

嘉实中证锐联基本面 50 指数证券投资基金 (LOF) 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 50 指数(LOF)	
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	1,133,906,710.46 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	采取完全指数复制法，按照标的指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。	
业绩比较基准	中证锐联基本面 50 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%	
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	嘉实 50A	嘉实 50C
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	1, 110, 195, 009. 09 份	23, 711, 701. 37 份
---------------------	------------------------	--------------------

注：由于 C 类基金份额只开通场外份额，在这里“嘉实 50C”不是严格意义的“场内简称”，而是指本基金在交易所新增的场外份额简称。

§ 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)	报告期(2020 年 4 月 1 日 - 2020 年 6 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	30, 846, 758. 27	430, 260. 56
2. 本期利润	23, 057, 797. 57	316, 923. 67
3. 加权平均基金份额 本期利润	0. 0203	0. 0135
4. 期末基金资产净值	1, 612, 520, 541. 56	24, 127, 626. 36
5. 期末基金份额净值	1. 4525	1. 0175

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）自 2018 年 8 月 8 日起对本基金增加 C 类基金份额类别；自 2018 年 8 月 8 日起开放嘉实基本面 50 指数（LOF）C 的申赎业务；（4）嘉实基本面 50 指数（LOF）A 收取认（申）购费和赎回费，嘉实基本面 50 指数（LOF）C 不收取认（申）购费但收取赎回费、计提销售服务费。

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

嘉实基本面 50 指数(LOF)A

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	1.38%	0.72%	-0.21%	0.72%	1.59%	0.00%
过去六个月	-11.73%	1.26%	-13.37%	1.26%	1.64%	0.00%
过去一年	-8.79%	1.02%	-11.90%	1.02%	3.11%	0.00%
过去三年	4.13%	1.10%	-4.37%	1.10%	8.50%	0.00%
过去五年	9.25%	1.25%	-3.48%	1.23%	12.73%	0.02%
自基金合同 生效起至今	45.25%	1.33%	22.65%	1.33%	22.60%	0.00%

嘉实基本面 50 指数(LOF)C

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	1.27%	0.72%	-0.21%	0.72%	1.48%	0.00%
过去六个月	-11.90%	1.26%	-13.37%	1.26%	1.47%	0.00%
过去一年	-9.18%	1.02%	-11.90%	1.02%	2.72%	0.00%
自基金合同 生效起至今	1.75%	1.16%	-1.71%	1.16%	3.46%	0.00%

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

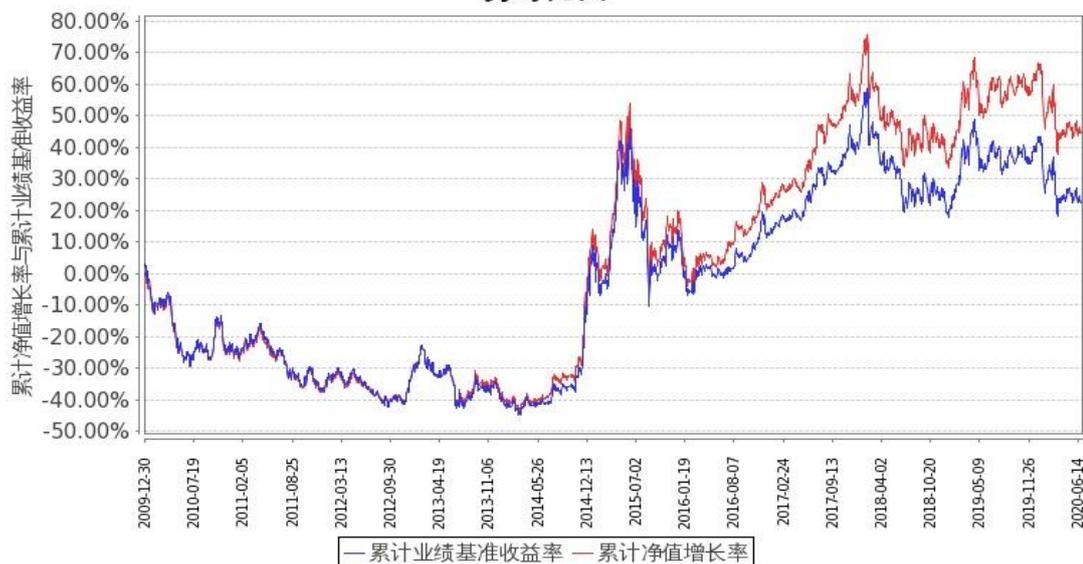


图 1：嘉实基本面 50 指数(LOF)A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009 年 12 月 30 日至 2020 年 6 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

