

嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数
证券投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数
基金主代码	021348
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 6 月 3 日
报告期末基金份额总额	4,661,632,285.31 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，将年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
投资策略	1、债券指数化投资策略 本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。 指数成份券发生明显负面事件面临违约风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人将按照基金份额持有人利益优先的原则，综合考虑成份券违约风险、其在指数中的权重以及对跟踪误差的影响，据此制定成份券替代策略，及时对投资组合进行相应调整。

	2、其他债券和资产支持证券投资策略 (1) 利率策略 (2) 信用债券和资产支持证券投资策略 3、杠杆投资策略	
业绩比较基准	中债绿色普惠主题金融债券优选指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方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证券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	上海浦东发展银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 A	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 C
下属分级基金的交易代码	021348	021349
报告期末下属分级基金的份额总额	4,651,132,217.81 份	10,500,067.50 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（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 A	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 C
1. 本期已实现收益	30,234,607.51	50,676.62
2. 本期利润	12,664,077.15	14,619.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0020	0.0014
4. 期末基金资产净值	4,669,259,656.89	10,537,385.00
5. 期末基金份额净值	1.0039	1.0036

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

嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 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	0.17%	0.06%	0.46%	0.03%	-0.29%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.39%	0.05%	0.85%	0.03%	-0.46%	0.02%

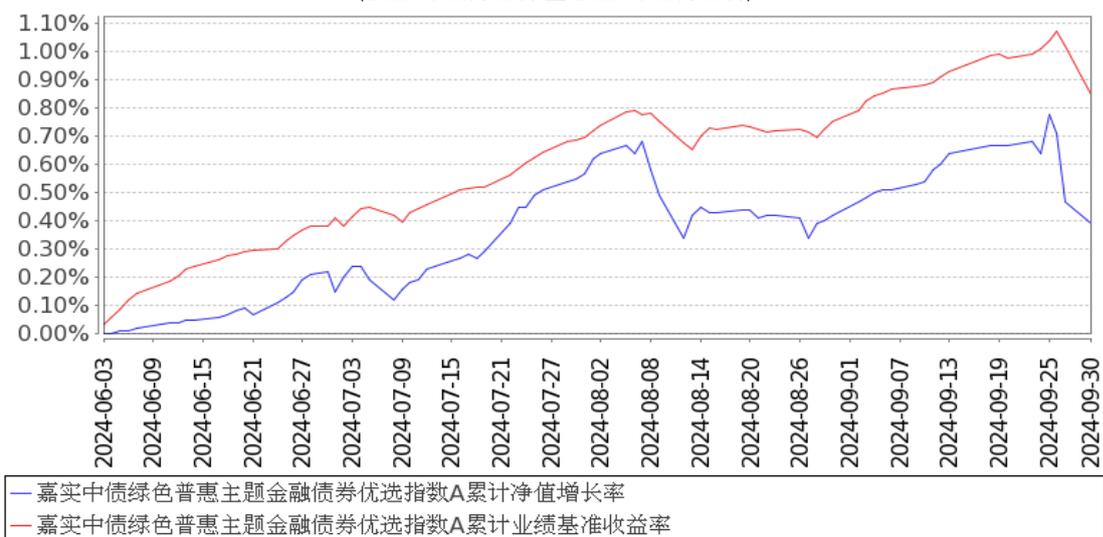
嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 C

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	0.14%	0.06%	0.46%	0.03%	-0.32%	0.03%
自基金合同生效起至今	0.36%	0.05%	0.85%	0.03%	-0.49%	0.02%

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

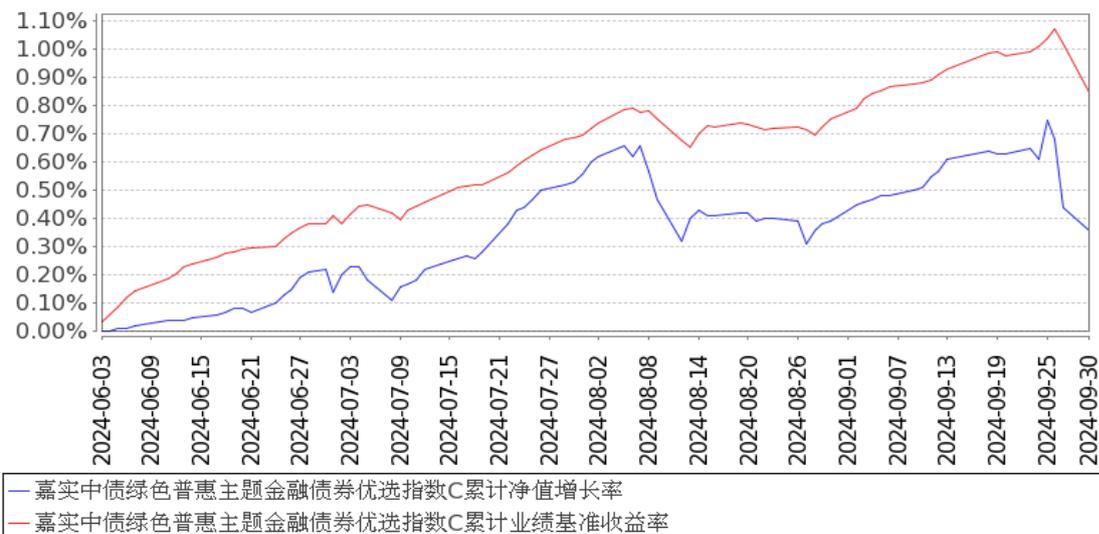
嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2024年06月03日至2024年09月30日)



嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数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

(2024年06月03日至2024年09月30日)



注：(1) 本基金合同生效日 2024 年 06 月 03 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。

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		
祝杨	本基金、嘉实稳泽纯债债券、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实长三角 ESG 纯债债券、嘉实致诚纯债债券、嘉实双季兴享 6 个月持	2024 年 6 月 3 日	-	12 年	曾在海通证券股份有限公司固定收益部从事投资交易工作；曾任申港证券股份有限公司资管固收部董事总经理，民生证券股份有限公司资产管理事业部固定收益投资总部副总经理。2021 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，任固定收益策略投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	有债券基金 基金经理				
闵锐	本基金、 嘉实丰益 纯债定期 债券、嘉 实稳荣债 券、嘉实 中债 3-5 年国开债 指数、嘉 实稳骏纯 债债券基 金经理	2024 年 6 月 3 日	-	8 年	2015 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司 固定收益研究部，从事信用研究工作。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行业协会相关规定。

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、《嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选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，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

三季度经济延续波折修复态势，制造业及基建投资和外贸呈现出一定韧性，但内需仍疲弱、地产投资乏力、通胀低迷等状况仍未明显改善。货币政策总体灵活适度，但央行更多通过逆回购操作调节资金面，政府债供给对资金面有所扰动。

三季度债券市场总体呈现慢牛快熊的特征，收益率仍延续下行趋势，但在监管调控和政策扰动下波动有所加大。7月初在央行多次表态开展国债卖出操作并创设临时正逆回购工具影响下，10年期国债收益率快速上行，而后披露的物价、社融和经济数据偏弱，收益率再度回落；三中全会释放下半年政策加力信号，央行随后超预期调降OMO和LPR利率、国股行也下调存款利率，叠加7月官方制造业PMI创5个月新低，提振债市做多情绪，10年期国债收益率快速下行。此后8月上旬开始止盈压力开始出现，大行在二级市场进行卖出国债操作，部分机构也暂停长债做市，10年期国债收益率快速反弹，但成交量锐减；8月中旬金融时报、交易商协会等出来呵护市场，市场情绪有所好转；而后美联储9月降息落地，市场交易国内降息预期带动长债一路下行再突破前低至2%附近。国新办新闻发布会上央行宣布包括降准、降息、降房地产存贷利率、创新工具支持权益市场等一系列重磅政策，随后政治局会议超预期在9月召开并在财政、地产、就业等多方面表态支持经济，债券市场月底调整剧烈。

受机构行为影响，信用债自8月中旬开始与利率债走势出现背离，信用债利差走扩，长久期低等级信用债表现偏弱。

本基金为指数基金，在控制风险的前提下保持对标的指数的跟踪，进行优化抽样复制，力争控制跟踪误差。报告期内本基金日均跟踪误差为0.03%（A类）、0.03%（C类），年化拟合偏离度为0.77%（A类）、0.79%（C类），符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.35%的目标。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数A基金份额净值为1.0039元，本报告期基金份额净值增长率为0.17%；截至本报告期末嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数C基金份额净值为1.0036元，本报告期基金份额净值增长率为0.14%；业绩比较基准收益率为0.46%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,579,353,992.28	97.60
	其中：债券	4,579,353,992.28	97.60
	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	105,695,659.72	2.25
	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	6,829,054.90	0.15
8	其他资产	-	-
9	合计	4,691,878,706.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 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

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,579,353,992.28	97.85
	其中：政策性金融债	1,910,839,393.52	40.83
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	4,579,353,992.28	97.85

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	240215	24 国开 15	4,000,000	402,352,767.12	8.60
2	240210	24 国开 10	2,500,000	254,607,191.78	5.44
3	2102004QF	21 国开绿债 04 清发	2,400,000	244,577,311.48	5.23
4	092404001	24 农发清发绿债 01	2,200,000	221,838,958.90	4.74
5	2403001	24 进出绿色债 01	2,000,000	202,077,753.42	4.32

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国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，杭州银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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

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

项目	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 A	嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数 C
报告期期初基金份额总额	7,981,385,260.93	10,500,067.50
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	3,330,253,043.12	-
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	4,651,132,217.81	10,500,067.50

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024-07-01 至 2024-09-30	3,900,876,500.00	-	1,500,000,000.00	2,400,876,500.00	51.50
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§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债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选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) 报告期内嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 10 月 25 日