

嘉实创业板交易型开放式指数证券投资

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
送出日期:2018年8月25日

重要提示
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。

期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券3只开放式基金属于嘉实理财通系列基金,同时,管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

Table with columns: Name, Position, Tenure, and Remarks. Lists fund managers like 邵健, 王亚伟, 张金松, etc.

注:(1)基金经理何如的任职日期指本基金基金合同生效之日,基金经理陈正邦的任职日期指公司作出决定后公告之日;(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 管理人报告期内本基金运作遵守信用的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实创业板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 管理人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政策和流程独立决策,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制度,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业绩分析

报告期内,本基金日均跟踪误差率为0.03%,年化跟踪误差率为0.44%,符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过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0.8707;本报告期基金份额净值增长率为-8.48%,业绩比较基准收益率为-8.33%。

4.5 管理人从宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

创业板指数是深交所多层次资本市场核心指数之一,由最具代表性、规模最大的创业板上市公司股票组成,反映创业板市场层次的运行情况。创业板指数新兴产业、高新技术企业占比高,成长性突出,兼具价值度与投资标的的功能。

作为被动管理的指数基金,本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下,继续秉承量化投资管理策略,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,进一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 管理人报告期内基金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、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对均采用同一方法。

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,负责审议、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历,报告期内,固定收益部门负责人同时兼任估值委员、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 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同十七(二)“1、在收益评价日,基金管理人计算基金净值增长率和标的指数同期增长率,截至收益评价日基金净值增长率减去标的指数增长率的差额超过1%,基金管理人可以进行收益分配”。收益评价日,基金净值增长率减去标的指数增长率的差额未超过1%,因此本基金报告期内未实施利润分配,符合法律法规的规定和基金合同的约定。

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20个工作日基金资产净值低于五千万的情形,时间范围为2018-1-1至2018-1-30,存在连续60个工作日基金资产净值低于五千万的情形,时间范围为2018-2-13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规守信情况声明

本报告期内,中国银行银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等相关信息的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分不在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

5.4 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

Balance Sheet table with columns: Asset, Liability, and Total. Includes items like 货币资金, 交易性金融资产, etc.

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.8707元,基金份额总额42,434,838.00份。

6.2 利润表

Income Statement table with columns: Item, Amount. Includes items like 利息收入, 投资收益, 公允价值变动损益, etc.

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末基金资产组合情况

Table showing asset composition by industry: 医药生物, 食品饮料, etc.

7.2.2 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

Table showing domestic stock investment by industry: 医药生物, 食品饮料, etc.

7.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

Table listing top 5 stocks by market cap: 300008, 300069, etc.

7.2.4 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

Table listing top 5 bonds by market cap: 100008, 100009, etc.

7.2.5 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资产支持证券投资明细

Table listing top 5 asset-backed investments.

单位:人民币元

Table showing asset composition by industry: 农林牧渔, 医药生物, etc.

注:本基金合同生效日为2017年7月14日,无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实创业板交易型开放式指数证券投资基金

报告期间:2018年1月1日至2018年6月30日

Table showing changes in equity: 所有者权益合计, 本期期初余额, etc.

注:本基金合同生效日为2017年7月14日,无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.4 本报告期与上年度可比期间的关联方交易

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

Table showing management fees: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日.

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

Table showing custody fees: 项目, 2018年1月1日至2018年6月30日.

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

Table showing interest income: 关联方名称, 2018年1月1日至2018年6月30日.

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.4.7 本报告期与关联方共同发行证券、存放同业、委托贷款等关联交易发生的情况

6.4.5 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.5.3 银行间市场债券正回购

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.3 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.4 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.5 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.6 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.7 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.8 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.9 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.10 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.11 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.12 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.13 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.14 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.15 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.16 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.17 交易所市场债券正回购

6.4.5.3.18 交易所市场债券正回购

2018年半年度报告摘要

金额单位:人民币元

Table showing asset composition by industry: 农林牧渔, 医药生物, etc.

注:上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金持有人的从业人员持有本基金的情况

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

8.5 基金资产净值变动

8.6 基金资产净值变动

8.7 基金资产净值变动

8.8 基金资产净值变动

8.9 基金资产净值变动

8.10 基金资产净值变动

8.11 基金资产净值变动

8.12 基金资产净值变动

8.13 基金资产净值变动

8.14 基金资产净值变动

8.15 基金资产净值变动

8.16 基金资产净值变动

8.17 基金资产净值变动

8.18 基金资产净值变动

8.19 基金资产净值变动

8.20 基金资产净值变动

8.21 基金资产净值变动

8.22 基金资产净值变动

8.23 基金资产净值变动

8.24 基金资产净值变动

8.25 基金资产净值变动

8.26 基金资产净值变动

8.27 基金资产净值变动

8.28 基金资产净值变动

8.29 基金资产净值变动

8.30 基金资产净值变动

8.31 基金资产净值变动

8.32 基金资产净值变动

8.33 基金资产净值变动

8.34 基金资产净值变动

8.35 基金资产净值变动

8.36 基金资产净值变动

8.37 基金资产净值变动

8.38 基金资产净值变动

8.39 基金资产净值变动

8.40 基金资产净值变动

8.41 基金资产净值变动

8.42 基金资产净值变动

8.43 基金资产净值变动

8.44 基金资产净值变动

8.45 基金资产净值变动

8.46 基金资产净值变动

8.4