

嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金  
(LOF)  
2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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 2021 年 10 月 22 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 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实基本面 50 指数 (LOF)
场内简称	基本面 50LOF
基金主代码	160716
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 月 30 日
报告期末基金份额总额	701,916,236.51 份
投资目标	采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪。
投资策略	<p>本基金采取完全指数复制法，即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。但在因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时，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。</p> <p>本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。在跟踪误差允许的情况下，本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的固定收益类证券投资范围包括国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中央银行票据、短期融资券、回购（包括正回购和逆回购）、资产支持证</p>

	券等。	
业绩比较基准	95%×中证锐联基本面 50 指数收益率 + 5%×银行同业存款收益率	
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	嘉实基本面 50 指数 (LOF) A	嘉实基本面 50 指数 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	基本面 50LOF	-
下属分级基金的交易代码	160716	160725
报告期末下属分级基金的份额总额	614,798,790.81 份	87,117,445.70 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）	
	嘉实基本面 50 指数 (LOF) A	嘉实基本面 50 指数 (LOF) C
1. 本期已实现收益	29,735,704.24	981,827.16
2. 本期利润	-6,648,211.83	-232,655.46
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0106	-0.0053
4. 期末基金资产净值	1,019,694,366.73	100,723,561.67
5. 期末基金份额净值	1.6586	1.1562

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 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

嘉实基本面 50 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	-0.72%	1.10%	-3.72%	1.10%	3.00%	0.00%
过去六个月	-5.17%	0.91%	-9.81%	0.92%	4.64%	-0.01%

过去一年	5.60%	0.94%	-0.09%	0.94%	5.69%	0.00%
过去三年	10.51%	1.12%	-3.93%	1.12%	14.44%	0.00%
过去五年	46.64%	1.04%	21.39%	1.04%	25.25%	0.00%
自基金合同 生效起至今	65.86%	1.31%	26.89%	1.30%	38.97%	0.01%

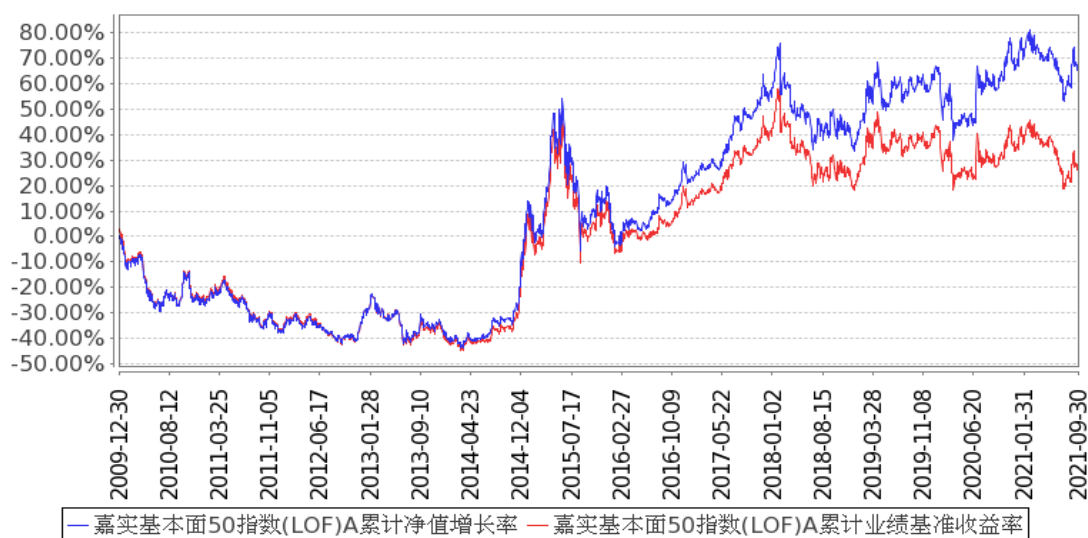
嘉实基本面 50 指数 (LOF) C

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	-0.81%	1.10%	-3.72%	1.10%	2.91%	0.00%
过去六个月	-5.35%	0.91%	-9.81%	0.92%	4.46%	-0.01%
过去一年	5.18%	0.94%	-0.09%	0.94%	5.27%	0.00%
过去三年	9.18%	1.12%	-3.93%	1.12%	13.11%	0.00%
自基金合同 生效起至今	15.62%	1.12%	1.69%	1.12%	13.93%	0.00%

