

嘉实上海金交易型开放式证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 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 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 嘉实上海金 ETF |
| 场内简称 | 上海金 ETF 基金 |
| 基金主代码 | 159831 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2022 年 3 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,856,243.00 份 |
| 投资目标 | 紧密跟踪上海金午盘基准价，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金投资策略包括：1、黄金现货合约投资策略；2、债券投资策略。未来，随着投资工具的发展和丰富，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，在履行适当程序后，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。 |
| 业绩比较基准 | 上海黄金交易所上海金集中定价合约（合约代码：SHAU）的午盘基准价格收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金主要投资对象为黄金现货合约，其风险收益特征与国内黄金资产的风险收益特征相似，不同于股票型基金、混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

§ 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（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -800,202.70 |
| 2. 本期利润 | -280,072.03 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0432 |
| 4. 期末基金资产净值 | 18,871,889.41 |
| 5. 期末基金份额净值 | 3.8861 |

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。

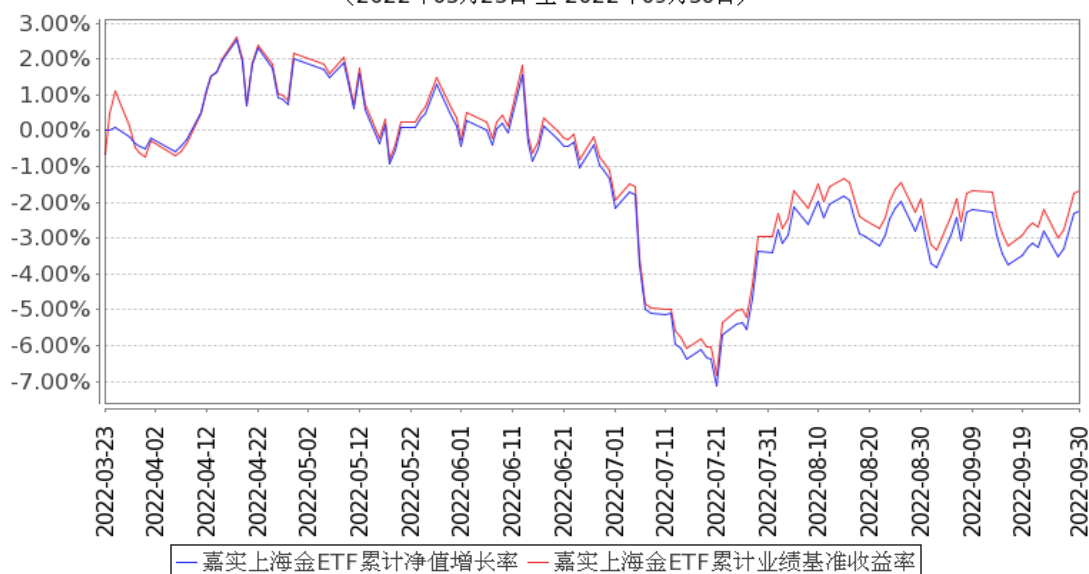
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -0.94% | 0.60% | -0.57% | 0.61% | -0.37% | -0.01% |
| 过去六个月 | -1.73% | 0.62% | -0.95% | 0.64% | -0.78% | -0.02% |
| 自基金合同 生效起至今 | -2.25% | 0.61% | -1.67% | 0.64% | -0.58% | -0.03% |

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

嘉实上海金ETF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
(2022年03月23日至2022年09月30日)



注：（1）本基金合同生效日2022年03月23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起6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 | | |
| 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、嘉实基本面50ETF、嘉实中证大农业ETF、嘉实恒生科技ETF（QDII）、嘉实中证科创创业 | 2022年3月23日 | - | 8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。 |

| | | | | | |
|-----|---|-----------------|---|------|---|
| | 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、嘉实中证信息安全主题 ETF、嘉实中证医疗指数发起式、嘉实中证光伏产业指数发起式基金经理 | | | | |
| 张钟玉 | 本基金、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实创业板 ETF、嘉实上证科创板新一代信息技术 ETF、嘉实纳斯达克 100 指数发起 (QDII) 基金经理 | 2022 年 4 月 13 日 | - | 12 年 | 曾任大成基金管理有限公司研究员、数量分析师、基金经理。2021 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部。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、《嘉实上海金交易型开放式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 4 次，均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 0.03%，年化跟踪误差为 0.49%。

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 3.8861 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.94%，业绩比较基准收益率为-0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2022-07-01 至 2022-07-07，2022-07-11 至 2022-08-15，2022-08-17 至 2022-09-21；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 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 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | 29,450,901.00 | 70.92 |
| 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 | 312,543.95 | 0.75 |
| 8 | 其他资产 | 11,760,973.00 | 28.32 |
| 9 | 合计 | 41,524,417.95 | 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境内股票投资组合

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 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

无。

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

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

| 序号 | 贵金属代码 | 贵金属名称 | 数量（份） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|--------|---------------|--------------|
| 1 | Au9999 | Au99.99 | 75,550 | 29,450,901.00 | 156.06 |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支贵金属。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1 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**

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 854,413.00 |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,906,560.00 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 11,760,973.00 |

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

无。

5.11.6 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 | 5,756,243.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 27,300,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 28,200,000.00 |
| 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 | 4,856,243.00 |

§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

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 | 2022-07-06 至 2022-07-10, 2022-08-03 至 | 554,823.00 | 20,016,776.00 | 19,449,234.00 | 1,122,365.00 | 23.11 |

| | | | | | | |
|---|---|--------------|---------------|---------------|------------|-------|
| | 2022-08-03, 2022-08-05 至 2022-08-14, 2022-08-16 至 2022-08-16, 2022-08-18 至 2022-08-29, 2022-09-01 至 2022-09-22, 2022-09-27 至 2022-09-27, 2022-09-29 至 2022-09-30 | | | | | |
| 2 | 2022-07-01 至 2022-07-01, 2022-07-14 至 2022-07-14, 2022-07-25 至 2022-07-26, 2022-07-28 至 2022-08-01 | 1,203,946.00 | 9,620,005.00 | 10,253,458.00 | 570,493.00 | 11.75 |
| 3 | 2022-07-08 至 2022-07-10, 2022-08-16 至 2022-08-16, 2022-09-22 至 2022-09-27 | 426,636.00 | 14,181,361.00 | 14,057,825.00 | 550,172.00 | 11.33 |
| 4 | 2022-08-24 至 2022-08-24, 2022-08-30 至 2022-08-30 | 748,313.00 | 6,316,898.00 | 6,831,398.00 | 233,813.00 | 4.81 |
| 5 | 2022-07-11 至 2022-07-13 | - | 7,500,000.00 | 7,500,000.00 | - | - |

产品特有风险

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。

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。

§ 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上海金交易型开放式证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实上海金交易型开放式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实上海金交易型开放式证券投资基金托管协议》；

- (4) 《嘉实上海金交易型开放式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) 报告期内嘉实上海金交易型开放式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

2022 年 10 月 25 日