深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2018年第2号）

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

深证基本面120交易型开放式指数证券投资（以下简称“本基金或基金”）根据2011年6月9日中国证券监督管理委员会《关于核准嘉实深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》（证监许可［2011]906号）核准进行募集。本基金基金合同于2011年8月1日起生效，自该日起基金管理人正式开始管理本基金。

重要提示

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《证券投资基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人承诺以恪尽职守、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，也不向投资者保证最低收益。

本摘要所载内容截止日为2018年8月1日（特别事项注明截止日除外），有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日(未经审计)。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

1.基本情况

名称	嘉实基金管理有限公司
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心二期53层09-11单元
办公地址	北京市建国门北大街8号华润大厦6层
法定代表人	赵学军
成立日期	1999年3月25日
注册资本	1.5亿元
股权结构	中诚信托有限责任公司40%，德意志资产管理（亚洲）有限公司30%，立信投资有限责任公司30%。
存续期间	持续经营
电话	010 65215588
传真	010 65185678
联系人	胡勇钦

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

（二）主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、总经理及其他高级管理人员基本情况

牛成立先生，联席董事长，经济学硕士，中共党员。曾任中国人民银行非银行金融机构监管司副处长、处长；中国银行厦门分行党委委员、副行长（挂职）；中国银行业监督管理委员会（下称银监会）非银行金融机构监管部处长；银监会新疆监管局党委委员、副局长；银监会银行监管四部副主任；银监会黑龙江监管局党委书记、局长；银监会融资性担保业务工作部（融资性担保业务监管部际联席会议办公室）主任；中诚信托有限责任公司党委委员、总裁。现任中诚信托有限责任公司党委书记、董事长，兼任中国信托业保障基金有限责任公司董事。

赵学军先生，董事长，党委书记，经济学博士。曾就职于天津通信广播公司电视设计所、外经贸部中国仪器进出口总公司、北京商品交易所、天津纺织原材料交易所、商期期货经纪有限公司、北京证券有限公司、大成基金管理有限公司。2000年10月至2017年12月任嘉实基金管理有限公司董事、总经理，2017年12月起任公司董事长。

朱蕾女士，董事，硕士研究生，中共党员。曾任保监会财务部资金运用处主任科员；国都证券有限责任公司研究部高级经理；中欧基金管理有限公司董秘兼发展战略官；现任中诚信托有限责任公司总裁助理兼国际业务部总经理；兼任中诚国际资本有限公司总经理、深圳前海中诚股权投资基金管理有限公司董事长、总经理。

高峰先生，董事，美国籍，美国纽约州立大学石溪分校博士。曾任所罗门兄弟公司利息衍生品副总裁，美国友邦金融产品集团结构产品部副总裁。自1996年加入德意志银行以来，曾任德意志银行（纽约、香港、新加坡）董事、全球市场部中国区主管、上海分行行长，2008年至今任德意志银行（中国）有限公司行长、德意志银行集团中国区总经理。

Jonathan Paul Eilbeck先生，董事，英国籍，南安普顿大学学士学位。曾任Sena Consulting公司咨询顾问，JP Morgan固定收益亚太区CFO、COO，JP Morgan Chase固定收益亚太区CFO、COO，德意志银行资产与财富管理全球首席运营官。2008年至今任德意志银行资产管理全球首席运营官。

韩家乐先生，董事。1990年毕业于清华大学经济管理学院，硕士研究生。1990年2月至2000年5月任海问证券投资咨询有限公司总经理；1994年至今，任北京德恒有限责任公司总经理；2001年11月至今，任立信投资有限责任公司董事长。

王巍先生，独立董事，美国福特姆大学文理学院国际金融专业博士。曾任职于中国建设银行辽宁分行。曾任中国银行总行国际金融研究所助理研究员，美国化学银行分析师，美国世界银行顾问，中国南方证券有限公司副总裁，万盟投资管理有限公司董事长。2004至今任万盟并购集团董事长。