### 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

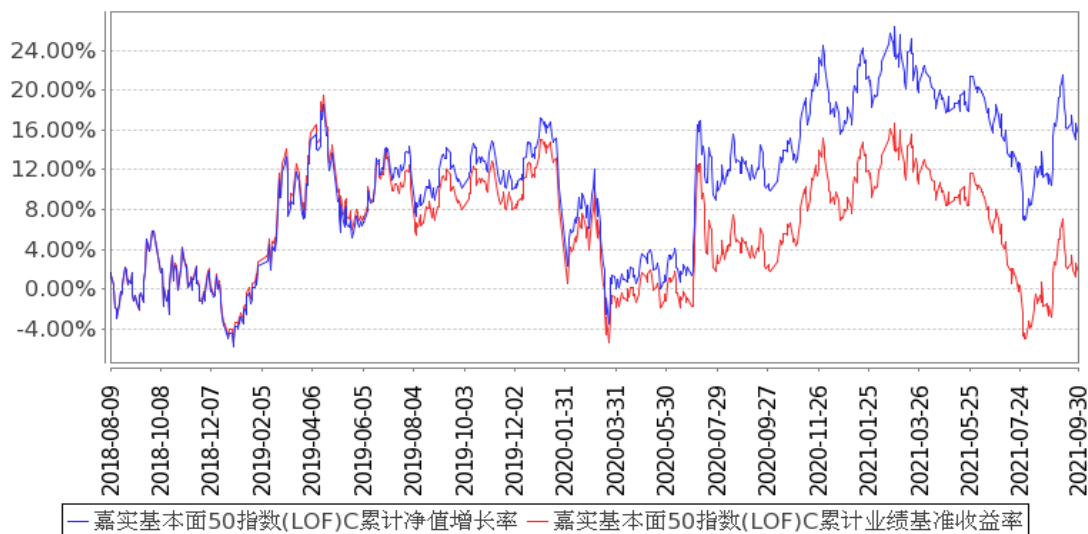
#### 嘉实基本面50指数(LOF)A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年12月30日至2021年09月30日)



### 嘉实基本面50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

(2018年08月09日至2021年09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		
李直	本基金、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)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实创业板 ETF、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实恒生科技 ETF	2021 年 9 月 24 日	-	7 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	(QDII)、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接基金经理				
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接基金经理	2016 年 1 月 5 日	2021 年 9 月 24 日	15 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。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, 现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 加拿大籍。
陈正宪	本基金基金经理	2016 年 3 月 24 日	2021 年 9 月 24 日	16 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) 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《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、《嘉实中证锐联基本面 50 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

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.09%，年化跟踪误差为 1.47%。

基本面 50 指数为首只内地基本面指数，以 4 个基本面指标（营业收入、现金流、净资产、分红）来衡量的经济规模最大的 50 家 A 股上市公司为样本。作为被动管理的指数基金，本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化投资管理策略，积极应对成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，降低基金的跟踪误差，力争投资回报与业绩基准保持一致。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实基本面 50 指数 (LOF) A 基金份额净值为 1.6586 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.72%；截至本报告期末嘉实基本面 50 指数 (LOF) C 基金份额净值为 1.1562 元，本报告期基金份额净值增长率为 -0.81%；业绩比较基准收益率为 -3.72%。

#### 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	1,063,175,033.53	94.38
	其中：股票	1,063,175,033.53	94.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,015,800.00	2.75
	其中：债券	31,015,800.00	2.75
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	26,059,329.61	2.31
8	其他资产	6,217,721.66	0.55
9	合计	1,126,467,884.80	100.00

