

嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2018年08月25日

重要提示
基金管理人、董事和高级管理人员不存在虚假记载、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法律责任。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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,也不保证最低收益。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告财务数据未经审计。

本报告期内2018年1月1日起至2018年6月30日止。
2.1 基金简介
2.1.1 基金基本情况

Table with 2 columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金管理人, 基金托管人, etc.

2.2 基金产品说明
2.2.1 基金投资目标
2.2.2 基金投资策略
2.2.3 基金业绩比较基准

2.3 基金管理人及基金托管人
2.3.1 基金管理人
2.3.2 基金托管人

2.4 信息披露方式
2.4.1 信息披露网站
2.4.2 基金年度报告备置地点

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标

Table with 2 columns: 指标名称, 本报告期(2018年01月01日至2018年06月30日)

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。

(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)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

Table with 5 columns: 期间, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率, 超额收益, etc.

3.2.2 自基金合同生效以来基金基金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

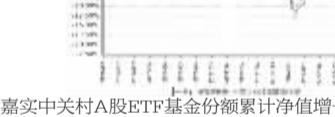


图:嘉实中关村A股ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势对比图

(2017年6月7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(十二)(二)投资范围和(七)投资限制的有关约定。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金基本情况
4.1.1 基金管理人及基金基本情况

基金管理人嘉实基金管理有限公司,成立于1999年3月25日,是经中国证监会批准设立的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,公司总部设在北京,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人及QDII、特定资产管理业务资格。

截止2018年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金,142只开放式证券投资基金,具体包括嘉实货币、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300 ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题精选混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国混合(ODI)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实价值优势混合、嘉实稳盈回报混合、嘉实H股指数(ODI-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(ODI-POF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产基金、嘉实理财宝7天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实中证500ETF、嘉实中证中期企业债债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期企业债ETF、嘉实中证中债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票(ODI)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场化债、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实货币A/B、嘉实活期货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活期包债、嘉实泰和混合、嘉实鑫生宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实消费精选混合、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实新机遇混合发起式、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点灵活配置混合、嘉实腾讯自选股大数据股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长灵活配置混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航灵活配置混合、嘉实新嘉实灵活配置混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新常态灵活配置混合、嘉实新趋势灵活配置混合、嘉实新优选灵活配置混合、嘉实新思路灵活配置混合、嘉实沪深港精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合(LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实研究增强混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实新添程混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实沪深港深回报混合、嘉实现金添利货币、嘉实原油(ODI-LOF)、嘉实前沿科技沪深港股票、嘉实稳安债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳天纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合源双债两年定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添定定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、其中嘉实增长混合、嘉实稳鑫混合和嘉实多个全国社保基金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金业绩(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 基金经理简介

注:(1)基金业绩的任职日期是指本基金基金合同生效之日;(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对于报告期内本基金运作遵守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,在严格控制投资风险的前提下,严格执行法律法规和基金合同的规定,无任何损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对于报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内,本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管理制度指导意见》和公司内部公平交易制度,各投资组合按投资管理流程和流程独立决策,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;通过完善交易流程内各交易环节的公平交易实施细则,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,同日反向交易较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%,合计4次,均为旗下组合被动跟踪标的指数需要,与其他组合发生反向交易,不存在利益输送行为。

4.4 管理人对于报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
报告期内,本基金日均跟踪误差率为0.06%,年化跟踪误差率为0.88%,符合基金合同约定的日均跟踪误差率不超过0.2%的限制。

4.4.2 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0.8226元;本报告期基金份额净值增长率为-15.86%,业绩比较基准收益率为-16.67%。

4.5 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
中关村A股指数包含符合A股市场中注册地在中关村国家自主创新示范区内的上市公司作为指数样本,反映了中关村自主创新示范区A股上市公司整体运行情况,向市场提供了有关中关村上市公司的市场标尺和业绩基准。未来中国经济发展更加倚重科技创新、技术创新、科技资源、市场资源也将更多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业,中关村A股指数较大程度上代表了创新产业。

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关基金法律要求的前提下,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,逐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。

4.6 基金管理人估值程序等事项的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定,日常估值由基金管理人及基金托管人一同进行,基金份额净值由基金管理人完成估值后,经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和中年末估值与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会,委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成,负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员会和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内,固定收益部门负责人同时兼任基金估值、估值委员,基金经理参加估值专业委员会会议,但不介入基金日常估值业务;参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突;与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所,中国证券登记结算有限责任公司,中央国债登记结算公司,中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
报告期内本基金未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明
报告期内,本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于五千万元的情形,时间范围为2018-1-1至2018-6-30;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况。

鉴于基金资产净值的下滑主要受市场环境的影响,本基金将继续运作。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵守信情况的声明
报告期内,本基金托管人在对嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守信、净值计算、利润分配等情况的说明
报告期内,嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金的托管人——嘉实基金管理有限公司在嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表

报告截止日:2018年6月30日

Table with 4 columns: 资产, 负债, 所有者权益, 项目, 2018年6月30日, 2017年12月31日, 2017年6月30日

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.8226元,基金份额总额24,322,910.00份。

6.2 利润表

报告截止日:2018年6月30日

Table with 4 columns: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.3 所有者权益变动表

Table with 4 columns: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.4 现金流量表

Table with 4 columns: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5 关联方交易

6.5.1 关联方关系

Table with 2 columns: 关联方名称, 与本基金的关联关系

注:本基金的交易对手方为中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

6.5.2 关联方交易事项

6.5.2.1 基金管理人

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.2 基金托管人

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.3 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.4 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.5 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.6 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.7 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.8 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.9 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.10 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.11 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.12 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.13 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.14 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.15 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.16 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.17 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.18 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.19 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.20 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.21 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.22 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.23 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.24 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.25 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.26 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.27 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.28 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6月30日。

6.5.2.29 关联方交易事项

Table with 4 columns: 项目, 本期, 2017年6月30日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日, 2017年6月30日至2018年6月30日

注:本基金合同生效日为2017年6月7日,上年度可比期间是指2017年6月7日至2017年6