

嘉实医疗保健股票型证券投资基金 2015 年年度报告摘要

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

送出日期：2016 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。董事 Bernd Amlung 未参会。

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 2016 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 2015 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实医疗保健股票型证券投资基金
基金简称	嘉实医疗保健股票
基金主代码	000711
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 8 月 13 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
报告期末基金份额总额	1,351,552,552.50 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金优选医疗保健行业股票，在严格控制投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为股票型基金，淡化大类资产配置，主要通过医疗保健子行业间的灵活配置和行业内个股的精选实现基金资产的保值增值。
业绩比较基准	中证医药卫生指数收益率×95%+中国债券总指数收益率×5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	王永民
	联系电话	(010) 65215588	(010) 66594896
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010) 65182266	(010) 66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015 年	2014 年 8 月 13 日(基金合同生效日)-2014 年 12 月 31 日
本期已实现收益	100,262,720.15	4,239,542.69
本期利润	168,100,212.23	-36,437,438.41
加权平均基金份额本期利润	0.1322	-0.0269
本期加权平均净值利润率	9.79%	-2.65%
本期基金份额净值增长率	52.63%	-3.10%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	196,378,695.25	-41,535,271.67
期末可供分配基金份额利润	0.1453	-0.0305
期末基金资产净值	1,998,560,577.61	1,320,036,733.51
期末基金份额净值	1.479	0.969
3.1.3 累计期末指标	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	47.90%	-3.10%

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）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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	29.96%	2.01%	19.87%	1.81%	10.09%	0.20%
过去六个月	-6.81%	3.57%	-7.23%	2.78%	0.42%	0.79%
过去一年	52.63%	3.02%	41.32%	2.47%	11.31%	0.55%
自基金合同生效起至今	47.90%	2.61%	54.23%	2.18%	-6.33%	0.43%

注：本基金业绩比较基准为：中证医药卫生指数收益率×95%+中国债券总指数收益率×5%

中证医药卫生指数是中证 800 指数 800 只样本股中按行业分类标准选出的医药卫生行业全部股票作为样本编制指数，涵盖全市场医药行业股票中的较好投资标的。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

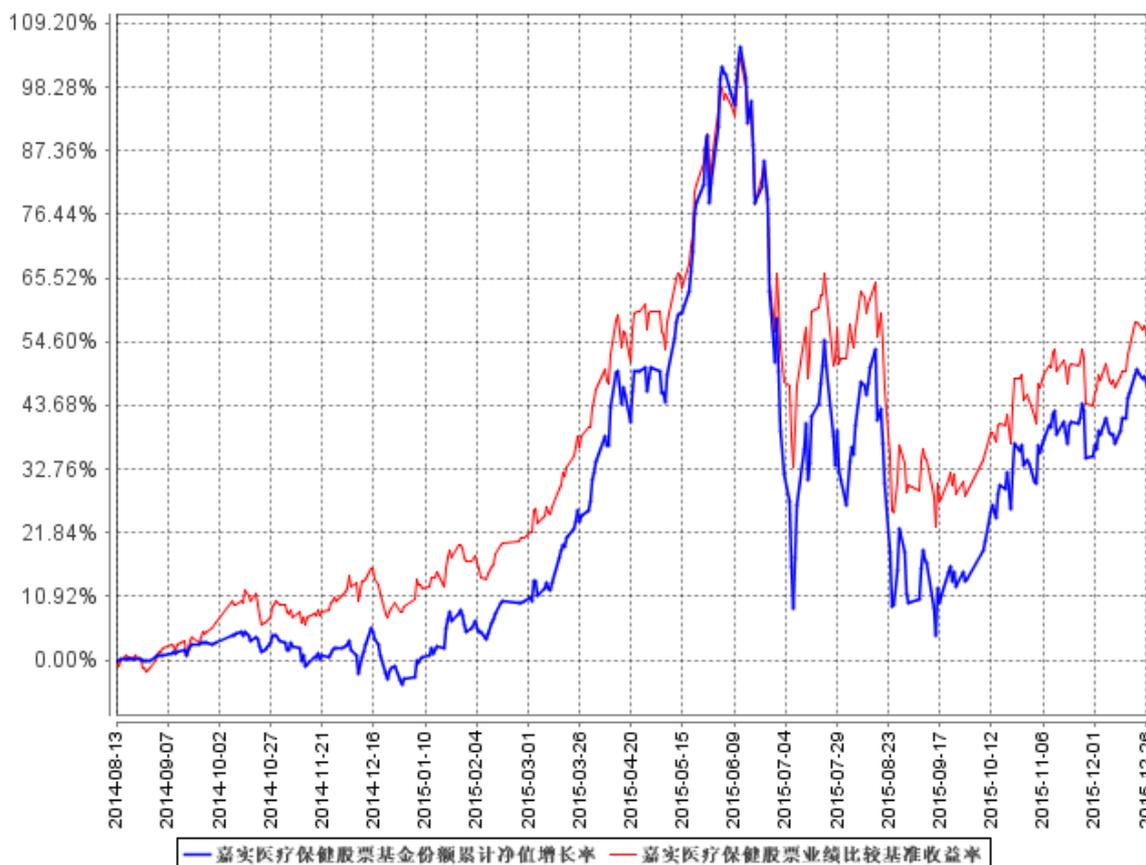
$$\text{Return}(t) = 95\% * (\text{中证医药卫生指数}(t) / \text{中证医药卫生指数}(t-1) - 1) + 5\% * (\text{中国债券总指数}(t) / \text{中国债券总指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) * \text{Benchmark}(t-1)$$