汤欣先生，独立董事，中共党员，法学博士，清华大学法学院教授、清华大学商法研究中心副主任、《清华法学》副主编，汤姆森路透集团“中国商法”丛书编辑咨询委员会成员。曾兼任中国证券监督管理委员会第一、二届并购重组审核委员会委员，现兼任上海证券交易所上市委员会委员、中国上市公司协会独立董事委员会首任主任。

王瑞华先生，独立董事，管理学博士，会计学教授，注册会计师，中共党员。曾任中央财经大学财务会计教研室主任、研究生部副主任。2012年12月起担任中央财经大学商学院院长兼MBA教育中心主任。

张树忠先生，监事长，经济学博士，高级经济师，中共党员。曾任华夏证券公司投资银行部总经理、研究发展部总经理；光大证券公司总裁助理、北方总部总经理、资产管理总监；光大保德信基金管理公司董事、副总经理；大通证券股份有限公司副总经理、总经理；大成基金管理有限公司董事长，中国人保资产管理股份有限公司副总裁、首席投资执行官；中诚信托有限责任公司副董事长、党委副书记。现任中诚信托有限责任公司党委副书记、总裁，兼任中诚资本管理（北京）有限公司董事长。

穆群先生，监事，经济师，硕士研究生。曾任西安电子科技大学助教，长安信息产业（集团）股份有限公司董事会秘书，北京德恒有限责任公司财务主管。2001年11月至今任立信投资有限公司财务总监。

龚康先生，监事，中共党员，博士研究生。2005年9月至今就职于嘉实基金管理有限公司人力资源部，历任人力资源高级经理、副总监、总监。

曾宪政先生，监事，法学硕士。1999年7月至2003年10月就职于首钢集团，2003年10月至2008年6月，为国浩律师集团（北京）事务所证券部律师。2008年7月至今，就职于嘉实基金管理有限公司法律稽核部、法律部，现任法律部总监。

经雷先生，总经理，金融学、会计学专业本科学历，工商管理学学士学位，特许金融分析师（CFA）。1998年到2008年在美国国际集团（AIG）国际投资公司美国纽约总部担任研究投资工作。2008年到2013年历任友邦保险中国区资产管理中心副总监，首席投资总监及资产管理中心负责人。2013年10月至今就职于嘉实基金管理有限公司，历任董事总经理（MD）、机构投资和固定收益业务首席投资官；2018年3月起任公司总经理。

宋振茹女士，副总经理，中共党员，硕士研究生，经济师。1981年6月至1996年10月任职于中办警卫局。1996年11月至1998年7月于中国银行海外行管理部任副处长。1998年7月至1999年3月任博时基金管理公司总经理助理。1999年3月至今任职于嘉实基金管理公司，历任督察员和公司副总经理。

王炜女士，督察长，中共党员，法学硕士。曾就职于中国政法大学法学院、北京市陆通联合律师事务所、北京市智浩律师事务所、新华保险股份有限公司。曾任嘉实基金管理有限公司法律部总监。

邵健先生，副总经理，硕士研究生。历任国泰证券行业研究员，国泰君安证券行业研究部副经理，嘉实基金管理有限公司基金经理、总经理助理。

李松林先生，副总经理，工商管理硕士。历任国元证券深圳证券部信息总监，南方证券金通证券部总经理助理，南方基金运作部副总监，嘉实基金管理有限公司总经理助理。

2、基金经理

（1）现任基金经理

刘珈吟女士，硕士研究生，9年证券从业经历。2009 年加入嘉实基金管理有限公司，任指数投资部指数研究员一职。2016年3月24日至今担任嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实中证金融地产ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实中证医药卫生ETF及本基金基金经理，2017年6月7日至今任嘉实中关村ETF基金经理。

李直先生，2014年7月加入嘉实基金，从事指数基金投资研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格，3年证券从业经历。2017年12月26日至今任嘉实深证基本面120ETF联接以及本基金基金经理。

