嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

2017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:2017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2017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2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2基金产品概况

基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)
场内简称	中期企债
基金主代码	160720
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年2月5日
报告期末基金份额总额	490,367,513.28份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为被动式指数基金,主要采用代表性分层抽样复制策略,投资于标的指数中具有代表性的部分成份债券,或选择非成份债券作为替代,综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合,并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及银行间和交易所债券交易特性及交易撮例等情况,通过"久期匹配"、"信用等级匹配"、"期限匹配"等优化策略对基金资产进行抽样化调整,降低交易成本,以期在规定的风险承受限度之内,尽量控制跟踪误差最小化。
业绩比较基准	中证中期企业债指数×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用代表性分层抽样复制策略跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。
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
下属分级基金的基金简称	嘉实中证中期企业债指数(LOF)A / 嘉实中证中期企业债指数(LOF)C
下属分级基金的交易代码	160720 / 160721
报告期末下属分级基金的份额总额	480,636,881.98份 / 9,730,631.30份

§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(2017年7月1日-2017年9月30日)	
	嘉实中证中期企业债指数(LOF)A	嘉实中证中期企业债指数(LOF)C
1.本期已实现收益	-3,366,635.66	-83,608.68
2.本期利润	2,868,966.09	57,709.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057	0.0051
4.期末基金资产净值	516,360,274.27	10,532,582.13
5.期末基金份额净值	1.0743	1.0824

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)嘉实中证中期企业债指数(LOF)A收取认(申)购费,嘉实中证中期企业债指数(LOF)C不收取认(申)购费但计提销售服务费。(3)所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

嘉实中证中期企业债指数(LOF)A

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	0.52%	0.06%	0.85%	0.03%	-0.33%	0.03%

嘉实中证中期企业债指数(LOF)C

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	0.47%	0.05%	0.85%	0.03%	-0.38%	0.02%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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1.嘉实中证中期企业债指数(LOF)A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

(2018年2月5日至2017年9月30日)

图2.嘉实中证中期企业债指数(LOF)C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

(2018年2月5日至2017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"第十五部分(二)投资范围和(七)投资禁止行为与限制"的有关约定。

§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
		任职日期	离任日期		
胡永青	本基金、嘉实稳固收益债券、嘉实信用债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实元和、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新常态混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新思路混合、嘉实稳丰纯债、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实稳泽纯债债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳鹏纯债债券、嘉实稳怡债券、嘉实稳悦纯债债券、嘉实新添辉定期混合基金经理	2015年12月15日		14年	曾任天安保险股份有限公司固定收益组合经理,信诚基金管理有限公司投资经理,国泰基金管理有限公司固定收益部总监助理,基金经理。2013年11月加入嘉实基金管理有限公司,现任固定收益业务体系全回报策略组长,硕士研究生,具有基金从业资格。
王亚洲	本基金、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳泰债券、嘉实稳盛债券、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实稳康纯债债券、嘉实稳华纯债债券、嘉实稳愉债券基金经理	2015年7月9日		5年	曾任国泰基金管理有限公司债券研究员,2014年6月加入嘉实基金管理有限公司固定收益业务体系任研究员,具有基金从业资格,中国国籍。
曲扬	本基金、嘉实债券、嘉实稳固收益债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新常态混合、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合、嘉实稳丰纯债、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实稳泽纯债债券、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳鹏纯债债券、嘉实稳怡债券、嘉实稳悦纯债债券、嘉实新添辉定期混合基金经理	2015年4月18日		13年	曾任中信基金任债券研究员和债券交易员,光大银行债券自营投资业务副主管,2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理,现任职于固定收益业务体系全回报策略组,硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。

注:(1)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管理人对报告期内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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)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

