嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国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

2.1 基金基本情况

基金简称	嘉实深证基本面 120ETF 联接
基金主代码	070023
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 1 日
报告期末基金份额总额	227,908,530.35 份
投资目标	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。
投资策略	本基金为目标 ETF 的联接基金。主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，在正常市场情况下，本基金相对于业绩比较基准的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。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上述范围，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目标 ETF 的买卖。此外，为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误

	差，达到有效跟踪标的指数的目的。	
业绩比较基准	深证基本面 120 指数*95% + 银行同业存款利率*5%	
风险收益特征	本基金为深证基本面 120ETF 的联接基金，其业绩表现与深证基本面 120 指数及深证基本面 120ETF 的表现密切相关，长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实深证基本面 120ETF 联接 A	嘉实深证基本面 120ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	070023	005998
报告期末下属分级基金的份额总额	181,778,692.56 份	46,129,837.79 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证基本面 120 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159910
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011 年 8 月 1 日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011 年 9 月 27 日
基金管理人名称	嘉实基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

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。
投资策略	本基金采取完全复制法，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。
业绩比较基准	深证基本面 120 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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。

§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）	
	嘉实深证基本面 120ETF 联接 A	嘉实深证基本面 120ETF 联接 C
1.本期已实现收益	12,042,895.05	1,726,047.74
2.本期利润	-10,510,852.36	-1,320,498.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0553	-0.0288

4.期末基金资产净值	438,217,114.22	68,789,129.12
5.期末基金份额净值	2.4107	1.4912

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

嘉实深证基本面 120ETF 联接 A

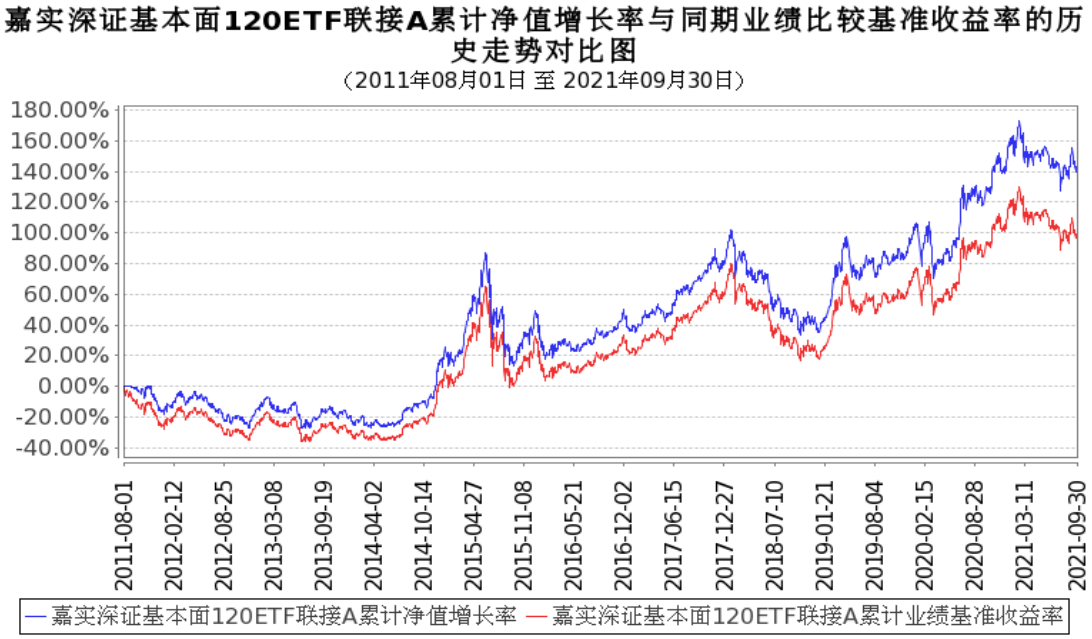
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-2.26%	1.07%	-4.24%	1.08%	1.98%	-0.01%
过去六个月	-3.17%	0.93%	-5.88%	0.94%	2.71%	-0.01%
过去一年	10.36%	1.08%	7.07%	1.08%	3.29%	0.00%
过去三年	60.09%	1.36%	50.04%	1.36%	10.05%	0.00%
过去五年	78.37%	1.25%	64.20%	1.26%	14.17%	-0.01%
自基金合同生效起至今	141.07%	1.41%	97.60%	1.45%	43.47%	-0.04%

