

嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	嘉实基本面 50ETF
场内简称	基本面 50 (扩位场内简称: 基本面 50ETF)
基金主代码	512750
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 23 日
报告期末基金份额总额	347,154,906.00 份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资, 紧密跟踪标的指数, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化, 力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%, 年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法, 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。但因特殊情况 (如流动性原因等) 导致无法完全投资于标的指数成分股时, 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。 如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过投资目标所述范围的, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	业绩比较基准为中证锐联基本面 50 指数收益率。
风险收益特征	本金属股票型证券投资基金, 预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金, 主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现, 具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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
-------	--------------

§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	-7,208,663.23
2. 本期利润	9,254,946.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0246
4. 期末基金资产净值	331,465,829.14
5. 期末基金份额净值	0.9548

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	2.56%	0.74%	-0.24%	0.76%	2.80%	-0.02%
过去六个月	-10.24%	1.29%	-14.08%	1.32%	3.84%	-0.03%
过去一年	-7.24%	1.05%	-12.58%	1.08%	5.34%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-4.52%	1.01%	-8.86%	1.06%	4.34%	-0.05%

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

嘉实基本面50ETF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：嘉实基本面 50ETF 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 5 月 23 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 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（六）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		
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、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理	2019 年 5 月 23 日	-	15 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。
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实沪	2019 年 5 月 23 日	-	14 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、

	深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理			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。
--	---	--	--	--

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、《嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数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

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.11%，年化跟踪误差为 1.67%。符合基金合同约定的日均

跟踪误差不超过 0.2%的限制。

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，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

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9548 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.56%，业绩比较基准收益率为-0.24%。

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	321,315,153.52	96.80
	其中：股票	321,315,153.52	96.80
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	7,113,226.90	2.14
8	其他资产	3,510,432.83	1.06
9	合计	331,938,813.25	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	19,638,490.40	5.92
C	制造业	53,012,267.88	15.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,833,838.30	2.67

E	建筑业	37,468,896.08	11.30
F	批发和零售业	4,852,586.00	1.46
G	交通运输、仓储和邮政业	4,634,784.00	1.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,330,348.00	1.31
J	金融业	163,076,317.23	49.20
K	房地产业	23,980,538.00	7.23
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	319,828,065.89	96.49

5.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,297,474.35	0.39
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	-	-
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	189,613.28	0.06
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	-	-
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	1,487,087.63	0.45

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	601318	中国平安	405,500	28,952,700.00	8.73
2	601166	兴业银行	986,817	15,571,972.26	4.70
3	601668	中国建筑	3,226,500	15,390,405.00	4.64
4	601328	交通银行	2,771,200	14,216,256.00	4.29
5	601398	工商银行	2,849,767	14,191,839.66	4.28
6	600036	招商银行	419,366	14,141,021.52	4.27
7	600016	民生银行	1,986,300	11,262,321.00	3.40
8	000002	万科A	430,500	11,253,270.00	3.40
9	600028	中国石化	2,485,340	9,717,679.40	2.93
10	600000	浦发银行	912,868	9,658,143.44	2.91

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	688208	道通科技	14,165	768,167.95	0.23
2	688360	德马科技	6,109	281,197.27	0.08
3	688568	中科星图	10,951	177,515.71	0.05
4	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.03
5	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.03

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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 声明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) 2019 年 10 月 12 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（银保监银罚决字（2019）7 号），对上海浦东发展银行股份有限公司对成都分行授信业务及整改情况严重失察等违法违规事实，于 2019 年 6 月 24 日作出行政处罚决定，罚款合计 130 万元。

根据中国银行保险监督管理委员会北京监管局发布法人行政处罚信息公开表京银保监罚决字（2019）56 号，对民生银行总行同业票据业务管理失控、违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产、案件风险信息报送管理不到位等 12 项违规事实于 2019 年 12 月 20 日做出行政处罚决定，责令民生银行股份有限公司改正，并给予合计 700 万元罚款的行政处罚，对顾立辉给予警告并处 5 万元罚款的行政处罚。2020 年 2 月 14 日，中国人民银行发布银罚字【2020】1 号，于 2020 年 2 月 10 日对中国民生银行股份有限公司作出行政处罚决定，因其未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，处以 2360 万元罚款。

2020 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【2019】24 号），对交通银行股份有限公司授信审批不审慎、总行对分支机构管控不力承担管理责任等违法违规事实，于 2019 年 12 月 27 日作出行政处罚决定，罚款合计 150 万元。2020 年 4 月 20 日，根据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）6 号），对交通银行股份有限公司理财产品数量漏报、信贷业务担保合同漏报、分户账账户数据应报未报等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，罚款合计 260 万元。

2020 年 4 月 20 日，根据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）7 号），对中国工商银行股份有限公司理财产品数量漏报、贷款核销业务漏报、委托贷款业务应报未报等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，罚款合计 270 万元。

本基金投资于“浦发银行（600000）”、“民生银行（600016）”、“交通银行（601328）”、

“工商银行（601398）”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，浦发银行、民生银行、交通银行、工商银行为标的指数成份股，本基金投资于“浦发银行”、“民生银行”、“交通银行”、“工商银行”股票的决策流程，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，其他六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

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	37,070.02
2	应收证券清算款	3,472,133.61
3	应收股利	-
4	应收利息	1,229.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,510,432.83

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	688208	道通科技	768,167.95	0.23	科创板新股锁定
2	688360	德马科技	281,197.27	0.08	科创板新股锁定
3	688568	中科星图	177,515.71	0.05	新发未上市
4	688027	国盾量子	102,389.40	0.03	新发未上市

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	391,254,906.00
报告期期间基金总申购份额	189,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	233,100,000.00
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	347,154,906.00

§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中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数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) 报告期内嘉实中证锐联基本面 50 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

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