2017年三季度经济再度出现季中平平季末较好的情况,流动性整体仍相对较紧,尤其在季末,资金利率中枢明显抬升;债券收益率整体来看呈现震荡走势,部分品种小幅走高。

基本面方面,7月受到基数因素、财政投放力度减弱、环保压力等原因,经济数据整体偏弱,但8-9月在海外基本面明显向好的带动下,叠加国内制造业和房地产表现尚可,带动整体经济预期稳中向好;上半年信贷投放较快,市场起初普遍对下半年信贷额度持谨慎态度,但三季度来看整体信贷和社融增速依然相对稳健,债券发行量有所回升,对实体经济的资金支持仍保持一定力度,不过未来有下行压力。流动性和监管方面,7月流动性整体较为宽松,但央行的态度没有明显改变、非银债券配置仓位提高、存单到期量较大等扰动,8-9月资金面的紧张程度超出市场的预期。

在基本面和流动性没有趋势性变化的情况下,债券市场逐步修复6-7月的乐观情绪,收益率整体上扬10-20bp,其中前期利差压缩较为明显的超长期利率债收益率上行20-30bp,中低等级信用债由于流动性较弱,估值调整幅度不大,接近季末收益率再度有小幅的下行。

组合操作层面,仍以跟踪标的指数为主,适度降低组合杠杆。

报告期内本基金日均跟踪误差为0.04%(A类、C类),年度化拟合偏离度为0.74%(A类)、0.71%(C类),符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的限制。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中证中期企业债指数(LOF)A基金份额净值为10743元,本报告期基金份额净值增长率为0.52%;截至本报告期末嘉实中证中期企业债指数(LOF)C基金份额净值为10824元,本报告期基金份额净值增长率为0.47%;同期业绩比较基准收益率为0.85%。

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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	631,969,936.20	97.97
	其中:债券	631,969,936.20	97.97
	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	882,732.96	0.14
8	其他资产	12,183,280.80	1.89
9	合计	645,035,949.96	100.00

5.2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。

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

报告期末,本基金未持有股票。

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	19,878,000.00	3.77
2	央行票据	-	-
3	金融债券	39,702,000.00	7.54
	其中:政策性金融债	39,702,000.00	7.54
4	企业债券	259,093,936.20	49.17
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	313,296,000.00	59.46
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	631,969,936.20	119.94

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	101653029	16东方电气MTN001	400,000	38,196,000.00	7.25
2	1480580	14大连融达债	360,000	36,792,000.00	6.98
3	101456072	14津城建MTN002	300,000	31,218,000.00	5.92
4	101552013	15华润MTN001	300,000	29,646,000.00	5.63
5	101561009	15中电投MTN002	300,000	29,607,000.00	5.62

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	5,383.26
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,175,201.32
5	应收申购款	2,696.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,183,280.80

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

报告期末,本基金未持有股票。

§6开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实中证中期企业债指数(LOF)A	嘉实中证中期企业债指数(LOF)C
报告期期初基金份额总额	533,028,138.29	12,445,202.44
报告期期间基金总申购份额	35,466,567.67	1,866,351.10
减:报告期期间基金总赎回份额	87,857,823.98	4,580,922.24
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	480,636,881.98	9,730,631.30

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、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影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/07/01至2017/09/30	514,067,373.05	-	76,738,574.35		437,328,798.70	89.18
个人	-	-	-	-	-		-	-

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

(1)中国证监会批核准嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)募集的文件;

(2)《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)基金合同》;

(3)《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)招募说明书》;

(4)《嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)托管协议》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实中证中期企业债指数证券投资基金(LOF)公告的各项原稿。

9.2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

9.3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

2017年10月25日

嘉实中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金

2017年第三季度报告

2017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:2017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2017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2017年7月1日起至2017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
基金主代码	512610
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月13日
报告期末基金份额总额	14,140,597.00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2%。
投资策略	本基金采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(如流动性原因)导致无法获得足够数量的股票时,或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时,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	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	236,954.21
2.本期利润	-535,034.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0348
4.期末基金资产净值	20,877,955.89
5.期末基金份额净值	1.4765

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	-1.80%	0.64%	-1.67%	0.65%	-0.13%	-0.01%

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

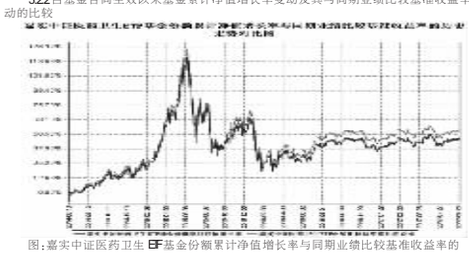

图:嘉实中证医药卫生ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年6月13日至2017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)的有关约定。