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

嘉实医疗保健股票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



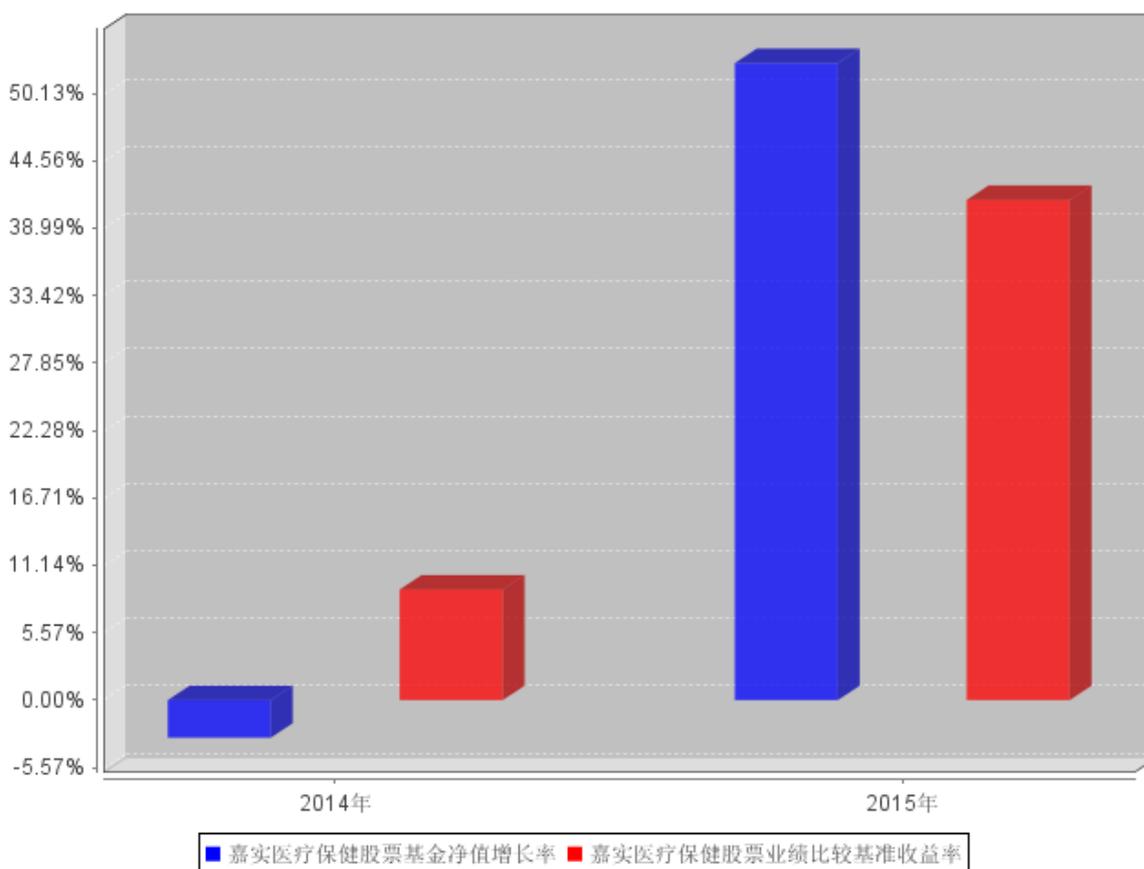
图：嘉实医疗保健股票基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014 年 8 月 13 日至 2015 年 12 月 31 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（十二（二）投资范围和（四）投资限制）的有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实医疗保健股票自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同生效日为 2014 年 8 月 13 日，2014 年度的相关数据根据当年实际存续期（2014 年 8 月 13 日至 2014 年 12 月 31 日）计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2015 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 2 只封闭式证券投资基金、79 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实丰和价值封闭、嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300 ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳固收益债券、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数 (LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、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、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期开放混合、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实机构快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券 3 只开放式基金属于嘉实理财通系列基金，同时，管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
齐海滔	本基金、嘉实主题新动力股票基金经理	2014年8月13日	-	12年	曾任长城证券有限责任公司行业研究员，任银华基金管理有限公司研究员、天华证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金基金经理。2011年4月加盟嘉实基金管理有限公司，曾任投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