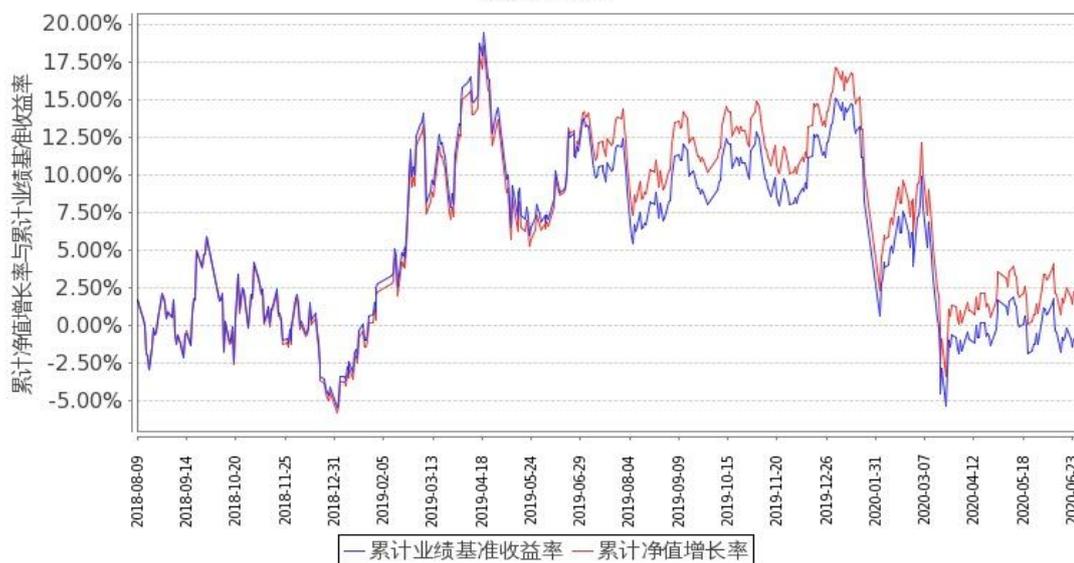


图 2：嘉实基本面 50 指数(LOF)C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 8 月 9 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起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十一（三）投资范围和（七）2、投资组合限制）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)、嘉实基本	2016 年 3 月 24 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

	面 50ETF、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				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 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实基本面 50ETF、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	2016 年 1 月 5 日	-	14 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。

注：（1）任职日期是指公司作出决定后公告之日；（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遵规守信情况的说明

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，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 0.08%，年化跟踪误差为 1.30%。符合本基金基金合同中约定的日均跟踪误差不超过 0.35%的限制。本基金跟踪误差来源主要包括长期停牌个股的重新估值以及基金申购赎回的影响。

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 1.4525 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.38%；截至本报告期末嘉实基本面 50 指数(LOF)C 基金份额净值为 1.0175 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.27%；业绩比较基准收益率为-0.21%。

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	1,553,513,283.35	93.61
	其中：股票	1,553,513,283.35	93.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,492,000.00	1.84
	其中：债券	30,492,000.00	1.84
	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	68,467,612.27	4.13
8	其他资产	7,039,320.90	0.42
9	合计	1,659,512,216.52	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	95,262,118.88	5.82
C	制造业	257,248,481.65	15.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,862,969.06	2.62
E	建筑业	181,800,740.41	11.11
F	批发和零售业	23,555,926.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	22,472,514.28	1.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,011,040.16	1.28
J	金融业	791,165,755.91	48.34
K	房地产业	116,388,192.10	7.11
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	1,551,767,738.45	94.81

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	1,407,023.53	0.09
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	190,731.77	0.01
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	147,789.60	0.01
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	1,745,544.90	0.11

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	1,968,016	140,516,342.40	8.59
2	601166	兴业银行	4,786,009	75,523,222.02	4.61
3	601668	中国建筑	15,655,430	74,676,401.10	4.56
4	601328	交通银行	13,443,695	68,966,155.35	4.21
5	601398	工商银行	13,828,195	68,864,411.10	4.21
6	600036	招商银行	2,034,161	68,591,908.92	4.19
7	000002	万科A	2,090,130	54,635,998.20	3.34
8	600016	民生银行	9,635,827	54,635,139.09	3.34
9	600028	中国石化	12,059,105	47,151,100.55	2.88
10	600000	浦发银行	4,430,586	46,875,599.88	2.86

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	688598	金博股份	7,645	595,851.30	0.04
2	688100	威胜信息	11,602	300,723.84	0.02
3	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
4	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.01
5	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01

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	30,492,000.00	1.86
	其中：政策性金融债	30,492,000.00	1.86
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	30,492,000.00	1.86

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	180203	18 国开 03	300,000	30,492,000.00	1.86

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 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

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	107,264.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	438,598.50
5	应收申购款	6,493,458.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,039,320.90

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	688598	金博股份	595,851.30	0.04	科创板新股锁定
2	688100	威胜信息	300,723.84	0.02	科创板新股锁定
3	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新发未上市
4	688178	万德斯	147,789.60	0.01	科创板新股锁定
5	688377	迪威尔	129,619.48	0.01	新发未上市

§ 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	1,109,993,291.82	23,112,529.25
报告期期间基金总申购份额	153,985,650.08	7,689,568.41
减:报告期期间基金总赎回份额	153,783,932.81	7,090,396.29
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	1,110,195,009.09	23,711,701.37

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金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

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。

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