嘉实农业产业股票型证券投资基金2020年第2季度报告

2020年6月30日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2020年7月18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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 16 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 2020 年 4 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实农业产业股票
基金主代码	003634
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 7 日
报告期末基金份额总额	429,985,116.03 份
投资目标	本基金通过投资于农业产业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金所界定的农业产业股票主要是指农林牧渔行业及与其密切相关的上市公司，根据农业产业的范畴选出备选股票池，并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。同时在各个投资环节中来识别、度量和控制投资风险，并通过调整投资组合的风险结构，来优化基金的风险收益匹配。
业绩比较基准	申万农林牧渔指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%
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。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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(2020 年 4 月 1 日 - 2020 年 6 月 30 日)
1.本期已实现收益	52,360,104.50
2.本期利润	125,432,502.79
3.加权平均基金份额本期利润	0.2557
4.期末基金资产净值	761,637,856.02
5.期末基金份额净值	1.7713

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	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	18.26%	1.36%	0.86%	1.25%	17.40%	0.11%
过去六个月	33.62%	1.82%	14.52%	1.78%	19.10%	0.04%
过去一年	44.53%	1.56%	17.70%	1.52%	26.83%	0.04%
过去三年	76.20%	1.47%	33.83%	1.34%	42.37%	0.13%
自基金合同生效起至今	77.13%	1.37%	17.27%	1.26%	59.86%	0.11%

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：嘉实农业产业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

（2016 年 12 月 7 日至 2020 年 6 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（十二（二）投资范围和（四）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		
姚爽	本基金基金经理	2016 年 12 月 7 日	-	11 年	曾任中再资产农业及食品饮料研究员，中信产业基金农业及食品行业高级研究员。2014 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，现任嘉实基金农业研究员，具有基金从业资格，中国国籍。

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、《嘉实农业产业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 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

2020 年二季度，新冠疫情和影响在国内得到有效的控制，经济运行开始恢复。二季度的地产销售、投资和基建以较快速度恢复，消费也出现稳步回升，但餐饮住宿等部分行业复苏程度有限。A 股流动性总体维持宽松，社融、M2 增速维持高位，企业短期和中长期贷款都开始增加，财政政策也开始发力。新冠疫情未来的影响仍需保持关注，北京出现一些反复；而且海外疫情一直未得到控制，同时来自海外的地缘政治风险有提升迹象。市场整体表现较好。二季度上证综指上涨 8.52%，深证成指上涨 20.38%，中小板指上涨 23.24%，创业板指上涨 30.25%。肺炎疫情和海外风险对市场风格造成影响，相对确定的内需方向，如医药、消费、电子板块表现较好，周期板块表现落后。

本基金二季度仓位有所提升，持仓方向主要集中于：1）受益于集中度长期提升或周期性价格上涨的农业子行业龙头；2）食品、白酒等子行业的龙头公司。我们将继续坚持以合理的价格买入优质公司并长期持有的投资策略，力求为投资者带来长期良好的超额回报。

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 1.7713 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.26%，业绩比较基准收益率为 0.86%。

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	705,168,220.09	87.42
	其中：股票	705,168,220.09	87.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,692,605.00	4.42
	其中：债券	35,692,605.00	4.42
	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	31,801,602.40	3.94
8	其他资产	33,952,905.92	4.21
9	合计	806,615,333.41	100.00

5.2 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	151,033,483.00	19.83
B	采矿业	-	-
C	制造业	541,690,786.92	71.12
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	5,163,479.36	0.68
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	190,731.77	0.03

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,089,739.04	0.93
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	705,168,220.09	92.59

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

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	000895	双汇发展	1,510,937	69,639,086.33	9.14
2	002714	牧原股份	781,540	64,086,280.00	8.41
3	002311	海大集团	1,316,371	62,646,095.89	8.23
4	000876	新 希 望	2,037,057	60,704,298.60	7.97
5	000858	五 粮 液	316,500	54,159,480.00	7.11
6	000998	隆平高科	2,585,000	43,040,250.00	5.65
7	002100	天康生物	2,263,400	36,440,740.00	4.78
8	603609	禾丰牧业	2,312,142	34,450,915.80	4.52
9	002385	大北农	3,754,168	34,200,470.48	4.49
10	600882	妙可蓝多	898,700	32,613,823.00	4.28

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	2,859,429.00	0.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	32,833,176.00	4.31
	其中：政策性金融债	32,833,176.00	4.31
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,692,605.00	4.69

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	018007	国开 1801	327,840	32,833,176.00	4.31
2	019627	20 国债 01	28,580	2,859,429.00	0.38

注：报告期末,本基金仅持有上述 2 支债券。

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

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

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

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	288,375.55
2	应收证券清算款	8,889,167.70
3	应收股利	-
4	应收利息	1,086,834.62
5	应收申购款	23,688,528.05

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,952,905.92

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

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	323,356,206.22
报告期期间基金总申购份额	733,677,083.72
减:报告期期间基金总赎回份额	627,048,173.91
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	429,985,116.03

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。

§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 影响投资者决策的其他重要信息

2020 年 4 月 8 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实农业产业股票型证券投资基金注册的批复文件；

(2)《嘉实农业产业股票型证券投资基金基金合同》；

(3)《嘉实农业产业股票型证券投资基金托管协议》；

(4)《嘉实农业产业股票型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)报告期内嘉实农业产业股票型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

(1)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

(2)北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

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

2020 年 7 月 18 日