

嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证
券投资基金
2023 年第 2 季度报告

2023 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 18 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 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实创业板增强策略 ETF
场内简称	创业板增强 ETF
基金主代码	159675
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 24 日
报告期末基金份额总额	221,346,691.00 份
投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数，实现基金资产的长期增值。本基金力争在控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间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 6.5%。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以创业板指数为本基金的标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 如因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上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 具体投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、可转换债券、可交换债券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	创业板指数收益率
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。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，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	中国建设银行股份有限公司

§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（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-8,140,395.12
2. 本期利润	-14,518,297.91
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0760
4. 期末基金资产净值	196,305,415.04
5. 期末基金份额净值	0.8869

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

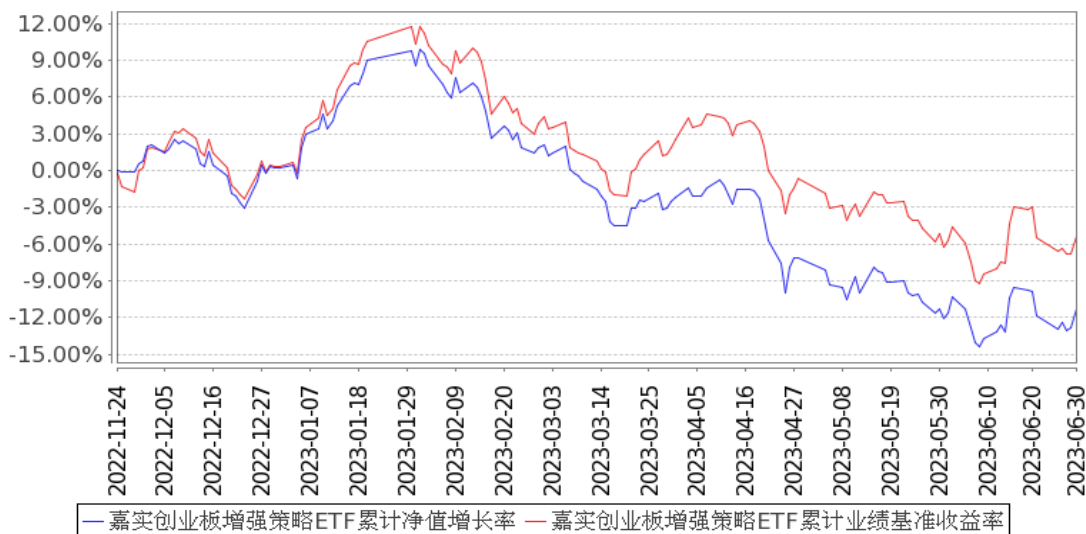
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-9.31%	1.16%	-7.69%	1.12%	-1.62%	0.04%
过去六个月	-11.46%	1.05%	-5.61%	1.08%	-5.85%	-0.03%
自基金合同 生效起至今	-11.31%	1.01%	-5.36%	1.06%	-5.95%	-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变动的比较

嘉实创业板增强策略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11月24日至2023年06月30日)



注：(1) 本基金合同生效日 2022 年 11 月 24 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		
张钟玉	本基金、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实上海金 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)、嘉	2022 年 11 月 24 日	-	13 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。

	实中证全指证券公司指数发起式、嘉实中证内地运输主题 ETF、嘉实上海金 ETF 发起联接、嘉实国证通信 ETF、嘉实纳斯达克 100ETF (QDII) 基金经理				
龙昌伦	本基金、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实量化精选股票、嘉实中证 500 指数增强、嘉实中证 1000 指数增强发起式基金经理	2022 年 11 月 24 日	-	9 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
龙昌伦	公募基金	5	3,448,390,156.75	2018 年 9 月 12 日
	私募资产管理计划	2	157,997,377.78	2022 年 7 月 19 日
	其他组合	3	5,168,175,395.96	2017 年 3 月 13 日
	合计	10	8,774,562,930.49	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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、《嘉实创业板增强策略交易型开放式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 3 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

