

嘉实中证疫苗与生物技术交易型开放式指
数证券投资基金
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证疫苗与生物技术 ETF
场内简称	生物疫苗（扩位证券简称：生物疫苗 ETF）
基金主代码	562860
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 2 月 16 日
报告期末基金份额总额	590,894,966.00 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	本基金主要采取完全复制法，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（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成份股时，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。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证疫苗与生物技术指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-19,336,955.09
2. 本期利润	30,944,467.01
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0495
4. 期末基金资产净值	495,405,798.32
5. 期末基金份额净值	0.8384

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

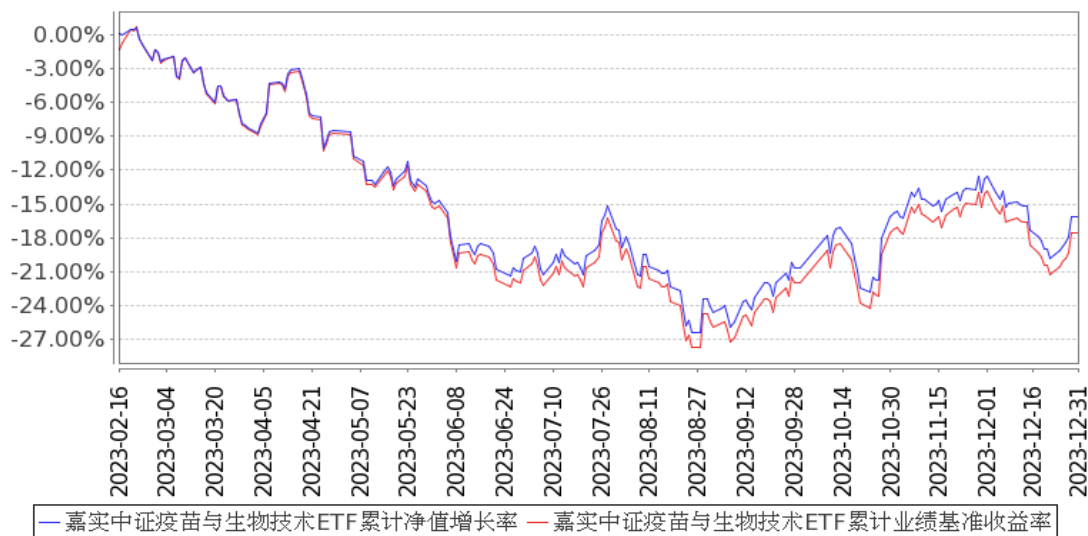
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.58%	1.31%	5.69%	1.33%	-0.11%	-0.02%
过去六个月	4.59%	1.32%	4.15%	1.34%	0.44%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	-16.16%	1.21%	-17.54%	1.23%	1.38%	-0.02%

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

嘉实中证疫苗与生物技术ETF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

(2023年02月16日至2023年12月31日)



注：(1) 本基金合同生效日2023年02月16日至报告期末未满1年。

(2) 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个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§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		
王紫菡	本基金、嘉实中证主要消费ETF、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)、嘉实沪深300红利低波动ETF、嘉实新兴科技100ETF、嘉实新兴科	2023年2月16日	-	7年	2016年6月加入嘉实基金管理有限公司，历任指数投资部投资经理助理、投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

技 100ETF 联接、嘉实 沪深 300 红利低波 动 ETF 联 接、嘉实中 证主要消 费 ETF 联 接、嘉实医 药健康 100ETF、嘉 实医药健 康 100ETF 联接、嘉实 恒生科技 ETF (QDII)、 嘉实中证 医疗指数 发起式、嘉 实国证绿 色电力 ETF、嘉实 中证细分 化工产业 主题指数 发起式、嘉 实国证绿 色电力 ETF 发起 联接、嘉实 恒生医疗 保健指数 发起式 (QDII)、 嘉实上证 科创板生 物医药 ETF 基金 经理				
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实中证疫苗与生物技术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 5 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金跟踪中证疫苗与生物技术指数，中证疫苗与生物技术指数在沪深市场中选取不超过 50 家业务涉及疫苗研发、疫苗生产、疫苗耗材、疫苗生产设备以及其他生物科技领域上市公司证券作为样本，反映沪深市场疫苗与生物技术主题上市公司证券的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

