

嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金 (LOF) 2019 年第 3 季度报告

2019 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：2019 年 10 月 22 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 2019 年 10 月 18 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 2019 年 7 月 1 日起至 2019 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）
场内简称	新经济 HK（嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）A 类份额场内简称）
基金主代码	501311
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 14 日
报告期末基金份额总额	14,350,348.88 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，本基金力争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	恒生港股通新经济指数收益率（人民币计价）×95% + 银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金主要通过投资于恒生港股通新经济指数的成份股来实现对标的指数的紧密跟踪。因此，本基金的业绩表现与恒生港股通新经济指数的表现密切相关。本基金的长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
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	嘉实港股通新经济指数 (LOF) A	嘉实港股通新经济指数 (LOF) C
下属分级基金的交易代码	501311	006614
报告期末下属分级基金的份额总额	8,391,657.66 份	5,958,691.22 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(2019年7月1日 - 2019年9月30日)	报告期(2019年7月1日 - 2019年9月30日)
	嘉实港股通新经济指数 (LOF) A	嘉实港股通新经济指数 (LOF) C
1. 本期已实现收益	-40,161.90	-26,049.46
2. 本期利润	232,702.37	42,910.83
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0188	0.0088
4. 期末基金资产净值	8,140,473.81	5,761,988.69
5. 期末基金份额净值	0.9701	0.9670

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）嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）C 不收取认（申）购费用但收取赎回费、计提销售服务费；（3）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

嘉实港股通新经济指数 (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	0.69%	1.07%	0.69%	1.07%	0.00%	0.00%

嘉实港股通新经济指数 (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	0.59%	1.07%	0.69%	1.07%	-0.10%	0.00%

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

嘉实港股通新经济指数 (LOF) A 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

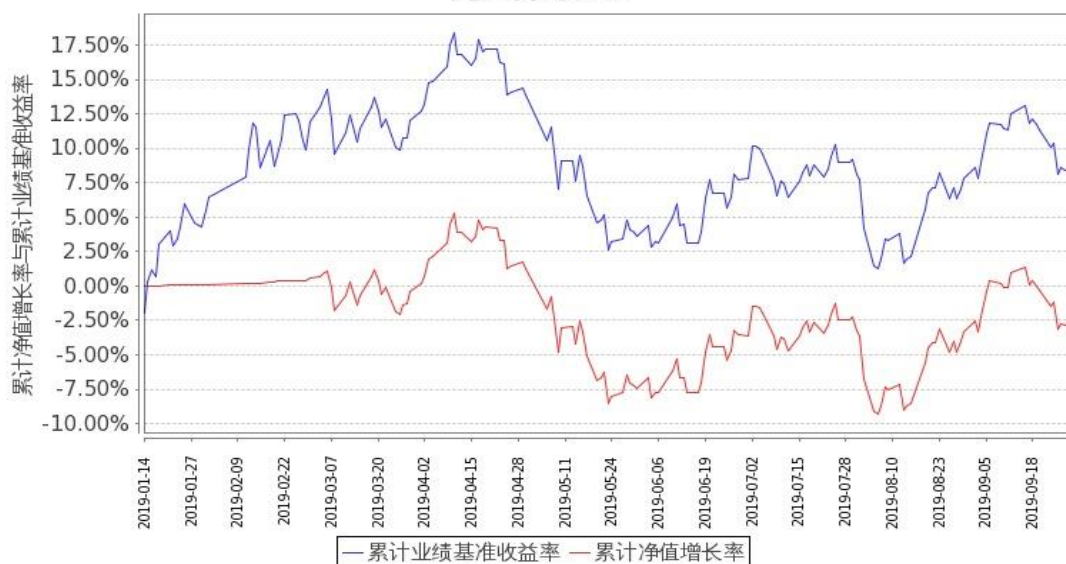


图 1：嘉实港股通新经济指数 (LOF) A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 1 月 14 日至 2019 年 9 月 30 日)

嘉实港股通新经济指数(LOF)C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 2：嘉实港股通新经济指数(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

(2019 年 1 月 14 日至 2019 年 9 月 30 日)

注：本基金基金合同生效日 2019 年 1 月 14 日至报告期末未满 1 年。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 6 个月为建仓期，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（五）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		
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、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、	2019 年 1 月 14 日	-	10 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。

	嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 基金经理				
陈正宪	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 基金经理	2019 年 1 月 14 日	-	14 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 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，现任指数投资部总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。

注：（1）基金经理的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、《嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（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，本基金未发生异常交易行为。

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 0.04%，年化跟踪误差为 0.68%，符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.35%的限制。

本基金作为一只投资于恒生港股通新经济指数的被动投资管理产品，我们秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的恒生港股通新经济指数的投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实港股通新经济指数(LOF)A 基金份额净值为 0.9701 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.69%；截至本报告期末嘉实港股通新经济指数(LOF)C 基金份额净值为 0.9670 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.59%；业绩比较基准收益率为 0.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2019/7/1 日至 2019/9/30；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响，本基金将继续运作。

§ 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	12,975,033.67	91.75
	其中：股票	12,975,033.67	91.75
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	1,138,838.63	8.05
8	其他资产	28,430.83	0.20
9	合计	14,142,303.13	100.00

注：本基金本报告期末无通过沪港通交易机制投资的港股；通过深港通交易机制投资的港股公允价值为 12,975,033.67 元，占基金资产净值的比例为 93.33%。

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

报告期末，本基金未持有境内指数投资股票。

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

报告期末，本基金未持有境内积极投资股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
非必需消费品	1,996,897.70	14.36
必需消费品	122,059.99	0.88
医疗保健	2,927,166.77	21.06
工业	1,099,723.82	7.91
信息技术	2,139,058.11	15.39
通信服务	4,052,893.30	29.15
公用事业	637,233.98	4.58
合计	12,975,033.67	93.33

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	700 HK	腾讯控股	4,400	1,310,512.29	9.43
2	941 HK	中国移动	22,000	1,286,897.67	9.26
3	2382 HK	舜宇光学科技	5,100	529,948.92	3.81
4	669 HK	创科实业	10,500	516,648.78	3.72
5	788 HK	中国铁塔	320,000	513,784.90	3.70
6	175 HK	吉利汽车	39,000	467,872.59	3.37
7	1093 HK	石药集团	32,000	454,324.40	3.27
8	1177 HK	中国生物制药	50,000	449,200.98	3.23
9	762 HK	中国联通	44,000	330,207.82	2.38
10	2269 HK	药明生物	4,500	324,723.60	2.34

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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

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	6,668.52
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	21,464.81
4	应收利息	297.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,430.83

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，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

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，本基金未持有积极投资股票。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实港股通新经济指数 (LOF) A	嘉实港股通新经济指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	13,731,116.32	4,600,057.02
报告期期间基金总申购份额	1,720,378.11	3,406,024.46
减：报告期期间基金总赎回份额	7,059,836.77	2,047,390.26
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	8,391,657.66	5,958,691.22

§ 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予注册嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）注册的批复文件。
- (2) 《嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）基金合同》；
- (3) 《嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）托管协议》；
- (4) 《嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实恒生港股通新经济指数证券投资基金（LOF）公告的各项原稿。

8.2 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

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，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 10 月 22 日