

## 深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

## 2018年第四季度报告

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：2019年1月21日

基金名称

基金的董事会及基金经理对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2019年1月17日复核了本报告中的财务数据、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。

基金的基金管理人以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期中的财务数据未经审计。

本报告期自2018年10月1日起至2018年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称

深证基本面120ETF

场内简称

深100

基金代码

160910

基金上市地

交易所开放式

交易时间

定期开放式

基金的首次开放日

2018年8月1日

报告期末基金份额总额

441,000,143,000份

投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪误差的最小化。

投资策略

本基金通过完全复制法，即按照标的指数的构成及其权重比例构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重变动进行相应调整。

业绩比较基准

深证基本面120指数

风险收益特征

本基金为股票基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合基金、债券基金及货币市场基金。本基金为股票基金，被动态调整的股票投资比例在0%到100%之间，因此其风险和收益水平将随其所投资的股票风险特征而变化。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期2018年10月1日-2018年12月31日

1.本期利润

-4,140,169.46

2.本期利润

-63,953,001.04

3.期末总资产

606,019,690.03

4.期末净资产

5,367,139.07

5.期末可供分配基金份额

-0.0005

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；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本基金的各项费用，计算上未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用，计入后实际收益水平将低于所列数字。

3.2 基金份额表现

3.2.1 本报告期内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

净值增长率

标准差

业绩比较基

准净值

①-③

②-④

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

阶段

净值增长

率

①-③

②-④

3.3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期2018年10月1日-2018年12月31日

1.本期利润

-5,109,086.76

2.本期利润

-13,800,342.47

3.期末总资产

607,407,800.53

4.期末净资产

1,186.77

5.期末可供分配基金份额

-0.0005

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；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本基金的各项费用，计算上未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用，计入后实际收益水平将低于所列数字。

3.4 基金管理人

嘉实基金管理有限公司

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间

离任日期

任期

说明

刘加峰

农林、牧、渔业

2016年3月24日

-

9年

2009年加入嘉实基金管理有限公司，历任指数投资部研究员、高级研究员、基金经理助理、现任基金经理。

陈正伟

电子、通信、计算机

2016年3月24日

-

13年

2009年加入嘉实基金管理有限公司，先后担任行业研究员、行业分析师、行业高级研究员、基金经理助理、基金经理，现任基金经理。

吴云峰

信息传播、文化娱乐业

2018年10月22日

-

10年

2012年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任行业研究员、行业分析师、行业高级研究员、基金经理助理、基金经理，现任基金经理。

3.5 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标

报告期2018年10月1日-2018年12月31日

1.本期利润

-26,231,389

2.加权平均基金份额本期利润

-0.0715

3.期末净资产

27,965,133.04

4.期末可供分配基金份额

0.0023

注：(1)本基金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本基金的各项费用，计算上未考虑持有人认购或交易本基金的各项费用，计入后实际收益水平将低于所列数字。

3.6 基金报告期

3.6.1 本报告期内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

标准差

业绩比较基

准净值

①-③

②-④

3.6.2 本报告期内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

阶段

净值增长

率

标准差

业绩比较基

准净值

①-③

②-④

3.6.3 本报告期内基金资产配置情况分析

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，同时向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%，合计3次，均为旗下组合被动跟踪标的涨幅需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.1 管理人报告

4.1.1 本报告期无须说明的事项

4.1.2 本报告期无须说明的事项

4.1.3 本报告期无须说明的事项

4.1.4 本报告期无须说明的事项

4.1.5 本报告期无须说明的事项

4.1.6 本报告期无须说明的事项

4.1.7 本报告期无须说明的事项

4.1.8 本报告期无须说明的事项

4.1.9 本报告期无须说明的事项

4.1.10 本报告期无须说明的事项

4.1.11 本报告期无须说明的事项

4.1.12 本报告期无须说明的事项

4.1.13 本报告期无须说明的事项

4.1.14 本报告期无须说明的事项

4.1.15 本报告期无须说明的事项

4.1.16 本报告期无须说明的事项

4.1.17 本报告期无须说明的事项

4.1.18 本报告期无须说明的事项

4.1.19 本报告期无须说明的事项

4.1.20 本报告期无须说明的事项

4.1.21 本报告期无须说明的事项

4.1.22 本报告期无须说明的事项

4.1.23 本报告期无须说明的事项

4.1.24 本报告期无须说明的事项

4.1.25 本报告期无须说明的事项

4.1.26 本报告期无须说明的事项

4.1.27 本报告期无须说明的事项

4.1.28 本报告期无须说明的事项

4.1.29 本报告期无须说明的事项

4.1.30 本报告期无须说明的事项

4.1.31 本报告期无须说明的事项

4.1.32 本报告期无须说明的事项

4.1.33 本报告期无须说明的事项

4.1.34 本报告期无须说明的事项

4.1.35 本报告期无须说明的事项

4.1.36 本报告期无须说明的事项

4.1.37 本报告期无须说明的事项

4.1.38 本报告期无须说明的事项

4.1.39 本报告