（2）历任基金经理：

2011年8月1日至2014年3月11日，杨阳先生任本基金基金经理。

2014年3月11日至2016月1与5日，杨宇先生任本基金基金经理。

2016年1月5日至2017年12月26日，何如女士任本基金基金经理。

3、股票投资决策委员会

股票投资决策委员会的成员包括：公司副总经理兼股票投资业务联席CIO邵健先生，公司总经理经雷先生，各策略组投资总监陈少平女士、邵秋涛先生、张金涛先生、胡涛先生、谭丽女士，人工智能投资部负责人张自力先生。

上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

首次注册登记日期：1983年10月31日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：陈四清

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：王永民

传真：（010）66594942

中国银行客服电话：95566

（二）基金托管部门及主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内，中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

（三）证券投资基金托管情况

截至2018年6月30日，中国银行已托管674只证券投资基金，其中境内基金638只，QDII基金36只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1.申购赎回代办券商

（1）.中信建投证券股份有限公司

住所，办公地址	北京市朝阳区安立路66号4号楼		
注册地址	北京市朝阳区安立路66号4号楼		
法定代表人	王常青	联系人	权唐
电话	010 65183880	传真	010 65182261
网址	http://www.csc108.com	客服电话	400-8888-108

（2）.国信证券股份有限公司

办公地址	广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层		
注册地址	深圳市红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层		
法定代表人	何如	联系人	周杨
电话	0755-82130833	传真	0755-82133952
网址	http://www.guosen.com.cn	客服电话	95536

（3）.招商证券股份有限公司

住所，办公地址	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层		
注册地址	深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层		
法定代表人	霍达	联系人	林生迎
电话	(0755)82943666	传真	(0755)82943636
网址	http://www.cmschina.com	客服电话	4008888111 ,95565

（4）.广发证券股份有限公司

住所	广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）		
办公地址	广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼、18楼、19楼、36楼、38楼、39楼、41楼、42楼、43楼和44楼		
注册地址	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室		
法定代表人	孙树明	联系人	黄岚
电话	020 87555888	传真	020 87555305
网址	http://www.gf.com.cn	客服电话	95575或致电各地营业网点

（5）.中信证券股份有限公司

住所	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦		
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		
注册地址	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座		
法定代表人	张佑君	联系人	郑慧
电话	010-60838888		
网址	http://www.cs.ecitic.com	客服电话	95558

（6）.中国银河证券股份有限公司

住所	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座		
办公地址	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层		
注册地址	北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座2-6层		
法定代表人	陈共炎	联系人	辛国政
电话	010-83574507	传真	010-83574807
网址	http://www.chinastock.com.cn	客服电话	400-8888-888

（7）.海通证券股份有限公司

住所	上海淮海中路98号		
办公地址	上海市广东路689号		
注册地址	上海市广东路689号		
法定代表人	周杰	联系人	金芸、李笑鸣
电话	(021)23219000	传真	(021)23219100
网址	http://www.htsec.com	客服电话	95553或按打各城市营业网点咨询电话

（8）.申万宏源证券有限公司

住所	上海市徐汇区长乐路989号40层		
办公地址	上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层		
注册地址	上海市徐汇区长乐路989号45层		
法定代表人	李梅	联系人	王权胤
电话	021-33389888	传真	021-33388224
网址	http://www.swhysc.com	客服电话	021-962505/95523

（9）.兴业证券股份有限公司

住所	福州市湖东路268号		
办公地址	福建省福州市湖东路268号		
注册地址	福建省福州市湖东路268号		
法定代表人	杨华辉	联系人	乔琳雪
电话	021-38565547		
网址	http://www.xyzq.com.cn	客服电话	95562

（10）.方正证券股份有限公司

住所	湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
办公地址	湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717		
注册地址	湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层		
法定代表人	施华	联系人	丁敏
电话	(010)59355997	传真	(010)56437013
网址	http://www.founderse.com	客服电话	95571