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循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实医疗保健股票型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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投

资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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 5 次，均为旗下组合被动跟踪标的指数的需要而和其他组合发生反向交易，不存在利益输送等异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年，A 股市场波动巨大，1-5 月市场大幅上涨，但 6 月中旬开始，融资清理引发市场流动性边际收紧，戳破了估值泡沫，引发市场大跌，9 月之后市场出现反弹，但经济下行、人民币贬值等风险因素压制了指数上行的空间。报告期内，上证 50 下跌 6.23%，沪深 300 上涨了 5.58%，中小板指数上涨了 53.7%，创业板指数上涨了 84.41%。分行业看，成长型行业整体表现更好，而低估值价值型行业表现较差。

2015 年，医药生物（申万）上涨了 56.68%，在成长型行业中排名中游，行业内部的表现与全市场的表现基本一致，成长性更好的子行业和个股整体表现更好，医疗服务、精准医疗、跨界转型等方向上的个股全年涨幅巨大。

由于对 2015 年医药行业的投资机会比较乐观，报告期内，本基金仓位一直维持在 90% 以上，

结构上主要按照 3 个方向来配置,即强劲的内生增长、行业变革期受益的环节以及有模式创新的公司,具体到医药子行业上,超配了医药商业、生物医药、低配了中药,在 11 月份,由于医疗服务等子行业估值过高,医药白马股长期滞涨,组合做了一定的调整,提高了传统白马股的配置比例。

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 1.479 元;本报告期基金份额净值增长率为 52.63%,业绩比较基准收益率为 41.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2016 年的市场环境,预计政策效果会逐渐显现,工业生产反弹,消费链条上的经济活动会出现一定的改善,但是由于需求的疲弱,出口和投资链条难以出现明显改善,利润的增长主要取决于供给侧改革的力度和效果,人民币贬值的趋势已经形成,但预计幅度可控,总体判断,2016 年的经济环境相对平稳,不会出现系统性风险,也不会有大规模刺激,缓慢去杠杆,无风险利率继续下行,美国首次加息落定后,市场风险偏好相对稳定,资金延续存量博弈。

