

嘉实中证医药生物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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
例如	姓名	2014年6月13日	-	9年	曾任职于巴克莱银行投资管理公司(Bank of America Investment Management Co.), 2007年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部,现任公司数量化策略部基金经理助理,硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。

注:(1)基金经理任职日期是指本基金基金合同生效之日;(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遵规守信情况的说明
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、《嘉实中证医药生物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未超过该证券当日成交量的5%,不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,本基金日均跟踪误差为0.24%,年化度拟合偏差度为5.43%,本季度初市场发生剧烈震荡,报告期内市场持续多日发生巨幅波动,且指数成份股停牌股票比例较大及基金申购赎回等因素,导致了报告期内基金的跟踪误差与正常市场情况相比较大。

本基金跟踪的标的为中证医药生物行业指数,是中证行业指数系列的组成部分。中证行业指数将中证800指数800只样本股按行业进行分类,再以各行业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。中证行业系列指数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它指数投资技术构建基金的股票投资组合,以达到有效跟踪标的指数的目的;并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行适时调整。

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1.3775元;本报告期基金份额净值增长率为-22.75%,业绩比较基准收益率为-23.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
本基金作为一只投资于中证医药生物指数的被动投资管理产品,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对指数成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,力争进一步降低本基金的跟踪误差,给投资者提供一个标准化的中证医药生物行业指数的投资工具。

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	80,754,317.58	97.96
2	固定收益投资	-	-
3	其中:股票	80,754,317.58	97.96

注:本基金投资于权益资产的比例不低于90%。

4.2 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.3 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.4 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.5 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.6 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.7 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.8 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.9 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.10 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.11 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.12 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.13 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.14 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.15 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.16 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.17 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.18 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.19 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.20 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.21 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.22 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.23 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.24 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.25 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.26 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.27 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.28 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.29 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.30 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.31 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.32 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.33 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.34 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.35 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.36 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.37 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.38 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.39 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.40 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.41 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.42 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.43 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.44 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.45 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.46 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.47 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.48 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.49 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.50 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.51 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.52 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.53 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.54 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.55 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.56 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.57 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.58 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.59 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

4.60 报告期内基金投资组合资产变动情况
报告期内,本基金投资组合资产变动情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	80,754,317.58	97.96
2	固定收益投资	-	-
3	其中:股票	80,754,317.58	97.96
4	债券投资	-	-
5	其中:中期票据	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,069,962.43	2.02
7	其他资产	88,025.30	0.12
8	合计	82,522,305.31	100.00

§ 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	69,636,518.34	84.76
D	电力、热力、燃气及生产和服务业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	525,090.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	8,386,872.72	10.21
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	住宿业、餐饮业和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,265,830.52	2.68
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	80,754,317.58	98.30

§ 2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票投资。

§ 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

5.3.1 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	600046	中顺洁柔	105,708	8,386,872.72	10.21
2	600207	瑞昌股份	115,744	5,346,215.26	6.53
3	600538	云南铜业	51,363	3,396,582.00	4.00
4	600566	海南橡胶	56,100	2,763,347.00	3.36
5	600196	复星医药	112,900	4,744,768.00	5.71
6	600252	上海莱士	54,370	2,266,350.00	2.76
7	700423	东阿阿胶	51,546	2,148,427.28	2.62
8	600536	天士力	63,896	2,117,996.56	2.58
9	000230	达安基因	47,760	2,096,664.00	2.55
10	600897	通化东宝	78,140	1,751,117.50	2.13

§ 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

报告期末,本基金未持有股票投资。

§ 4 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

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

报告期末,本基金未持有股票投资。

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

报告期末,本基金未持有债券。

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	82,571,188
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,281.23
5	其他应收款	-
6	其他资产	15,124.19
7	负债	-
8	其他负债	-
合计		98,025.30

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

5.11.5.1 报告期末指数投资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	流通受限的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	受限原因说明
1	600046	中顺洁柔	8,386,872.72	10.21	重大事项停牌
2	000066	海南橡胶	2,763,347.00	3.36	重大事项停牌
3	000230	达安基因	2,096,664.00	2.55	重大事项停牌