（上接B081版）

106	财通证券股份有限公司 注:只代销A份额。	办公地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601–1615,1701–1716室 法定代表人:陆建强 联系人:陶志华 电话:0571－87789160 传真:0571–87818329 客服电话:(0571)96336,962336(上海地区) 网址:http://www.ctsec.com
107	上海华信证券有限责任公司 注:只代销A份额。	办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号环球金融中心9楼 法定代表人:陈灿辉 联系人:倪丹 电话:021–38784818? 传真:021–68775878 客服电话:68777877 网址:http://www.shhxzq.com/
108	华鑫证券有限责任公司 注:只代销A份额。	办公地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01,B01（b）单元 法定代表人:俞洋 联系人:杨莉娟 电话:021–54967552 传真:021–54967032 客服电话:021–32109999;029–68918888;4001099918 网址:http://www.cfsc.com.cn
109	瑞银证券有限责任公司 注:只代销A份额。	办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12,15层 法定代表人:钱于军 联系人:牟冲 电话:(010）58328112 传真:(010)58328748 客服电话:400–887–8827 网址:http://www.ubssecurities.com
110	中山证券有限责任公司 注:只代销A份额。	办公地址：深圳市南山区创业路1777号海信南方大厦21,22层 法定代表人:林炳城 联系人:罗艺琳 电话:0755–82943755 传真:0755–82960582 客服电话:95329 网址:www.zszq.com
111	国融证券股份有限公司 注:只代销A份额。	办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18路 法定代表人:张智河 联系人:董晶姗 电话:(010)83991737 传真:(010)66412537 客服电话:4006609839 网址:http://www.grzq.com
112	江海证券有限公司 注:只代销A份额。	办公地址:哈尔滨市松北区创新三路833号 法定代表人:赵洪波 联系人:周俊 电话:0451–85863726 传真:0451–82337279 客服电话:956007 网址:http://www.jhzq.com.cn/
113	国金证券股份有限公司 注:只代销A份额。	办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16楼 法定代表人:冉云 联系人:刘婧漪、贾鹏 电话:028–86690057,028–86690058 传真:028–86690126 客服电话:95310 网址:http://www.gjzq.com.cn
114	中国民族证券有限责任公司 注:只代销A份额。	办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层–43层 法定代表人:姜志军 联系人:齐冬妮 电话:(010)59355807 传真:(010)56437013 客服电话:400–889–5618 网址:http://www.e5618.com
115	华宝证券有限责任公司 注:只代销A份额。	办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号57层 法定代表人:陈林 联系人:夏元 电话:（021）68777222 传真:（021）68777822 客服电话:4008209898 网址:http://www.cnhbstock.com
116	长城国瑞证券有限公司 注:只代销A份额。	办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼 法定代表人:王勇 联系人:布前 电话:（010）68085771 传真:（010）68086282 客服电话:400–0099–886 网址:www.gwgsc.com.cn
117	华融证券股份有限公司 注:只代销A份额。	办公地址：北京朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦18层 法定代表人:祝献忠 联系人:李慧灵 电话:010–85556100 传真:010–85556088 客服电话:400–898–4999 网址:http://www.hrsec.com.cn
118	天风证券股份有限公司 注:只代销A份额。	办公地址：湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼 法定代表人:余磊 联系人:岑妹妹 电话:027–87617017 传真:027–87618863 客服电话:4008005000 网址:http://www.tfzq.com
119	江苏银行股份有限公司	办公地址:江苏省南京市中华路26号 法定代表人:夏平 联系人:张洪玮 电话:(025)58587036 传真:(025)58587820 客服电话:95319 网址:http://www.jsbchina.cn
120	东莞农村商业银行股份有限公司	办公地址:广东省东莞市东城区鸿福东路2号 法定代表人:王耀球 联系人:洪晓琳 电话:0769–22866143 传真:0769–22866282 客服电话:(0769)961122 网址:http://www.drcbank.com/
121	诺亚正行基金销售有限公司	办公地址:上海市杨浦区秦皇岛路32号C栋 法定代表人:汪静波 联系人:张裕 电话:021–38509735 传真:021–38509777 客服电话:400–821–5399 网址:http://www.noah–fund.com
122	深圳众禄基金销售股份有限公司	办公地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801 法定代表人:薛峰 联系人:童彩平 电话:0755–33227950 传真:0755–33227951 客服电话:4006–788–887 网址:http://www.jmmw.com;https://www.zlfund.cn
123	上海天天基金销售有限公司	办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座 法定代表人:其实 联系人:屠彦洋 电话:95021 传真:（021）64385308 客服电话:400–1818–188 网址:http://www.1234567.com.cn
124	浙江同花顺基金销售有限公司	办公地址：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大厦 法定代表人:吴强 联系人:林海明 传真:0571–86800423 客服电话:4008–773–772 网址:http://www.5ifund.com
125	南京苏宁基金销售有限公司	办公地址:南京市玄武区苏宁大道1–5号 法定代表人:刘汉青 联系人:喻明明 电话:025–66996699–884131 传真:025–66008800–884131 客服电话:95177 网址:http://www.snjijin.com/
126	北京唐鼎耀华基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区建外大街19号国际大厦A座1503 法定代表人:张冠宇 联系人:王丽敏 电话:010–85932810 传真:010–59200800 网址:http://www.tdyhfund.com
127	北京植信基金销售有限公司	办公地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室–67 法定代表人:于龙 联系人:吴鹏 电话:010–56075718 传真:010–67767615 客服电话:400–680–2123 网址:http://www.zhixin–inv.com
