嘉实恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）
2022年第4季度报告

2022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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023年1月20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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年01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2022年10月01日起至2022年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实H股50ETF（QDII）
场内简称	H股ETF基金
基金主代码	159823
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年9月24日
报告期末基金份额总额	52,163,219.00份
投资目标	通过主要投资于标的ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年化跟踪误差不超过3%
投资策略	1、资产配置策略:本基金主要通过投资于标的ETF实现对标的指数的紧密跟踪。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度超过投资目标所述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度进一步扩大。在投资运作过程中，本基金将在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用一级市场申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行标的ETF的买卖。本基金还将适度参与标的ETF基金份额交易和申购、赎回的组合套利，力争增强基金收益；2、股票投资策略:本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素四方面指标，在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整各市场股票的配置比例及投资策略；3、债券投资策略;4、衍生品投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、融资及转融通证券出借
业绩比较基准	恒生中国企业指数收益率（使用估值汇率折算）

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基金及股票，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，跟踪恒生中国企业指数，主要投资于标的ETF，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	招商银行股份有限公司
境外资产托管人	英文名称：Brown Brothers Harriman & Co.
	中文名称：布朗兄弟哈里曼银行

§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10月1日-2022年12月31日）
1.本期已实现收益	-11,430,858.13
2.本期利润	4,961,803.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0820
4.期末基金资产净值	36,612,572.98
5.期末基金份额净值	0.7019

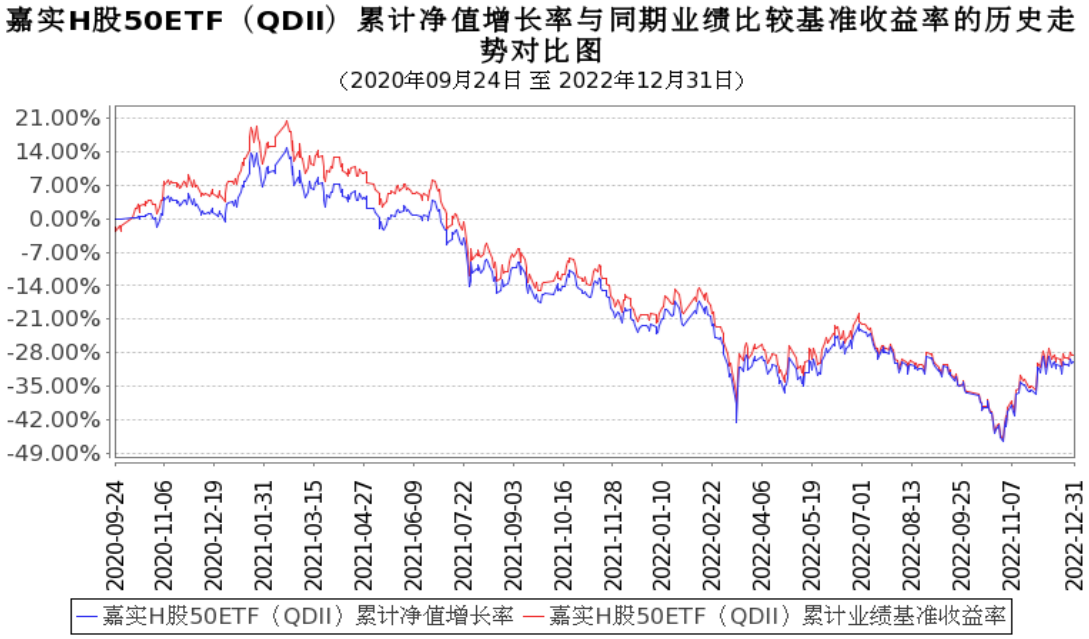
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	10.33%	2.64%	11.97%	2.66%	-1.64%	-0.02%
过去六个月	-8.51%	2.10%	-8.65%	2.12%	0.14%	-0.02%
过去一年	-9.86%	2.30%	-11.06%	2.33%	1.20%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-29.81%	1.81%	-28.57%	1.84%	-1.24%	-0.03%

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：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。

§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、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实	2021 年 7 月 2 日	-	13 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。现任指数投资部负责人。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	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、嘉实中证海外中国互联网30ETF(QDII)、嘉实中证高端装备细分50ETF、嘉实纳斯达克100指数发起(QDII)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 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、《嘉实恒生中国企业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9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业绩表现说明

本基金跟踪误差来源主要包括：基金申购赎回的影响、标的ETF的跟踪偏离、人民币港币的汇率变化等。

本基金作为一只通过投资标的ETF实现对于香港恒生H股指数跟踪的被动投资管理产品，我们继续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，进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的香港恒生H股指数的投资工具。

截至本报告期末本基金份额净值为0.7019元；本报告期基金份额净值增长率为10.33%，业绩比较基准收益率为11.97%。

4.5 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2022-10-01至2022-11-29， 2022-12-01至2022-12-31；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。

§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	-	-
	其中：普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	36,500,084.12	99.28
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	265,761.67	0.72
8	其他资产	-	-
9	合计	36,765,845.79	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

无。

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

无。

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

无。

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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	Hang Seng Investment Index Funds Series - Hang Seng China Enterprises Index ETF	ETF	交易型开放式	Hang Seng Investment Management Ltd	36,500,084.12	99.69

注：报告期末，本基金仅持有上述1支基金。

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

无。

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	57,563,219.00
报告期期间基金总申购份额	55,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	61,200,000.00
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	52,163,219.00

§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恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）注册的批复文件；

（2）《嘉实恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》；

（3）《嘉实恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金（QDII）托管协议》；

（4）《嘉实恒生中国企业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）报告期内嘉实恒生中国企业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

2023年1月20日