## 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	67,709,587.23	6.04
C	制造业	164,436,944.01	14.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,746,833.93	3.82
E	建筑业	157,414,127.75	14.05
F	批发和零售业	21,444,720.00	1.91
G	交通运输、仓储和邮政业	10,301,280.72	0.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,264,231.64	2.34
J	金融业	492,948,037.17	44.00
K	房地产业	77,828,697.45	6.95
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	1,061,094,459.90	94.71

### 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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,916,842.22	0.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	61,893.34	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
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	32,194.84	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,045.28	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	8,952.62	0.00
S	综合		-
	合计	2,080,573.63	0.19

### 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	601318	中国平安	1,619,204	78,304,705.44	6.99
2	601668	中国建筑	11,076,330	53,166,384.00	4.75
3	600036	招商银行	1,047,361	52,839,362.45	4.72
4	601166	兴业银行	2,656,109	48,606,794.70	4.34
5	601398	工商银行	8,722,195	40,645,428.70	3.63
6	601328	交通银行	8,900,295	40,051,327.50	3.57
7	000002	万科 A	1,493,930	31,835,648.30	2.84
8	601669	中国电建	3,550,708	30,074,496.76	2.68
9	600028	中国石化	6,700,605	29,884,698.30	2.67
10	600016	民生银行	7,470,427	29,209,369.57	2.61

#### 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	688690	纳微科技	3,477	258,167.25	0.02
2	688789	宏华数科	1,400	237,650.00	0.02
3	688772	珠海冠宇	12,960	187,012.80	0.02
4	688097	博众精工	3,983	181,704.46	0.02
5	688700	东威科技	3,049	158,852.90	0.01

### 5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

### 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	997,800.00	0.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,018,000.00	2.68
	其中：政策性金融债	30,018,000.00	2.68
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	31,015,800.00	2.77

### 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	210201	21 国开 01	300,000	30,018,000.00	2.68
2	019658	21 国债 10	10,000	997,800.00	0.09

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

#### 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

(1) 2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】67 号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规事实，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 4880 万元。

2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）16 号），对招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2021 年 5 月 17 日作出行政处罚决定，罚款 7170 万元。

2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）71 号），对中国工商银行股份有限公司未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞、为同业投资业务提供隐性担保等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十三条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 5470 万元。

2021 年 8 月 20 日，中国人民银行银罚字（2021）26 号对兴业银行股份有限公司因违反信用

信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日作出行政处罚决定，罚款合计 5 万元。

2021 年 7 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）28 号），对交通银行股份有限公司理财业务和同业业务制度不健全等违法违规事实，于 2021 年 7 月 13 日作出行政处罚决定，罚款 4100 万元。

本基金投资于“招商银行（600036）”、“工商银行（601398）”、“兴业银行（601166）”、“交通银行（601328）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，招商银行、工商银行、兴业银行、交通银行为标的指数成份股，本基金投资于“招商银行”、“工商银行”、“兴业银行”、“交通银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。 本基金投资于“21 国开 01（210201）”的决策程序说明：基于对 21 国开 01 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“21 国开 01”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

（2）报告期内本基金投资的前十名证券中，其他五名证券发行主体无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。

### 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	37,927.30
2	应收证券清算款	172,335.09
3	应收股利	-
4	应收利息	505,972.48
5	应收申购款	5,501,486.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,217,721.66

### 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

无。

#### 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	688690	纳微科技	258,167.25	0.02	新股锁定
2	688789	宏华数科	237,650.00	0.02	新股锁定
3	688772	珠海冠宇	187,012.80	0.02	新发未上市
4	688097	博众精工	181,704.46	0.02	新股锁定
5	688700	东威科技	158,852.90	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

项目	嘉实基本面 50 指数 (LOF) A	嘉实基本面 50 指数 (LOF) C
报告期期初基金份额总额	624,904,289.96	22,603,618.74
报告期期间基金总申购份额	70,981,344.84	115,004,767.92
减：报告期期间基金总赎回份额	81,086,843.99	50,490,940.96
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	614,798,790.81	87,117,445.70

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 募集的文件；
- (2) 《嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；

- (3) 《嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证锐联基本面 50 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) 报告期内嘉实中证锐联基本面 50 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

2021 年 10 月 26 日