128	海银基金销售有限公司	办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼402室 法定代表人:巩巧丽 联系人:秦琼 电话:021–80134149 传真:021–80133413 客服电话:4008081016 网址:http://www.fundhaiyin.com
129	上海基煜基金销售有限公司	办公地址：上海昆明路518号北美广场A1002 法定代表人:王翔 联系人:蓝杰 电话:021–65370077 传真:021–55085991 客服电话:4008–205–369 网址:http://www.jiyufund.com.cn
130	上海陆金所基金销售有限公司	办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 法定代表人:胡学勤 联系人:宁博宇 电话:021–20665952 传真:021–22066653 客服电话:4008219031 网址:http://www.lufunds.com
131	奕丰基金销售有限公司	办公地址:深圳市南山区蛇口街道后海滨路与海德三道交汇处航天科技广场A座17楼1704室 法定代表人:TEO WEE HOWE 联系人:叶健 电话:0755–89460500 传真:0755–21674453 网址:https://www.ifastps.com.cn/
132	广发证券股份有限公司	办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦 法定代表人:孙树明 联系人:陈娜娜 传真:（020）87555305 客服电话:95575或致电各地营业网点 网址:http://www.gf.com.cn
133	中信证券股份有限公司	办公地址:深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦;北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦 法定代表人:张佑君 联系人:郑慧 电话:010–60838888 客服电话:95558 网址:http://www.cs.ecitic.com
134	申万宏源证券有限公司	办公地址:上海市徐汇区长乐路989号 法定代表人:李梅 联系人:陈宇 电话:021–33388214 传真:021–33388224 客服电话:95523或4008895523 网址:http://www.swhysc.com
135	中信证券(山东)有限责任公司	办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层 法定代表人:姜晓林 联系人:焦刚 电话:（0531）89606166 传真:（0532）85022605 客服电话:95548 网址:http://sd.citics.com/
136	中信证券华南股份有限公司	办公地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层,20层 法定代表人:胡伏云 联系人:奚薇 电话:020–88836999 传真:020–88836984 客服电话:95396 网址:http://www.gzs.com.cn
137	申万宏源西部证券有限公司	办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路358号大成国际大厦20楼2005室 法定代表人:李琦 联系人:王怀春 电话:0991–2307105 传真:0991–2301927 客服电话:4008–000–562 网址:www.hysec.com
138	中信期货有限公司	办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1303–1306室,14层 法定代表人:张皓 联系人:刘宏莹 电话:010–60833754 传真:021–60819988 客服电话:400–990–8826 网址:http://www.citicsf.com
139	爱建证券有限责任公司	办公地址:中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1600号1幢32层 法定代表人:祝健 联系人:姚盛盛 电话:（021）32229888 传真:021–68728703 客服电话:4001962502 网址:http://www.ajzq.com
140	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司 注:只代销A份额。	办公地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704 法定代表人:洪弘 联系人:文雯 电话:010–83363101 传真:010–83363072 客服电话:400–166–1188 网址:8.jrj.com.cn
141	上海挖财基金销售有限公司 注:只代销A份额。	办公地址:上海浦东杨高南路799号3号楼5楼 法定代表人:冷飞 联系人:孙琦 电话:021–50810687 传真:021–58300279 客服电话:021–50810673 网址:http://www.wacaijijin.com
142	上海万得基金销售有限公司 注:只代销A份额。	办公地址:中国（上海）浦东新区福山路33号9楼 法定代表人:王廷富 联系人:徐亚丹 电话:021–68882280 传真:021–68882281 客服电话:400–821–0203 网址:https://www.520fund.com.cn/
143	凤凰金信(银川)基金销售有限公司 注:只代销A份额。	办公地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中心商务区万寿路142号14层办公房 法定代表人:张旭 联系人:汪莹 电话:010–58160168 传真:010–58160173 客服电话:400–810–55919 网址:http://www.fengjrd.com/
144	北京肯特瑞基金销售有限公司 注:只代销A份额。	办公地址：北京市通州区亦庄经济技术开发区科创十一街18号院京东集团总部A座15层 法定代表人:王苏宁 联系人:陈龙鑫 电话:4000988511 传真:010–89188000 客服电话:95118 网址:kenterui.jd.com
145	腾安基金销售(深圳)有限公司	办公地址：深圳市南山区海天二路33号腾讯滨海大厦15楼 法定代表人:刘明军 联系人:谭广锋 电话:0755–86013388–80618 传真:– 客服电话:95017 网址:http://www.tenganxinxi.com或http://www.txfund.com
146	北京百度百盈基金销售有限公司	办公地址:北京市海淀区上地十街10号1幢1层101 法定代表人:葛新 联系人:杨琳 电话:010–61952702 传真:010–61951007 客服电话:95055 网址:http://www.baiyingfund.com
147	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座 法定代表人:祖国明 联系人:韩爱彬 电话:021–60897840 传真:0571–26997013 客服电话:400–0766–123 网址:http://www.fund123.cn
148	北京汇成基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108室 法定代表人:王伟刚 联系人:丁向坤 电话:010–56282140 传真:010–62680827 客服电话:400–619–9059 网址:http://www.hcjjin.com/
149	北京新浪仓石基金销售有限公司	办公地址：北京市海淀区北四环西路58号理想国际大厦906室 联系人:李唯 电话:010–62676405 传真:010–62676582 客服电话:010–62675369 网址:http://www.xincai.com
150	北京蛋卷基金销售有限公司	办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层 法定代表人:钟斐斐 联系人:侯芳芳 电话:010–61840688 传真:010–61840699 客服电话:400–159–9288 网址:https://danjuanapp.com/