§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
		任职日期	离任日期		
何如	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF基金经理	2014年6月13日	-	11年	曾任职于IA克莱灵顿投资管理公司(IA-ClaringtonInvestmentsInc)、富兰克林坦普顿投资管理公司(FranklinTempletonInvestmentsCorp.)。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,现任指数投资部副总监,基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,加拿大籍。
刘珈吟	本基金、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实中证500ETF联接、嘉实中关村A股ETF基金经理	2016年3月24日	-	8年	2009年加入嘉实基金管理有限公司,曾任指数投资部指数研究员一职。现任指数投资部基金经理。

注:(1)基金经理何如任职日期是指本基金基金合同生效之日;基金经理刘珈吟任职日期是指公司作出决定后公告之日,离任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;(3)本基金基金经理刘珈吟女士因个人身体原因休假超过30日,在其休假期间,本基金暂由我公司基金经理陈正宪先生、何如女士代为履行基金经理职责。该事项已于2017年4月28日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露;(4)本基金基金经理刘珈吟女士已结束休假,自2017年8月10日起恢复履行基金经理职务。该事项已于2017年8月10日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上进行了披露。

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循了《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

本报告期内,本基金日均跟踪误差为0.02%,年化跟踪误差为0.32%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

本基金跟踪的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优,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地调整。

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,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卫生行业指数的投资工具。

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14765元;本报告期基金份额净值增长率为-1.80%,业绩比较基准收益率为-1.67%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至报告期末本基金连续20个工作日出现基金资产净值低于5,000万元。

§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	20,629,517.22	96.31
	其中:股票	20,629,517.22	96.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	436,682.01	2.04
8	其他资产	354,308.75	1.65
9	合计	21,420,507.98	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	17,497,779.83	83.81
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	2,164,036.40	10.37
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	179,334.60	0.86
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	184,827.20	0.89
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	603,522.00	2.89
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,629,500.03	98.81

5.2.2报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	采掘业	-	-
C	制造业	17.19	0.00
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	-	-
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	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17.19	0.00

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

5.3.1报告期末指数投资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	600276	恒瑞医药	34,960	2,095,152.80	10.04
2	600518	康美药业	61,500	1,234,920.00	5.91
3	000538	云南白药	10,853	984,367.10	4.71
4	600196	复星医药	20,900	714,571.00	3.42
5	000423	东阿阿胶	10,846	704,230.78	3.37
6	002252	上海莱士	30,806	641,072.86	3.07
7	601607	上海医药	23,900	567,386.00	2.72
8	000963	华东医药	10,100	495,607.00	2.37
9	600535	天士力	13,466	473,329.90	2.27
10	000623	吉林敖东	19,260	432,387.00	2.07

5.3.2报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002399	海普瑞	1	17.19	0.00

注:报告期末,本基金仅持有上述1只积极投资股票。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末,本基金未持有债券。

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	1,306.89
2	应收证券清算款	352,944.34
3	应收股利	-
4	应收利息	57.52
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	354,308.75

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

报告期末,本基金指数投资前十名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

5.11.5.2报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金积极投资前五名股票中未持有存在流通受限情况的股票。

§6开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	16,640,597.00
报告期期间基金总申购份额	-
减:报告期期间基金总赎回份额	2,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	14,140,597.00

§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影响投资者决策的其他重要信息

8.1报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况						报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额		持有份额	份额占比(%)
机构	1	2017/08/02至2017/09/30	3,133,100.00	-	-		3,133,100.00	22.16
个人	1	2017/08/17至2017/09/30	2,952,000.00	-	-		2,952,000.00	20.88

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回,基金管理人可能无法及时变现基金资产,可能对基金份额净值产生一定的影响;极端情况下可能引发基金的流动性风险,发生暂停赎回或延缓支付赎回款项;若个别投资者巨额赎回后本基金出现连续六十