在市场整体估值较高的背景下,A 股大概率是调整的走势,赚钱的机会是结构性的。估值过高的中小盘公司(其实,从市值角度看,已不能称其为小公司,但从利润角度看很小)将在供给量大增(注册制)以及减持的压力下去伪存真,但是,估值有优势的真正的成长股依旧会有不错的收益,2016 年,GARP 选股策略可能更有优势。

对于 2016 年的医药行业投资而言,与市场的情况类似,全年看,GARP 型的个股可能更好。在医药行业(以制药为代表)增速放缓的大背景下,增速突出以及远景较好的细分子行业的配置价值会显得更加突出,如医疗服务、生物制药、精准治疗等,只是,由于目前这部分行业内的个股估值均已较高,且鱼龙混杂,2016 年这些方向的个股也将严重分化。传统医药白马股的相对收益机会在变大,一方面是传统医药白马股估值较为合理,另一方面,预计一批白马股会有积极变化,正向的变化会提升白马股的估值,预计 2016 年传统的 GARP 型白马股的正收益机会更大。

在主题选择上,我们认为,国企改革、并购重组、转型是主要的三条线索,我们将在其中仔细的研究、选择个股,以控制组合的风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、监察稽核等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十六（三）基金收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实医疗保健股票证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

嘉实医疗保健股票型证券投资基金 2015 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师许康玮、洪磊签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2016)第 20341 号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实医疗保健股票型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	122,998,935.38	117,993,202.80
结算备付金		212,021.02	6,593,415.21
存出保证金		1,068,119.86	780,518.59
交易性金融资产	7.4.7.2	1,882,435,310.81	1,206,212,511.95
其中：股票投资		1,882,435,310.81	1,206,212,511.95
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	28,635.95	31,852.83
应收股利		-	-
应收申购款		1,824,786.53	4,078,815.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,008,567,809.55	1,335,690,316.88
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,980.00	9,820,746.16
应付赎回款		6,129,903.01	2,816,381.95
应付管理人报酬		2,509,765.06	1,720,248.83
应付托管费		418,294.18	286,708.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	543,221.98	803,084.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	404,067.71	206,414.15
负债合计		10,007,231.94	15,653,583.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,351,552,552.50	1,361,572,005.18
未分配利润	7.4.7.10	647,008,025.11	-41,535,271.67
所有者权益合计		1,998,560,577.61	1,320,036,733.51
负债和所有者权益总计		2,008,567,809.55	1,335,690,316.88

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.479 元，基金份额总额 1,351,552,552.50 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实医疗保健股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 8 月 13 日(基 金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		205,239,761.39	-25,086,327.05
1. 利息收入		942,110.02	4,352,986.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	942,110.02	818,883.98
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,534,102.50
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		110,184,710.10	8,859,355.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	104,485,618.78	8,859,355.34
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,699,091.32	-
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	67,837,492.08	-40,676,981.10
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	26,275,449.19	2,378,312.23
减：二、费用		37,139,549.16	11,351,111.36
1. 管理人报酬		25,569,497.48	7,930,159.99
2. 托管费		4,261,582.84	1,321,693.33
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	6,857,063.09	1,878,094.79
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	451,405.75	221,163.25
三、利润总额		168,100,212.23	-36,437,438.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润		168,100,212.23	-36,437,438.41