（11）.光大证券股份有限公司

住所，办公地址	上海市静安区新闸路1508号		
注册地址	上海市静安区新闸路1508号		
法定代表人	周健男	联系人	刘晨、李芳芳
电话	021 22169999	传真	021 22169134
网址	http://www.ebscn.com	客服电话	4008888788 ,10108998

（12）.中泰证券股份有限公司

住所	山东省济南市市中区经七路86号		
办公地址	济南市市中区经七路86号		
注册地址	山东省济南市市中区经七路86号		
法定代表人	李玮	联系人	许曼华
电话	021-20315290		
网址	http://www.zts.com.cn/	客服电话	95538

（13）.湘财证券股份有限公司

住所	湖南省长沙市芙蓉区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
办公地址	湖南省长沙湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
注册地址	湖南省长沙湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼		
法定代表人	林俊波	联系人	李欣
电话	(021)38784580	传真	(021)68865680
网址	http://www.xcsc.com	客服电话	95351

（14）.渤海证券股份有限公司

住所	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
办公地址	天津市南开区宾水西道8号		
注册地址	天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室		
法定代表人	王春峰	联系人	蔡霆
电话	(022)28451991	传真	(022)28451892
网址	http://www.bhzq.com	客服电话	4006515988

（15）.华宝证券有限责任公司

住所	上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层		
办公地址	上海市浦东新区世纪大道100号57层		
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道100号57层		
法定代表人	陈林	联系人	夏元
电话	021 68777222	传真	021 68777822
网址	http://www.cnhbstock.com	客服电话	4008209898

2.二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金二级市场交易。

（二）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	丁志勇
电话	010 59378982	传真	010 58598907

（三）律师事务所和经办律师

名称	上海市通力律师事务所		
住所，办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心19楼		
负责人	韩炯	联系人	黎明
电话	021 31358666	传真	021 31358600
经办律师	吕红、黎明		

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）		
住所	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼		
办公地址	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	张勇
电话	021 23238888	传真	021 23238800
经办注册会计师	薛竞、张勇		

四、基金的名称

本基金名称：深证基本面120交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

七、基金的投资范围

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于一级市场新股或增发的股票、衍生工具（权证等）、债券资产（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）、央行票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购等固定收益类资产、现金资产，以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

如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，可以将其纳入投资范围。

本基金将把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%。

八、基金的投资策略

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。但在因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用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。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因标的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正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。

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是基金管理人运用基金财产的决策依据。

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团队制。投资决策委员会负责决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策；基金经理决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

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：指数投资研究小组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、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作，撰写研究报告，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：根据标的指数相关信息，结合内部指数投资研究，基金经理主要以指

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指数投资的方法，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：风险管理部门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、基金的业绩比较基准

本基金的标的指数及业绩比较基准为：深证基本面120指数。

深证基本面120指数在深圳证券交易所上市公司中，以 4 个基本面指标来衡量上市公司的经济规模，并选取其中最大的120 家公司作为样本，且样本个股的权重配置与其经济规模相适应。该指数不仅具有良好的基本面、市场代表性和流动性，且打破了样本股价格与其权重之间的联系，使得基本面经济规模大的股票可以获得较高的权重，并在一定程度上减少了高估股票在组合中权重过高的现象，因此可以为投资者提供另一个投资深圳市场的业绩比较基准和投资分析工具，适合作为本基金的标的指数。

如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布，或者上述标的指数由其他指数代替，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，通过适当的程序变更本基金的标的指数，并同时更换本基金的基金名称与业绩比较基准。若标的指数变更对基金投资无实质性影响(包括但不限于编制机构变更、指数更名等)，无需召开基金份额持有人大会，基金管理人可在取得基金托管人同意后变更标的指数，报中国证监会备案并及时公告。

十、基金的风险收益特征

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。

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。

本基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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2018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	360,604,071.51	98.15
	其中：股票	360,604,071.51	98.15
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	5,000,000.00	1.36
	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	1,812,977.07	0.49
8	其他资产	1,057.62	0.00
9	合计	367,418,106.20	100.00

