嘉实中短债债券型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月24日(基金合同生效日)起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中短债债券
基金主代码	006797
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年1月24日
报告期末基金份额总额	634,083,856.77份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下,重点投资中短债主题证券,力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下,通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理,挖掘价值被低估的标的券种,力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	中债总财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金,风险与收益高于货币市场基金,低于股票型基金、混合型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	嘉实中短债债券A 嘉实中短债债券C
下属分级基金的交易代码	006797 006798
报告期末下属分级基金的份额总额	410,955,621.53份 223,128,235.24份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月24日-2019年3月31日)	报告期(2019年1月24日-2019年3月31日)
	嘉实中短债债券A	嘉实中短债债券C
1.本期已实现收益	1,262,973.43	544,325.94
2.本期利润	966,307.40	383,160.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0017
4.期末基金资产净值	411,921,928.93	223,511,395.81
5.期末基金份额净值	1.0024	1.0017

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)嘉实中短债债券A收取认(申)购费用和赎回费,嘉实中短债债券C从本类基金资产中计提销售服务费,不收取认(申)购费用但收取赎回费;(3)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。(4)本基金合同生效日为2019年1月24日,本报告期自2019年1月24日起至2019年3月31日止。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

嘉实中短债债券A

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
过去三个月	0.24%	0.03%	0.50%	0.02%	-0.26%	0.01%

嘉实中短债债券C

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
过去三个月	0.17%	0.03%	0.50%	0.02%	-0.33%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

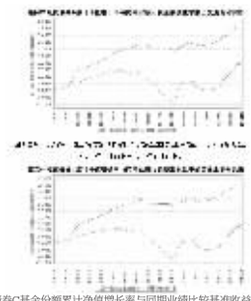

图2:嘉实中短债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年1月24日至2019年3月31日)

注:1.本基金基金合同生效日2019年1月24日至报告期末未满1年。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6个月为建仓期,本报告期处于建仓期内。

2.2019年1月25日,本基金管理人发布《关于新增嘉实中短债债券基金经理的公告》,增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务,与基金经理万晓西先生、李曦先生共同管理本基金。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券基金经理	2019年1月25日	-	9年	曾任Futex Trading Ltd期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司,曾任债券交易员,现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士研究生,CFA,具有基金从业资格。
李曦	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实快钱货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币基金经理	2019年1月24日	-	9年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014年12月加入嘉实基金管理有限公司,现任职于固定收益业务体系短端alpha策略组。硕士研究生,具有基金从业资格。
万晓西	本基金、嘉实货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券基金经理	2019年1月24日	-	18年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部,南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理,第一创业证券资产管理总部固定收益总监,执行总经理,民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理,2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任固定收益业务体系短端alpha策略组组长,中国国籍。

注:(1)基金经理万晓西、李曦的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理李金灿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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中短债债券型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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,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制度和流程独立决策,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1次,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 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为0.02%,年化跟踪误差为0.38%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过0.2%的限制。

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,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。

4.5 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0.8541元;本报告期基金份额净值增长率为32.34%,业绩比较基准收益率为33.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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元的情形,时间范围为2019-01-01日至2019-03-31;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形。

§5 投资组合报告

5.1 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	19,089,219.89	97.17
	其中:股票	19,089,219.89	97.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,200.00	0.07
	其中:债券	14,200.00	0.07
	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	-	-
	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	540,600.57	2.75
8	其他资产	338.70	-
9	合计	19,644,359.16	100.00

注:股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	176,206.60	0.90
C	制造业	9,257,043.24	47.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	131,023.00	0.67
E	建筑业	2,357,109.50	12.09
F	批发和零售业	166,475.00	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	23,322.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,393,660.28	27.67
J	金融业	42,695.10	0.22
K	房地产业	39,216.80	0.20
L	租赁和商务服务业	400,470.20	2.05
M	科学研究和技术服务业	237,392.92	1.22
N	水利、环境和公共设施管理业	372,751.00	1.91
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	491,854.25	2.52
S	综合	-	-
	合计	19,089,219.89	97.93

§5 投资组合报告

5.1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	845,410,000.00	97.97
	其中:债券	845,410,000.00	97.97
	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	-	-
	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	4,956,905.07	0.57
8	其他资产	12,579,477.68	1.46
9	合计	862,946,382.75	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