注：本基金合同生效日为 2014 年 8 月 13 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2014 年 8 月 13 日至 2014 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实医疗保健股票型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,361,572,005.18	-41,535,271.67	1,320,036,733.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	168,100,212.23	168,100,212.23
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-10,019,452.68	520,443,084.55	510,423,631.87
其中：1. 基金申购款	3,622,991,949.81	1,755,860,835.65	5,378,852,785.46
2. 基金赎回款	-3,633,011,402.49	-1,235,417,751.10	-4,868,429,153.59
四、本期向基金份额持有	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动			
五、期末所有者权益（基金净值）	1,351,552,552.50	647,008,025.11	1,998,560,577.61
项目	上年度可比期间 2014年8月13日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,390,457,737.32	-	1,390,457,737.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-36,437,438.41	-36,437,438.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-28,885,732.14	-5,097,833.26	-33,983,565.40
其中：1. 基金申购款	582,788,932.77	12,395,619.94	595,184,552.71
2. 基金赎回款	-611,674,664.91	-17,493,453.20	-629,168,118.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,361,572,005.18	-41,535,271.67	1,320,036,733.51

注：本基金合同生效日为 2014 年 8 月 13 日，上年度可比期间是指自基金合同生效日 2014 年 8 月 13 日至 2014 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>赵学军</u>	<u>王红</u>	<u>常旭</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致，会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有

限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 8 月 13 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	25,569,497.48	7,930,159.99
其中：支付销售机构的客户维护费	8,902,376.01	3,715,709.84

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 8 月 13 日(基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
----	---	---

当期发生的基金应支付的托管费	4,261,582.84	1,321,693.33
----------------	--------------	--------------

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	7,860,849.05	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	7,860,849.05	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.58%	-

注：（1）本报告期内（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日），基金管理人于 2015 年 7 月 7 日申购本基金基金份额 7,860,849.05 份，申购费 1000 元。（2）上年度可比期间（2014 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日），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。

7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2015 年 12 月 31 日）及上年度末（2014 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		2014 年 8 月 13 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	122,998,935.38	864,707.89	117,993,202.80	641,891.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2014 年 8 月 13 日（基金合同生效日）至 2014 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.5 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000028	国药一致	2015 年 10 月 21 日	重大事项停牌	69.68	-	-	2,570,918	172,398,340.97	179,141,566.24	-
002020	京新药业	2015 年 12 月 29 日	重大事项停牌	33.55	2016 年 1 月 20 日	30.20	1,337,739	34,668,135.75	44,881,143.45	-
300049	福瑞股份	2015 年 11 月 30 日	重大事项停牌	31.00	2016 年 1 月 4 日	30.95	673,290	26,905,856.65	20,871,990.00	-
600420	现代制药	2015 年 10 月 21 日	重大事项停牌	41.77	-	-	1,674,523	75,547,224.19	69,944,825.71	-
600530	交大昂立	2015 年 8 月 4 日	重大事项停牌	23.04	2016 年 1 月 21 日	23.51	1,180,088	33,019,416.50	27,189,227.52	-
600645	中源协和	2015 年 12 月 30 日	重大事项停牌	65.01	2016 年 1 月 4 日	63.90	9,980	345,611.45	648,799.80	-
600781	辅仁药业	2015 年 9 月 22 日	重大事项停牌	24.43	2016 年 1 月 6 日	21.30	1,299,950	25,641,715.00	31,757,778.50	-

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购**

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末（2015 年 12 月 31 日），本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 8 投资组合报告**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,882,435,310.81	93.72
	其中：股票	1,882,435,310.81	93.72
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	123,210,956.40	6.13
7	其他各项资产	2,921,542.34	0.15
	合计	2,008,567,809.55	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,351,293,502.76	67.61
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	502,067,211.73	25.12
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	648,799.80	0.03
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	28,425,796.52	1.42

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,882,435,310.81	94.19

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000963	华东医药	2,384,400	195,425,424.00	9.78
2	000028	国药一致	2,570,918	179,141,566.24	8.96
3	000513	丽珠集团	1,246,795	71,603,436.85	3.58
4	600420	现代制药	1,674,523	69,944,825.71	3.50
5	600079	人福医药	3,087,584	68,729,619.84	3.44
6	600422	昆药集团	1,605,413	63,927,545.66	3.20
7	002007	华兰生物	1,354,006	59,576,264.00	2.98
8	600529	山东药玻	2,899,927	56,055,588.91	2.80
9	600511	国药股份	1,211,318	45,933,178.56	2.30
10	000952	广济药业	1,969,990	45,309,770.00	2.27