A 股市场在二季度小幅下行，上证综指录得约 2% 的跌幅，指数呈现前期上涨后期回调的走势。比较而言，在普遍回调的市场中，结构性差异仍旧较大，以创业板为代表的成长指数下跌较多，基本上回吐一季度涨幅，并创下近 3 年相对低点，而以防御为主的红利指数则偏少。与此同时，二季度在主要宽基指数均下跌的环境中，市值风格的差异并没有像过去历史规律所显示的那样表征市场的主要矛盾，中证 1000 等指数也有明显的下跌，但代表市场中市值极小公司的微盘股指数在近期反弹中创出历史新高，该指数在四月急速回撤后，伴随着 AI 主题板块的上涨和股市资金博弈的加剧而迅速反弹。

从宏观层面看，市场从对经济的强复苏预期逐渐转向弱复苏预期，特别是近期经济数据中的部分分行业高频数据走弱，对于经济修复韧性和速度的预期产生摇摆，从而，10 年期国债利率跌破之前的横盘位置开始下行，并在 6 月中随着央行降息利率跌至今年以来最低的 2.6% 附近。这种转变也对市场核心矛盾产生了巨大影响。消费和顺周期资产逐渐走弱，经济进入被动去库存阶段，同时 PMI 指数上升后下行。经济复苏的反复，叠加流动性的充裕，资金博弈进入较为激烈的状态，并且部分投资者从过去赛道资产中逐渐腾挪资金到市场热点板块，加剧市场分化与波动程度。在这个过程中，汇率波动带来的情绪性交易，也使得市场风险偏好有所下降，一定程度上市场进入弱势震荡的格局。

股票市场方面，中小盘资产略好于大盘资产，其中微盘股走势较强，价值资产好于成长资产，大类风格中，大盘价值和小盘价值表现最佳。行业方面，通信、传媒、家电和公用事业等表现靠前，商贸零售、食品饮料、建筑材料和美容护理等则表现靠后。

报告期内，本基金作为一只跟踪创业板指数增强策略的投资管理产品，我们在组合管理中积极应对基金申购赎回等因素对跟踪效果带来的冲击，力争给投资者提供一个以创业板指为基准的增强策略投资工具。

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 0.8869 元；本报告期基金份额净值增长率为-9.31%，业绩比较基准收益率为-7.69%。

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	194,569,025.59	98.95
	其中：股票	194,569,025.59	98.95
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	-	-
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	1,877,155.59	0.95
8	其他资产	180,740.74	0.09
9	合计	196,626,921.92	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

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	3,072,725.85	1.57
B	采矿业	-	-
C	制造业	130,648,525.54	66.55
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	6,336,208.65	3.23
J	金融业	11,501,148.00	5.86
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	1,825,956.00	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	2,157,266.00	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,483,366.80	3.81
R	文化、体育和娱乐业	5,062,051.00	2.58
S	综合	-	-
	合计	168,087,247.84	85.63

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

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	20,951,788.73	10.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	12,369.29	0.01
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	5,467,478.36	2.79
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	2,580.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,713.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,480,376.85	13.49

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

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	300750	宁德时代	85,560	19,575,272.40	9.97
2	300059	东方财富	809,940	11,501,148.00	5.86
3	300274	阳光电源	90,000	10,496,700.00	5.35
4	300760	迈瑞医疗	33,800	10,133,240.00	5.16
5	300015	爱尔眼科	403,416	7,483,366.80	3.81
6	300014	亿纬锂能	123,200	7,453,600.00	3.80
7	300124	汇川技术	115,586	7,421,777.06	3.78
8	300142	沃森生物	208,300	5,509,535.00	2.81
9	300496	中科创达	55,799	5,376,233.65	2.74
10	300866	安克创新	43,800	3,832,500.00	1.95

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	300827	上能电气	88,435	3,188,081.75	1.62
2	603858	步长制药	132,200	2,721,998.00	1.39
3	002025	航天电器	33,700	2,150,060.00	1.10
4	600312	平高电气	161,500	2,000,985.00	1.02
5	300232	洲明科技	216,800	1,981,552.00	1.01

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	146,801.71
2	应收证券清算款	33,939.03
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	180,740.74

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	197,346,691.00
报告期期间基金总申购份额	84,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	60,000,000.00
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	221,346,691.00

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。
- （2）《嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- (3) 《嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实创业板增强策略交易型开放式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) 报告期内嘉实创业板增强策略交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

- 1) 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
- 2) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

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

2023 年 7 月 20 日