进入四季度，随着宏观调控组合政策发力显效，国内需求逐步恢复，制造业效益持续改善，我国经济回稳向上态势明显。工业企业利润加快回升，近 4 个月连续实现同比正增长。出口规模稳中向好，11 月出口数据止跌回正，预示我国出口贸易或以企稳。此外，随着“一城一策”的地产政策精准实施，近期地产高频销售数据已出现修复。同时，12 月中央经济工作会议定调 2024 年经济工作“高质量发展、以进促稳、先立后破”，强化宏观政策逆周期和跨周期调节，并加力积极的财政政策。回顾四季度海外经济，美联储在四季度暂停加息，11 月 PCE 物价指数同环比增速均超预期回落，通胀压力进一步缓和，与此同时，12 月密歇根大学消费者信心指数则触底回升，

且略好于市场判断，印证了经济的增长韧性。OPEC 原油供给侧调控的分歧为原油价格带来了下行的压力，无疑也为美联储传递鸽派言论提供了有利的宏观环境。

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年化跟踪误差为 0.39%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2% 的限制。

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 0.8384 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.58%，业绩比较基准收益率为 5.69%。

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	490,482,438.09	98.90
	其中：股票	490,482,438.09	98.90
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	5,381,834.67	1.09
8	其他资产	81,859.89	0.02
9	合计	495,946,132.65	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 93,529,089.00 元，占基金资产净值的比例为 18.88%。

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	468,414,184.58	94.55
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	15,703,544.00	3.17
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	4,797,994.76	0.97
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	488,915,723.34	98.69

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	采矿业	-	-
C	制造业	1,433,266.74	0.29
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	56,342.59	0.01
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	51,650.59	0.01
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	15,385.54	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	10,069.29	0.00
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	1,566,714.75	0.32
----	--------------	------

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	300122	智飞生物	1,191,305	72,800,648.55	14.70
2	300142	沃森生物	1,871,600	44,001,316.00	8.88
3	603392	万泰生物	443,083	33,288,825.79	6.72
4	002007	华兰生物	1,277,600	28,273,288.00	5.71
5	300601	康泰生物	780,240	21,183,516.00	4.28
6	600529	山东药玻	585,000	14,976,000.00	3.02
7	000661	长春高新	97,794	14,258,365.20	2.88
8	688180	君实生物	336,378	14,070,691.74	2.84
9	688235	百济神州	99,510	13,835,870.40	2.79
10	603087	甘李药业	262,100	13,799,565.00	2.79

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	688347	华虹公司	17,678	743,536.68	0.15
2	688548	广钢气体	2,371	30,230.25	0.01
3	688563	航材股份	477	28,853.73	0.01
4	688549	中巨芯	3,547	28,695.23	0.01
5	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.01

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	47,992.36
2	应收证券清算款	7,334.54

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	26,532.99
7	其他	-
8	合计	81,859.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300122	智飞生物	14,660,289.00	2.96	转融通出借证券
2	300142	沃森生物	8,858,568.00	1.79	转融通出借证券
3	603392	万泰生物	6,701,596.00	1.35	转融通出借证券
4	002007	华兰生物	4,738,033.00	0.96	转融通出借证券
5	300601	康泰生物	4,265,265.00	0.86	转融通出借证券
6	600529	山东药玻	3,015,680.00	0.61	转融通出借证券
7	688180	君实生物	2,831,891.00	0.57	转融通出借证券
8	688235	百济神州	2,780,800.00	0.56	转融通出借证券
9	603087	甘李药业	2,774,655.00	0.56	转融通出借证券
10	000661	长春高新	2,391,120.00	0.48	转融通出借证券

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688347	华虹公司	743,536.68	0.15	新股锁定
2	688548	广钢气体	30,230.25	0.01	新股锁定
3	688563	航材股份	28,853.73	0.01	新股锁定
4	688549	中巨芯	28,695.23	0.01	新股锁定
5	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.01	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	710,894,966.00
-------------	----------------

报告期期间基金总申购份额	2,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	122,000,000.00
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	590,894,966.00

§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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。

(2) 《嘉实中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

(3) 《嘉实中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

(4) 《嘉实中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6) 报告期内嘉实中证疫苗与生物技术交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

8.3 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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日