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站（<http://www.jsfund.cn>）的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000963	华东医药	158,899,125.31	12.04
2	000028	国药一致	149,096,036.82	11.29
3	000513	丽珠集团	100,508,491.21	7.61
4	600420	现代制药	93,580,535.40	7.09
5	600079	人福医药	93,391,233.62	7.07
6	600422	昆药集团	91,170,564.99	6.91
7	002007	华兰生物	65,316,534.85	4.95
8	600276	恒瑞医药	64,717,583.23	4.90
9	002462	嘉事堂	60,408,506.43	4.58
10	600085	同仁堂	59,967,635.38	4.54

11	002275	桂林三金	59,691,573.75	4.52
12	600055	华润万东	58,457,710.61	4.43
13	300119	瑞普生物	58,119,945.99	4.40
14	000661	长春高新	58,080,589.52	4.40
15	300314	戴维医疗	57,947,010.06	4.39
16	000999	华润三九	57,779,752.12	4.38
17	002262	恩华药业	57,477,085.67	4.35
18	600129	太极集团	56,114,172.80	4.25
19	600529	山东药玻	55,450,123.93	4.20
20	300298	三诺生物	54,784,767.38	4.15
21	600594	益佰制药	54,666,071.79	4.14
22	000915	山大华特	54,049,897.79	4.09
23	000411	英特集团	53,372,795.76	4.04
24	600511	国药股份	45,732,923.92	3.46
25	600436	片仔癀	45,107,548.49	3.42
26	000952	广济药业	42,486,160.28	3.22
27	002022	科华生物	39,772,074.31	3.01
28	300341	麦迪电气	39,719,775.06	3.01
29	600062	华润双鹤	39,021,322.05	2.96
30	002223	鱼跃医疗	36,582,815.19	2.77
31	600535	天士力	36,342,185.22	2.75
32	300147	香雪制药	36,121,228.13	2.74
33	000722	湖南发展	35,957,357.68	2.72
34	000538	云南白药	35,943,390.04	2.72
35	002020	京新药业	35,475,460.43	2.69
36	600530	交大昂立	34,652,995.63	2.63
37	002390	信邦制药	33,276,133.48	2.52
38	600867	通化东宝	33,275,488.73	2.52
39	000423	东阿阿胶	32,458,726.87	2.46
40	600962	*ST 中鲁	32,448,537.27	2.46
41	600521	华海药业	31,851,748.49	2.41
42	300357	我武生物	31,739,998.13	2.40
43	300006	莱美药业	31,349,889.09	2.37
44	300018	中元华电	30,849,340.50	2.34
45	300239	东宝生物	29,040,257.41	2.20
46	002412	汉森制药	28,526,548.04	2.16

47	300255	常山药业	28,140,970.65	2.13
48	600713	南京医药	27,459,017.36	2.08
49	002173	千足珍珠	27,325,131.29	2.07
50	300030	阳普医疗	27,244,228.14	2.06
51	002693	双成药业	26,728,964.67	2.02

