嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）2022年第1季度报告

2022年3月31日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2022年4月21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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 04 月 19 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证海外中国互联网 30ETF（QDII）
场内简称	中概互联网 ETF
基金主代码	159607
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	789,829,139.00 份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，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	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应的调整。 具体投资策略包括：完全复制策略、替代性策略、衍生品投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、境外市场基金投资策略等。
业绩比较基准	经估值汇率调整后的中证海外中国互联网 30 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。本基金投资于境外证券市场上市的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 本基金为股票型指数基金，跟踪中证海外中国互联网 30 指数，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，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	中国农业银行股份有限公司
境外资产托管人	英文名称：State Street Bank and Trust Company
	中文名称：道富银行

§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（2022年1月1日-2022年3月31日）
1.本期已实现收益	5,664,726.67
2.本期利润	-70,501,379.52
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1203
4.期末基金资产净值	578,846,121.51
5.期末基金份额净值	0.7329

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。

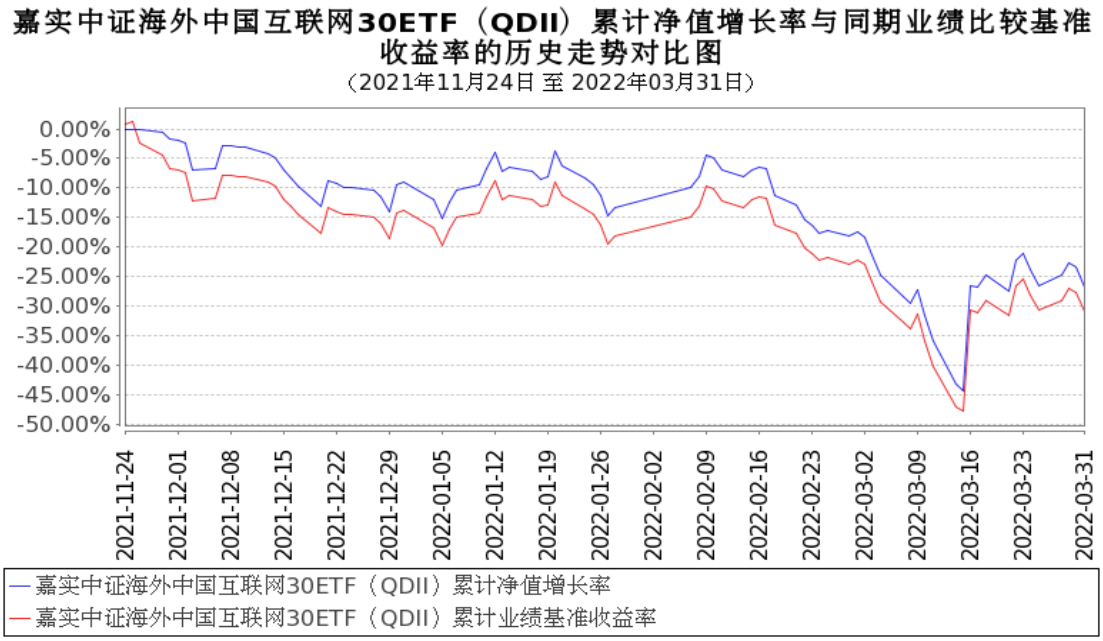
（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	-19.46%	5.36%	-20.00%	5.54%	0.54%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-26.71%	4.55%	-30.96%	4.74%	4.25%	-0.19%

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



注：（1）本基金合同生效日 2021 年 11 月 24 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 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

§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、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实恒生港股通	2021 年 11 月 24 日	-	12 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。现任指数投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	新经济指数（LOF)、嘉实央企创新驱动ETF、嘉实央企创新驱动ETF联接、嘉实中证主要消费ETF联接、嘉实H股50ETF（QDII)基金经理				
田光远	本基金、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实H股50ETF（QDII)、嘉实中证沪港深互联网ETF、嘉实中证软件服务ETF、嘉实中证稀土产业ETF、嘉实中证科创创业50ETF、嘉实中证电池主题ETF、嘉实中证稀土产业ETF联接、嘉实中证新能源ETF、嘉实中证科创创业50ETF发起联接、嘉实中证稀有金属主题ETF、嘉实中证软件服务ETF联接、嘉实中证稀有金属主题ETF发起联接、嘉实中证芯片产业指数发起式基金经理	2021年11月24日	-	6年	曾任华创证券有限责任公司资产管理部量化研究员，2017年4月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部，从事指数基金投资研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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，为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内，本基金仍处于6个月建仓期内。作为一只投资于中证海外中国互联网30指数的被动管理管理产品，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，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，进一步降低基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证海外中国互联网30指数的投资工具。

截至本报告期末本基金份额净值为0.7329元；本报告期基金份额净值增长率为-19.46%，业绩比较基准收益率为-20.00%。

4.5 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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	568,725,580.34	97.67
	其中：普通股	244,204,330.56	41.94
	优先股	-	-
	存托凭证	324,521,249.78	55.73
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	11,821,075.88	2.03
8	其他资产	1,732,808.68	0.30
9	合计	582,279,464.90	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	324,521,249.78	56.06
中国香港	244,204,330.56	42.19
合计	568,725,580.34	98.25

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
通信服务	226,144,949.46	39.07
非必需消费品	286,865,856.05	49.56
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	8,173,730.81	1.41
医疗保健	-	-

工业	-	-
信息技术	38,271,846.37	6.61
原材料	-	-
房地产	9,269,197.65	1.60
公用事业	-	-
合计	568,725,580.34	98.25

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

5.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的权益投资明细

5.4.1 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量(股)	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	138,929.00	95,956,059.66	16.58
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	298,900.00	90,710,154.66	15.67
3	Meituan	美团－W	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	576,000.00	72,687,257.86	12.56
4	JD.com Inc	京东集团	JD UW	纳斯达克证券交易所	美国	118,254.00	43,443,011.48	7.51
5	Baidu Inc	百度	BIDU UW	纳斯达克证券交易所	美国	49,205.00	41,325,648.85	7.14
6	NetEase Inc	网易	NTES UW	纳斯达克证券交易所	美国	69,804.00	39,744,307.53	6.87
7	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港证券交易所	中国香港	2,962,200.00	33,489,091.08	5.79
8	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	124,222.00	31,630,188.49	5.46

9	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港证券交易所	中国香港	329,800.00	19,846,355.47	3.43
10	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	126,366.00	18,546,786.34	3.2

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

5.4.2 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及存托凭证投资明细

无。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

5.9 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基金投资明细

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,732,808.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,732,808.68

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 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。

5.10.5.2 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

无。

5.10.6 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	513,829,139.00
报告期期间基金总申购份额	321,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	45,000,000.00
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	789,829,139.00

§7 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海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复文件。

（2）《嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

（3）《嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；

（4）《嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）招募说明书》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实中证海外中国互联网30交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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

2022年4月21日