（二）场内代销机构

场内代销机构是指具有基金代销业务资格、并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位。

（三）基金注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所,办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	程爽
电话	（010）59378992	传真	（010）58598907

（四）律师事务所和经办律师

名称	北京市金杜律师事务所		
住所,办公地址	北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心写字楼A座40层		
负责人	王玲	联系人	彭晋
电话	（010）5878 5588	传真	（010）58785566
经办律师	彭晋、唐丽子		

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01室		
办公地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼		
法定代表人	李丹	联系人	周伟
电话	（021）23238888	传真	（021）23238800
经办注册会计师	薛竞、周伟		

四、基金名称

嘉实中证锐联基本面50指数证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

本基金类型:上市契约型开放式,股票型证券投资基金。

六、基金的投资目标

本基金采用指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段,追求对标的指数的有效跟踪。

七、基金的投资范围

本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如果法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金投资组合中成份股及备选股投资比例不低于基金资产的90%;权证市值不超过基金资产净值的3%；现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

因基金规模或市场变化等因素导致本基金投资组合不符合上述规定的，基金管理人将在10个工作日内调整至符合上述规定。法律、法规另有规定的,从其规定。

八、基金的投资策略

本基金采取完全指数复制法，即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。但在因特殊情况（如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等）导致无法获得足够数量的股票时,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。

本基金的风险控制目标是追求日均跟踪误差偏离度的绝对值不超过0.35%,年化跟踪误差不超过4%。在跟踪误差允许的情况下,本基金投资于标的指数成份股、备选股以及依法发行或上市的其他股票、固定收益类证券、现金、短期金融工具、权证和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的固定收益类证券投资范围包括国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、中央银行票据、短期融资券、回购（包括正回购和逆回购）、资产支持证券等。