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600276	恒瑞医药	107,914,560.13	8.18
2	000963	华东医药	97,219,337.50	7.36
3	000028	国药一致	88,991,863.48	6.74
4	300273	和佳股份	66,061,001.29	5.00
5	600422	昆药集团	63,980,408.88	4.85
6	000915	山大华特	61,851,051.05	4.69
7	002349	精华制药	61,662,748.43	4.67
8	600085	同仁堂	60,168,393.56	4.56
9	002462	嘉事堂	59,255,552.50	4.49
10	600594	益佰制药	56,871,989.28	4.31
11	600511	国药股份	50,971,797.65	3.86
12	000513	丽珠集团	50,892,632.86	3.86
13	000989	九芝堂	50,797,632.34	3.85
14	600763	通策医疗	50,153,592.26	3.80
15	600436	片仔癀	46,323,810.91	3.51
16	300314	戴维医疗	45,270,780.29	3.43
17	300199	翰宇药业	45,158,491.35	3.42
18	000661	长春高新	44,413,822.68	3.36
19	300119	瑞普生物	43,101,141.43	3.27
20	002022	科华生物	42,863,355.00	3.25
21	000566	海南海药	42,232,723.86	3.20
22	002262	恩华药业	41,128,809.79	3.12
23	300147	香雪制药	38,944,127.71	2.95
24	600535	天士力	38,490,779.97	2.92
25	600055	华润万东	37,197,574.20	2.82
26	300030	阳普医疗	36,186,802.13	2.74
27	600521	华海药业	34,695,867.14	2.63

28	000503	海虹控股	34,078,724.52	2.58
29	000538	云南白药	33,614,596.39	2.55
30	600962	*ST 中鲁	32,766,258.70	2.48
31	300168	万达信息	32,706,216.12	2.48
32	600079	人福医药	31,658,799.41	2.40
33	600420	现代制药	31,504,435.64	2.39
34	300255	常山药业	29,102,077.24	2.20
35	600212	江泉实业	29,039,122.27	2.20
36	300006	莱美药业	28,908,604.79	2.19
37	002102	冠福股份	28,541,190.85	2.16
38	300049	福瑞股份	27,707,240.98	2.10
39	300015	爱尔眼科	26,443,274.81	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,975,977,254.88
卖出股票收入（成交）总额	2,472,077,566.88

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,068,119.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,635.95
5	应收申购款	1,824,786.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	2,921,542.34

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000028	国药一致	179,141,566.24	8.96	重大事项停牌
2	600420	现代制药	69,944,825.71	3.50	重大事项停牌

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
58,376	23,152.54	208,468,192.45	15.42%	1,143,084,360.05	84.58%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	628,440.95	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2014 年 8 月 13 日) 基金份额总额	1,390,457,737.32
本报告期期初基金份额总额	1,361,572,005.18
本报告期基金总申购份额	3,622,991,949.81
减:本报告期基金总赎回份额	3,633,011,402.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,351,552,552.50

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2015 年 5 月 8 日本基金管理人发布公告，张峰先生因工作变动不再担任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 90,000.00 元，该审计机构已连续 2 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2015 年 2 月 13 日，北京证监局向我公司下发了“行政监管措施决定书”，责令公司进行为期 3 个月的整改，暂不受理公募基金注册申请，北京证监局对相关责任人采取了行政监管措施。对此公司高度重视，对公司内控制度进行了全面梳理，逐条落实整改方案，彻底排查业务中存在的风险，进而提升了公司内部控制和风险管理的能力。2015 年 5 月份，公司已经完成相关整改工作并向北京证监局提交了整改完成报告，监管部门对公司整改完成情况进行了现场检查。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券股份有限公司	3	5,244,522,549.99	96.33%	3,671,186.94	96.33%	-
国泰君安证券股份有限公司	3	103,439,888.61	1.90%	72,408.79	1.90%	-
华泰证券股份有限公司	4	96,421,404.32	1.77%	67,494.99	1.77%	-
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份	3	-	-	-	-	-

有限公司						
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	4	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	6	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	2	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国民族证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经纪有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	新增 2 个
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华创证券有限	2	-	-	-	-	-

责任公司						
广州证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
英大证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有限 责任公司	2	-	-	-	-	新增 1 个

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

注 2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

注 3：申银万国证券股份有限公司更名为申万宏源证券有限公司。

注 4：报告期内，本基金退租以下交易单元：中航证券有限公司退租上海交易单元 1 个。

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2016 年 3 月 29 日