

## 嘉实农业产业股票型证券投资基金 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:中国建设银行股份有限公司  
送出日期:2019年03月26日

## § 1 重要提示

基金管理人、基金托管人及基金销售机构应当勤勉尽责，按照规定披露基金信息，不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

基金托管人中国建设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。

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。

本报告期自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

业股票型证券投资

## 基金简称

基金主代码	003634
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月7日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	161,447,374.29份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于沪深两市具有长期稳定成长性的上市公司，在有效控制风险的前提下追求超越业绩比较基准的增值收益。
投资策略	本基金参与及跟踪城市环境变化情况，跟踪宏观经济与政策走势，把握环境投资机会，进行市场择时反应。本基金在资产配置中将环境主题的列入和调出，并调整其在投资组合中的权重。本基金在行业配置和个股选择上，重点投资于各行业的环保及绿色上市公司。本基金在个股选择上主要投资于环境类上市公司中与具有良好成长性、高研发投入、技术创新能力强的上市公司。本基金在个股选择上，重点投资于沪深两市上下游加工、相关行业各个环节提供技术支持的上市公司，并建设环境主题基金。同时符合各个环境环节中受益明显、发展前景广阔、估值合理的上市公司，并跟踪环境政策的变化，优化基金的投资组合。
业绩比较基准	甲方年化收益扣除管理费后+ 80%+ 中证环保指数收益率× 20%
风险收益特征	本基金为积极型主动管理基金，属于长期预期风险和预期收益较高的基金品种。其预期风险和预期收益高于混合型中低基金，低于股票型基金和上市开放式基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名 胡勇斌 联系电话 (010)65215588 电子邮箱 service@jfund.cn	田青 (010)67595096 tianqing123@ccb.com
客户服务电话	400-600-8800	(010)67595096
传真	(010)65215588	(010)66275853

## 2.4 信息披露方式

登載基金年度報告正文的管理人互聯網網址	<a href="http://www.jcfund.cn">http://www.jcfund.cn</a>
---------------------	---

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2017 年度数据	金额单位：人民币元		
	2018 年	2017 年	2016 年 12 月 7 日（基金合同生效日）-2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	76,369.28	67,660,080.68	-242,363.67
本期公允价值变动收益	-51,709,034.64	109,669,894.00	-10,218,602.72
加权平均基金份额净值增长率	-0.2894	1.3118	-0.0080
本期加权平均净值增长率	-28.92%	13.14%	-0.87%
本期基金份额净值增长率	-26.05%	17.54%	-0.93%
3.1.2 期末数据	金额单位：人民币元		
	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	-23,082,988.39	43,879,709.91	-10,218,602.72
期末可供分配基金份额总额	-0.1430	0.1660	-0.0080
期末基金资产净值	138,364,989.00	308,191,901.92	1,368,689,666.62
期末基金份额净值	0.8570	1.1660	0.9520
3.1.3 累计会计数据指标	金额单位：人民币元		
	2018 年末	2017 年末	2016 年末
基金累计净值增长率	-14.30%	16.60%	-0.87%

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的未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低值。

### 3.2 基金净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	-8.77%	15.33%	0.73%	1.18%	-9.50%	0.36%
过去六个月	-11.84%	1.26%	-3.50%	1.06%	-8.25%	0.29%
过去一年	-26.50%	1.53%	-16.60%	1.02%	-9.90%	0.31%
自基金合同生效起至今	-14.30%	1.11%	-25.35%	0.89%	11.05%	0.22%

注:本基金业绩比较基准为:申万农林牧渔指数收益率×80%+中债总指数收益率×20%

申万农林牧渔指数反映沪深A股中农业产业公司股票的整体表现,对农业产业股票具有广泛的代表性,适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。固定收益部分的业绩比较基准则采用能够较好的反映债券市场整体状况情况中的国债指数收益率。基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用上述业绩比较基准能够较好的反映本基金的风险收益特征。中国债券总财富指数是债券全口径计算的指数值,考虑了息票日和再投资因素,在样本券付息日和再投资计入指数之日中,中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势,是债券组合投资管理业绩评价的有效工具。

本基金的业绩比较基准按照公式每日交易后进行计算,计算方式如下:

$$Benchmark(t) = 1000$$

$$\text{Return}(t) = 80\% \times \text{申万农林牧渔指数}(t) / \text{申万农林牧渔指数}(t-1) + 20\% \times (\text{中国债券总指数}(t) / \text{中国债券总指数}(t-1) - 1)$$

$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times \text{Benchmark}(t-1)$$

其中  $t=1, 2, \dots$

### 3.2.2 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