如果未来法律法规或监管机构允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资将遵照:

1.决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定。

2.投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。基金经理负责基金的日常投资运作,基金投资的重大事项需向投资决策委员会报告。

3.投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

（1）研究:指数投资研究人员依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股等相关信息的搜集与分析、流动性分析等工作,作为基金投资决策的重要依据。

（2）投资决策:投资决策委员会依据指数投资研究小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

（3）组合构建:基金经理根据标的指数相关信息,结合内部指数投资研究,以指数复制法构建组合。在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的投资方法,以降低投资成本、控制投资风险。

（4）交易执行:集中交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

（5）投资绩效评估:投资流程与风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否，基金经理可以据此检讨投资策略，进而调整投资组合。

（6）组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中公告。

九、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准:

95% × 中证锐联基本面 50 指数收益率 + 5% × 银行同业存款收益率

中证锐联基本面50指数以基本面指标来衡量上市公司的经济规模，选取其中最大的50

家A股上市公司作为样本,且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数综合反映了中国证券市场基本面良好企业的整体状况，适合作为本基金的标的指数。

如果相关法律法规发生变化,或中证锐联基本面50指数被停止编制及发布,或中证锐联基本面50指数由其他指数替代（单纯更名除外）,或由于指数编制方法等重大变更导致中证锐联基本面50指数不宜继续作为标的指数，或证券市场上出现其他更合适投资的指数作为本基金的标的指数，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，与托管人协商一致并履行相关程序后，变更本基金的标的指数,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十一、基金投资组合报告

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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年7月16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。

本投资组合报告所载数据截至2020年6月30日（“报告期末”）,本报告所列财务数据未经审计。

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	1,553,513,283.35	93.61
	其中:股票	1,553,513,283.35	93.61
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	30,492,000.00	1.84
	其中:债券	30,492,000.00	1.84
	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	68,467,612.27	4.13
8	其他资产	7,039,320.90	0.42
9	合计	1,659,512,216.52	100.00

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

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	96,262,118.88	5.82
C	制造业	257,248,481.65	15.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,862,969.06	2.62
E	建筑业	181,800,740.41	11.11
F	批发和零售业	23,555,926.00	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	22,472,514.28	1.37
H	住宿和餐饮业	–	–
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,011,040.16	1.28
J	金融业	791,165,755.91	48.34
K	房地产业	116,388,192.10	7.11
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	–	–
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	1,551,767,738.45	94.81

(2) 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

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	1,407,023.53	0.09
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	190,731.77	0.01
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	147,789.60	0.01
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	1,745,544.90	0.11

3. 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

(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	601318	中国平安	1,968,016	140,516,342.40	8.59
2	601166	兴业银行	4,786,009	75,523,222.02	4.61
3	601668	中国建筑	15,655,430	74,676,401.10	4.56
4	601328	交通银行	13,443,695	68,966,155.35	4.21
5	601398	工商银行	13,828,195	68,864,411.10	4.21
6	600036	招商银行	2,034,161	68,591,908.92	4.19
7	000002	万科A	2,090,130	54,635,998.20	3.34
8	600016	民生银行	9,635,827	54,635,139.09	3.34
9	600028	中国石化	12,059,105	47,151,100.55	2.88
10	600000	浦发银行	4,430,586	46,875,599.88	2.86

(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	688598	金博股份	7,645	595,851.30	0.04
2	688100	威胜信息	11,602	300,723.84	0.02
3	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
4	688178	万德斯	3,704	147,789.60	0.01
5	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01

4. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	30,492,000.00	1.86
	其中:政策性金融债	30,492,000.00	1.86
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债（可交换债）	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	30,492,000.00	1.86

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	180203	18国开03	300,000	30,492,000.00	1.86

注:报告期末,本基金仅持有上述1支债券。

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。

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。

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。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

