

嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2018年年度报告摘要

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：2019年03月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2019年3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、投资组合情况等内容，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。

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及其更新。

本报告自2018年1月1日起至2018年12月31日止。
本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金
基金简称	嘉实中创400ETF联接
基金代码	070303
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年07月23日
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
报告期末基金份额总额	104,106,824.97份
报告期末基金份额净值	1.00
基金合同存续期	不定期
下属分级基金的基本简称	嘉实中创400ETF联接A 嘉实中创400ETF联接C
下属分级基金的代码	070303A 000727
下属分级基金的交易状态	正常
报告期末7个工作日内基金平均净值增长率	98.349,310.46% 5.481,106.42%

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	中创400交易型开放式指数证券投资基金
基金代码	070301
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012-09-22
基金合同存续期	不定期
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
报告期末基金份额总额	104,106,824.97份
报告期末基金份额净值	1.00
基金合同存续期	不定期
基金合同生效日	2012-09-22
基金合同存续期	不定期
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

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，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%，年跟踪误差不超过0.5%。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要投资于目标ETF实现对标的跟踪，力求跟踪标的指数的表现，并根据标的指数的表现进行资产配置，力求实现与标的指数的表现相一致。
业绩比较基准	中创400指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为被动式指数基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围与中创400ETF联接基金一致，具有与标的指数及标的指数所代表的股票组合相似的收益风险特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，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%，年跟踪误差不超过0.5%。
投资策略	本基金为被动式指数基金，主要投资于目标ETF实现对标的跟踪，力求跟踪标的指数的表现，并根据标的指数的表现进行资产配置，力求实现与标的指数的表现相一致。
业绩比较基准	中创400指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金为被动式指数基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围与中创400ETF联接基金一致，具有与标的指数及标的指数所代表的股票组合相似的收益风险特征。

2.3 基金管理人及基金托管人

名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	刘明	姜建清
注册地址	北京市朝阳区建国门外大街29号20层2008A室	北京市西城区复兴门内大街26号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街29号20层2008A室	北京市西城区复兴门内大街26号
客服电话	400-678-8888	95588
网址	www.jsfund.cn	www.icbc.com.cn

2.4 信息披露方式

基金年度报告全文的披露网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市西城区复兴门内大街26号中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

	本报告期末2018年12月31日	本报告期末2018年12月31日	本报告期末2018年12月31日	本报告期末2018年12月31日	本报告期末2018年12月31日
1. 本期已实现收益	-7,418,399.09	-139,320.08	-12,619,116.30	-6,777,804.81	-
2. 本期基金份额净值增长率	-47.10%	-1.01%	-12.61%	-6.78%	-
3. 本期基金份额净值增长率标准差	-0.0071	-0.0131	-0.0080	-0.0096	-
4. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
5. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
6. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
7. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
8. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
9. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
10. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
11. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
12. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
13. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
14. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
15. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
16. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
17. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
18. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
19. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-
20. 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准的偏离度标准差的平方与本期基金份额净值增长率的平方之比	-0.0034%	-0.0127%	-0.0177%	-0.0167%	-

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）扣除相关费用后的净额，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）所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）2018年3月2日本基金管理人发布《关于嘉实中创400交易型开放式指数证券投资基金联接基金增设C类基金份额并修改基金合同、托管协议的公告》，自2018年3月6日起，对本基金增设C类基金份额，并对本基金的基金合同托管协议及相关法律法规文件做出相应修改；（4）嘉实中创400ETF联接A取认购（申购）费和赎回费，嘉实中创400ETF联接C收取认购（申购）费和赎回费，赎回费计入销售服务费；（5）期末可供分配利润采用期末资产净值减去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

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	-11.86%	1.76%	-11.08%	1.79%	0.14%	-0.01%
过去六个月	-21.07%	1.64%	-22.14%	1.54%	0.31%	0.00%
过去一年	-52.04%	1.48%	-50.07%	1.48%	0.12%	0.00%
过去三年	-53.03%	1.51%	-50.06%	1.52%	-0.76%	-0.01%
过去五年	-13.06%	1.36%	1.39%	1.79%	-14.44%	-0.03%
自基金合同生效至今	9.71%	1.67%	22.74%	1.71%	-13.03%	-0.04%

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的比较

阶段	份额净值增长率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④
过去三个月	-11.86%	1.76%	-11.08%	1.79%
过去六个月	-21.07%	1.64%	-22.14%	1.54%
过去一年	-52.04%	1.48%	-50.07%	1.48%
过去三年	-53.03%	1.51%	-50.06%	1.52%
过去五年	-13.06%	1.36%	1.39%	1.79%
自基金合同生效至今	-23.14%	1.50%	-30.27%	1.51%

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)

其中t=1,2,3,...

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的比较

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的比较

注：本基金业绩比较基准为：中创400指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

自中创400指数挑选在深圳证券交易所的中小企业板及创业板股票中，依据其前6个月的平均流通市值的排名和平均成交金额的比按2:1的权重加权平均，然后将计算结果从高到低排序选取排名位于101-500名的股票。

本基金的业绩基准按照按机构排名方式每日进行计算，计算公式如下：

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%×中创400指数收益率(t)+5%×银行活期存款税后利率

Benchmark(t)=(1+Return(t))×Benchmark(t-1)