

嘉实恒生科技交易型开放式指数证券投资  
基金（QDII）  
2021 年第 3 季度报告

2021 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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 2021 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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实恒生科技 ETF (QDII)
场内简称	恒生科技 ETF 基金
基金主代码	159741
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 5 月 26 日
报告期末基金份额总额	306,796,712.00 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 0.5%，年化跟踪误差不超过 5%。
投资策略	1、股票投资策略，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份股时，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。对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，筛选具有比较优势的存托凭证作为投资标的。2、债券投资策略；3、衍生品投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、融资及转融通证券出借；6、随着证券市场投

	资工具的发展和丰富，基金管理人可在不改变投资目标的前提下，根据法律法规的有关规定，在履行适当程序后相应调整或更新投资策略，并公告。
业绩比较基准	恒生科技指数收益率（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，跟踪恒生科技指数，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	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（2021年7月1日-2021年9月30日）
1. 本期已实现收益	-7,084,599.29
2. 本期利润	-70,055,689.05
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2315
4. 期末基金资产净值	232,408,112.04
5. 期末基金份额净值	0.7575

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

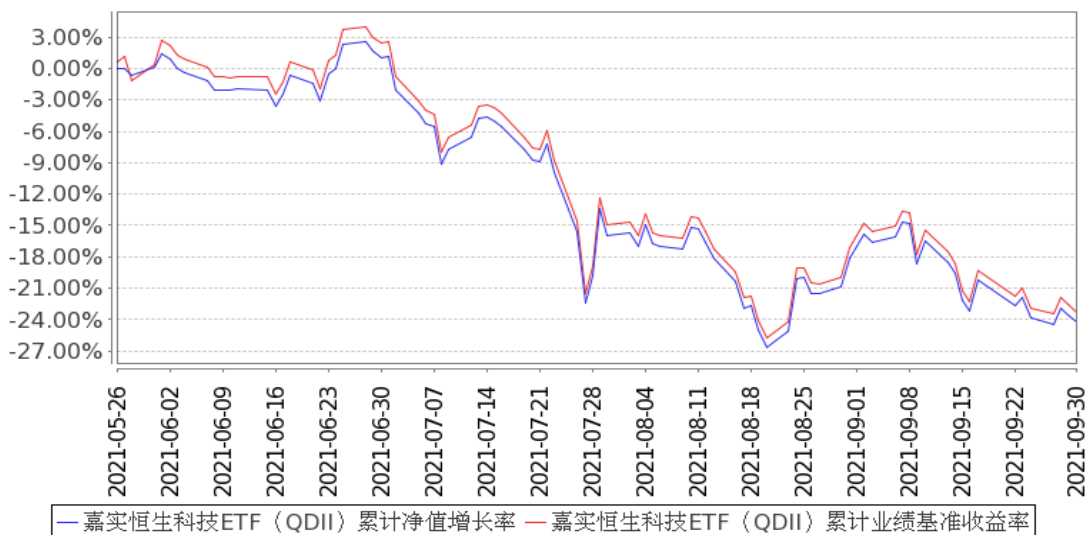
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.01%	2.67%	-25.10%	2.69%	0.09%	-0.02%

自基金合同 生效起至今	-24.25%	2.34%	-23.30%	2.39%	-0.95%	-0.05%
----------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

### 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 率变动的比较

#### 嘉实恒生科技ETF (QDII) 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

(2021年05月26日至2021年09月30日)



注：(1) 本基金合同生效日2021年05月26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		
李直	本基金、嘉实基本面50指数 (LOF)、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实创业板	2021年6月10日	-	7年	2014年7月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	ETF、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实中证新能源汽车指数、嘉实中证科创创业 50ETF 发起联接基金经理				
王紫菡	本基金、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实先进制造 100ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实中证主要消费 ETF 联接、嘉实医药健康 100ETF 基金经理	2021 年 9 月 9 日	-	5 年	2016 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，历任指数投资部投资经理助理、投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
高峰	本基金基金经理	2021 年 5 月 26 日	2021 年 7 月 2 日	7 年	曾任中国工商银行股份有限公司金融市场部外汇及衍生品交易员。2015 年加入嘉实基金管理有限公司任指数投资部指数研究员，现任指数投资部基金经理。北京大学金融学硕士，特许金融分析师 (CFA)，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、《嘉实恒生科技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

本报告期内，本基金仍处于 6 个月建仓期内。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。

截至本报告期末本基金份额净值为 0.7575 元；本报告期基金份额净值增长率为-25.01%，业绩比较基准收益率为-25.10%。

### 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	231,681,271.94	98.81
	其中：普通股	231,681,271.94	98.81
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-

	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	2,783,601.45	1.19
8	其他资产	179.23	0.00
9	合计	234,465,052.62	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（%）
中国香港	231,681,271.94	99.69
合计	231,681,271.94	99.69

## 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	52,896,285.99	22.76
非必需消费品	78,940,499.85	33.97
-	-	-
-	-	-
金融	2,990,352.18	1.29
医疗保健	9,230,621.36	3.97
-	-	-
信息技术	87,623,512.56	37.70
-	-	-
-	-	-
-	-	-
合计	231,681,271.94	99.69

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	Meituan	美团-W	3690 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	96,60 0.00	19,844,788.7 7	8.54
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 H K	香港证 券交易 所	中国 香港	49,90 0.00	19,180,256.8 1	8.25
3	JD.com I nc	京东集团	9618 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	78,50 0.00	18,519,923.4 7	7.97
4	Kuaishou Technol ogy	快手	1024 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	262,4 00.00	18,077,801.8 7	7.78
5	Sunny Op tical Technolog y Group Co Ltd	舜宇光学 科技	2382 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	102,2 00.00	17,436,412.3 1	7.5
6	Alibaba Group Ho lding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	145,3 00.00	17,212,402.4 8	7.41
7	Xiaomi C orp	小米集团	1810 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	962,2 00.00	17,113,526.5 9	7.36
8	Semicondu ctor M anufactur ing Inte rnational Corp	中芯国际	981 H K	香港证 券交易 所	中国 香港	705,5 00.00	12,959,310.4 5	5.58
9	JD Health Inte rnational Inc	京东健康	6618 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	175,8 50.00	11,001,669.4 4	4.73



10	Haier Smart Home Co., Ltd	海尔智家	6690 HK	香港证券交易所	中国香港	379,400.00	8,675,928.36	3.73
----	---------------------------	------	------------	---------	------	------------	--------------	------

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。

#### 5.4.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

**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	-
3	应收股利	-
4	应收利息	179.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	179.23

**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	280,796,712.00
报告期期间基金总申购份额	66,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	40,000,000.00
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	306,796,712.00

**§ 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科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)注册的批复文件。
- (2) 《嘉实恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金合同》；
- (3) 《嘉实恒生科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)托管协议》；
- (4) 《嘉实恒生科技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) 报告期内嘉实恒生科技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

2021 年 10 月 26 日