11. 投资组合报告附注

(1) 声明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。

（a）2019年10月12日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监银罚决字（2019）7号）,对上海浦东发展银行股份有限公司对成都分行授信业务及整改情况严重失察等违法违规事实,于2019年6月24日作出行政处罚决定，罚款合计130万元。 根据中国银行保险监督管理委员会北京监管局发布法人行政处罚信息公开表京银保监罚决字（2019）56号,对民生银行总行同业票据业务管理失控、违反内控指引要求计量转贴现卖断业务信用风险加权资产、案件风险信息报送管理不到位等12项违规事实于2019年12月20日做出行政处罚决定，责令民生银行股份有限公司改正,并给予合计700万元罚款的行政处罚,对顾立辉给予警告并处5万元罚款的行政处罚。2020年2月14日，中国人民银行发布银罚字【2020】1号,于2020年2月10日对中国民生银行股份有限公司作出行政处罚决定,因其未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易,处以2360万元罚款。 2020年1月8日,中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2019】24号）,对交通银行股份有限公司授信审批不审慎、总行对分支机构管控不力承担管理责任等违法违规事实，于2019年12月27日作出行政处罚决定,罚款合计150万元。2020年4月20日,根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）6号）,对交通银行股份有限公司理财产品数量漏报、信贷业务担保合同漏报、分户账账户数据应报未报等违法违规事实,因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定,罚款合计260万元。 2020年4月20日,根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）7号）,对中国工商银行股份有限公司理财产品数量漏报、贷款核销业务漏报、委托贷款业务应报未报等违法违规事实,因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定,罚款合计270万元。 本基金投资于“浦发银行（600000）”、“民生银行（600016）”、“交通银行（601328）”、“工商银行（601398）”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,浦发银行、民生银行、交通银行、工商银行为标的指数成份股,本基金投资于“浦发银行”、“民生银行”、“交通银行”、“工商银行”股票的决策流程,符合公司投资管理制度的相关规定。 （b）报告期内本基金投资的前十名证券中,其他六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。

(2)

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。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	107,264.24
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	438,598.50
5	应收申购款	6,493,458.16
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	7,039,320.90

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688598	金博股份	595,851.30	0.04	科创板新股锁定
2	688100	威胜信息	300,723.84	0.02	科创板新股锁定
3	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新发未上市
4	688178	万德斯	147,789.60	0.01	科创板新股锁定
5	688377	迪威尔	129,619.48	0.01	新发未上市

十二、基金业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本报告期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

嘉实基本面50指数(LOF)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
2009年12月30日（基金合同生效日）至2009年12月31日	0.00%	0.00%	3.04%	1.79%	–3.04%	–1.79%
2010年	–26.11%	1.42%	–27.49%	1.45%	1.38%	–0.03%
2011年	–14.56%	1.12%	–14.65%	1.12%	0.09%	0.00%
2012年	11.28%	1.01%	9.81%	1.02%	1.47%	–0.01%
2013年	–10.82%	1.39%	–12.34%	1.38%	1.52%	0.01%
2014年	77.24%	1.33%	72.20%	1.34%	5.04%	–0.01%
2015年	5.21%	2.38%	5.10%	2.35%	0.11%	0.03%
2016年	3.87%	1.11%	1.04%	1.04%	2.83%	0.07%
2017年	28.12%	0.65%	24.91%	0.65%	3.21%	0.00%
2018年	–12.79%	1.23%	–14.63%	1.23%	1.84%	0.00%
2019年	21.37%	1.05%	18.29%	1.05%	3.08%	0.00%
2020年1月1日至2020年6月30日	–11.73%	1.26%	–13.37%	1.26%	1.64%	0.00%

嘉实基本面50指数(LOF)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
2018年8月8日（C类份额成立日）至2018年12月31日	–4.42%	1.28%	–4.08%	1.28%	–0.34%	0.00%
2019年	20.84%	1.05%	18.29%	1.05%	2.55%	0.00%
2020年1月1日至2020年6月30日	–11.90%	1.26%	–13.37%	1.26%	1.47%	0.00%

（二）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

图1:嘉实基本面50指数(LOF)A基金份额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

（2009年12月30日至2020年6月30日）

图2:嘉实基本面50指数(LOF)C基金份额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

（2018年8月9日至2020年6月30日）

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6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十一（三）投资范围和（七）2、投资组合限制）的有关约定。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费;

（2）基金托管人的托管费;

（3）基金的销售服务费;

（4）基金合同生效后的指数许可使用费;

（5）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

（6）《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

（7）基金份额持有人大会费用;

（8）因基金的证券交易或结算而产生的费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等）;

（9）基金的银行汇划费用;

（10）按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×1.0%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基