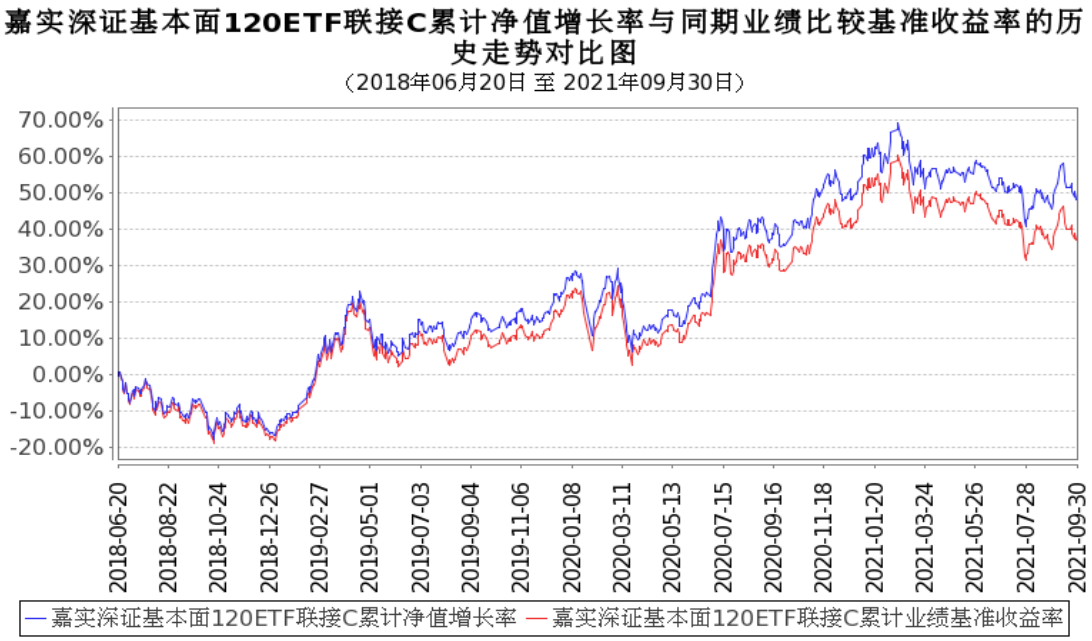
嘉实深证基本面 120ETF 联接 C

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	-2.36%	1.07%	-4.24%	1.08%	1.88%	-0.01%
过去六个月	-3.37%	0.93%	-5.88%	0.94%	2.51%	-0.01%
过去一年	9.92%	1.08%	7.07%	1.08%	2.85%	0.00%
过去三年	60.03%	1.36%	50.04%	1.36%	9.99%	0.00%
自基金合同生效起至今	49.12%	1.36%	37.76%	1.36%	11.36%	0.00%

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 3 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。

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		
刘珈吟	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实中关村 A 股 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 H 股 50ETF（QDII）基金经理	2016 年 3 月 24 日	-	12 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。现任指数投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
李直	本基金、嘉实基本面 50 指数（LOF）、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 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、嘉实恒生科技 ETF（QDII）、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	2017 年 12 月 26 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。

	接基金经理				

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本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、《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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

报告期内，本基金日均跟踪误差为0.08%，年化跟踪误差为1.29%。

本基金为目标ETF 的联接基金。主要通过投资于目标ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。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比较基准保持一致。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实深证基本面120ETF联接A基金份额净值为2.4107元，本报告期基金份额净值增长率为-2.26%；截至本报告期末嘉实深证基本面120ETF联接C基金份额净值为1.4912

元，本报告期基金份额净值增长率为-2.36%；业绩比较基准收益率为-4.24%。

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	6,559,367.24	1.29
	其中：股票	6,559,367.24	1.29
2	基金投资	474,447,480.96	93.07
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	27,019,440.90	5.30
8	其他资产	1,724,726.97	0.34
9	合计	509,751,016.07	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

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	275,094.56	0.05
B	采矿业	107,989.60	0.02
C	制造业	3,748,657.31	0.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	127,063.00	0.03
E	建筑业	20,507.50	0.00
F	批发和零售业	223,865.60	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	83,840.00	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	53,550.00	0.01
J	金融业	771,277.34	0.15
K	房地产业	1,021,062.33	0.20
L	租赁和商务服务业	126,460.00	0.02
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	6,559,367.24	1.29

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

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	000002	万 科A	22,300	475,213.00	0.09
2	000333	美的集团	5,362	373,195.20	0.07
3	000651	格力电器	8,600	333,250.00	0.07
4	000001	平安银行	11,608	208,131.44	0.04
5	300498	温氏股份	12,748	184,463.56	0.04
6	000725	京东方A	35,700	180,285.00	0.04
7	001979	招商蛇口	13,508	174,793.52	0.03
8	000338	潍柴动力	8,063	138,361.08	0.03
9	000100	TCL科技	20,700	129,582.00	0.03
10	000776	广发证券	5,600	117,376.00	0.02

5.3.2 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。

5.4 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（元）	占基金资产净值比例(%)
1	嘉实深证基本面120ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	嘉实基金管理有限公司	474,447,480.96	93.58

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 本期国债期货投资政策

无。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.11.3 本期国债期货投资评价

无。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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

（1）2020年10月27日，宁波银保监局发布行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字〔2020〕66号），平安银行股份有限公司因贷款资金用途管控不到位、借贷搭售、对房地产开发贷及预售资金监管不力等违法违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条，于2020年10月16日被处以罚款人民币100万元。

本基金投资于“平安银行（000001）”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，平安银行为标的指数成份股，本基金投资于“平安银行”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，其他九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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	68,984.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,465.83
5	应收申购款	1,653,276.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,724,726.97

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.12.6 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	嘉实深证基本面120ETF联接A	嘉实深证基本面120ETF联接C
报告期期初基金份额总额	199,052,290.33	44,263,420.97
报告期期间基金总申购份额	11,037,759.84	20,883,784.33
减:报告期期间基金总赎回份额	28,311,357.61	19,017,367.51
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	181,778,692.56	46,129,837.79

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

（1）中国证监会批准嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件；

（2）《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》；

（3）《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》；

（4）《嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》；

（5）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（6）报告期内嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金联接基金公告的各项原稿。

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