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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	9,623,461.20	2.63
B	采矿业	4,136,070.51	1.13
C	制造业	222,381,621.05	60.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,814,260.70	2.13
E	建筑业	3,679,740.50	1.00
F	批发和零售业	13,848,842.19	3.78
G	交通运输、仓储和邮政业	733,918.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	45,046,604.57	12.29
K	房地产业	46,562,587.79	12.71
L	租赁和商务服务业	5,023,874.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,372,105.00	0.37
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	379,892.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	360,602,977.51	98.40

（2）报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

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

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	000651	格力电器	734,294	34,621,962.10	9.45
2	000333	美的集团	441,298	23,044,581.56	6.29
3	000002	万 科A	881,927	21,695,404.20	5.92
4	000001	平安银行	1,802,135	16,381,407.15	4.47
5	000100	TCL 集团	3,276,800	9,502,720.00	2.59
6	300498	温氏股份	408,160	8,987,683.20	2.45
7	000338	潍柴动力	1,018,548	8,912,295.00	2.43
8	000858	五 粮 液	116,717	8,870,492.00	2.42
9	000725	京东方A	2,399,700	8,494,938.00	2.32
10	000776	广发证券	537,631	7,134,363.37	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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有债券。

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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

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

报告期末，本基金未持有权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

11.投资组合报告附注

（1）

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、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	1,734.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-676.99
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,057.62

（4）报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

（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

报告期末，本基金指数投资的前十名股票中不存在流通受限情况。

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

报告期末，本基金未持有积极投资股票。

十二、基金的业绩

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。

1.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

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
基金合同生效日（2011年8月1日）-2011年12月31日	-19.24%	1.18%	-26.10%	1.45%	6.86%	-0.27%
2012年	0.97%	1.37%	0.83%	1.39%	0.14%	-0.02%
2013年	-5.49%	1.43%	-6.42%	1.44%	0.93%	-0.01%
2014年	53.32%	1.26%	52.22%	1.27%	1.10%	-0.01%
2015年	21.85%	2.45%	20.72%	2.57%	1.13%	-0.12%
2016年	-5.89%	1.41%	-5.04%	1.42%	-0.85%	-0.01%
2017年	35.32%	0.92%	34.39%	0.92%	0.93%	0.00%
2018年上半年	-13.81%	1.44%	-13.98%	1.44%	0.17%	0.00%

2.自基金合同生效以来基金份额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

嘉实深证基本面120ETF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

图：嘉实深证基本面120ETF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

（2011年8月1日至2018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3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“十五、基金的投资（二）投资范围和（八）2、基金投资组合比例限制”的有关约定。

十三、费用概览

（一） 基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的0.5%年费率计提。

在通常情况下，基金管理费按前一日的资产净值乘以0.5%的费率来计算，计算方法如下：

H＝E×0.5%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人

（2）基金托管人的托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.1%年费率计提。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

(3)基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。其中，基金合同生效前的许可使用固定费不列入基金费用。

本基金的指数许可基点费按照前一日基金资产的万分之十的年费率计提。指数许可使用基点费按照前述标准每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

H=E×指数许可使用基点费/当年天数

H为每日应付的指数许可使用基点费，E为前一日的基金资产净值

基金合同生效后的指数许可使用费按日计提，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金指数许可使用费划款指令，基金托管人复核后于次季前10 个工作日内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

指数许可使用费收取下限为每季度人民币伍万元（5万元），即不足伍万元时按照伍万元收取

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数使用费。基金管理人应在招募说明书及其更新中披露基金最新适用的方法。

（4）与基金运作有关的其他费用

主要包括因基金的证券交易或结算而产生的费用、基金合同生效以后的信息披露费用、基金份额持有人大会费用、基金上市费及年费、基金合同生效以后的会计师费和律师费、基金的资金汇划费用等。该等费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定，列入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

（二）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失等不列入基金费用。

（三）基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。

（四）基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募