公司指数投资部指数投资总监,现任公司指数投资部指数投资总监。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1) 本基金基金经理任职日期是指本基金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(十三)(二)投资范围和(七)投资限制)的有关规定。

(2) 本基金基金经理不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计价费用实际影响收益水平要低于所列数字。

4.2 公平交易制度的专项说明

4.2.1 公平交易制度的执行情况

报告报告期内,基金管理人严格按照证监会《证券投资基金公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资决策委员会和流程独立决策,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;通过公平交易制度和流程独立决策,并定期对公平交易制度的执行情况进行评估,确保公平交易制度的执行情况。

基金管理人将采取有效措施,以确保旗下不同投资组合之间公平对待。

基金管理人将通过制度、流程和系统的安排,确保旗下不同投资组合之间公平对待。

基金管理人将通过制度、流程和系统的安排,确保旗下不同投资组合之间公平对待。