5.3 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

报告期末,本基金未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	80,004,000.00	12.59
	其中:政策性金融债	80,004,000.00	12.59
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	411,161,000.00	64.71
6	中期票据	295,997,000.00	46.58
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	58,248,000.00	9.17
9	其他	-	-
10	合计	845,410,000.00	133.04

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011802013	18鲁高速股SCP001	500,000	50,270,000.00	7.91
2	011900578	19中信股SCP002	500,000	50,055,000.00	7.88
3	101800426	18宁波轨交MTN001	400,000	40,972,000.00	6.45
4	101474004	14沪城控MTN001	400,000	40,552,000.00	6.38
5	011804140	18首发SCP001	400,000	40,192,000.00	6.33

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本期国债期货操作主要通过国开债与国债期货配合交易,另外在市场波动的情形下,通过国债期货的套保把握了波段机会。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
T1906	T1906	-8	-7,831,600.00	11,500.00	-
公允价值变动总额合计(元)					11,500.00
国债期货投资本期收益(元)					-15,800.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					11,500.00

5.10.3 本期国债期货投资评价

整体操作上相对谨慎,对组合的收益以及波动性方面都有明显的提升作用,后期仍将努力把握确定性较大的机会,合理分配各个策略之间的仓位占比,力争提升组合收益的同时,将回撤保持在可控范围内。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	156,632.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,422,845.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,579,477.68

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实中短债债券A	嘉实中短债债券C
基金合同生效日(2019年1月24日)持有的基金份额	410,955,621.53	223,128,235.24
报告期期间基金总申购份额	-	-
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	410,955,621.53	223,128,235.24

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1)中国证监会准予嘉实中短债债券型证券投资基金注册的批复文件。

(2)《嘉实中短债债券型证券投资基金基金合同》;

(3)《嘉实中短债债券型证券投资基金托管协议》;

(4)《嘉实中短债债券型证券投资基金招募说明书》;

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6)报告期内嘉实中短债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金管理人网址:http://www.jsfund.cn

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2019年4月20日

嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年4月20日

§1 重要提示

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。

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4月17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。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中关村A股ETF
场内简称	中关村A
基金主代码	159951
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年6月7日
报告期末基金份额总额	22,822,910.00份
投资目标	本基金进行被动式指数化投资,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差不超过3%。
投资策略	本基金采取完全复制法,固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。
业绩比较基准	中关村A股指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型证券投资基金,预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-516,476.06
2.本期利润	4,785,475.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.2038
4.期末基金资产净值	19,492,174.71
5.期末基金份额净值	0.8541

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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
过去三个月	32.34%	1.85%	33.25%	1.85%	-0.91%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

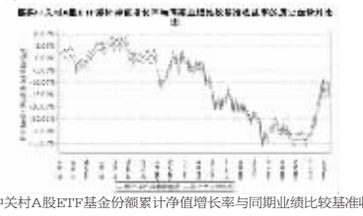

图:嘉实中关村A股ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率

的历史走势对比图
(2017年6月7日至2019年3月31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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘翊吟	本基金、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实深证基本面120ETF、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实中证金融地产ETF联接A、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)基金经理	2017年6月7日	-	9年	2009年加入嘉实基金管理有限公司,曾任指数投资部指数研究员一职。现任指数投资部基金经理。
陈正宪	本基金、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实沪深300ETF、嘉实中证500ETF、嘉实中证500ETF联接、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实创业板ETF、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)基金经理	2017年6月7日	-	14年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008年6月加入嘉实基金管理有限公司,先后任职于产品管理部、指数投资部、现任指数投资部执行总监及基金经理。硕士研究生,具有基金从业资格,中国台湾籍。

注:(1)基金经理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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券法》、《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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内,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制度和流程独立决策,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1次,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 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年一季度宏观经济平稳开局,资本市场的风险偏好出现了显著回升,上证综指涨幅超过20%,二月份创业板的涨幅更是创下了历史记录。宏观角度而言,数据上尚未体现生产端和需求端的明显改善,但消费投资增速已经出现逐步趋稳的状态。企业利润的底部大概率还无法在2019年前半年见到,但伴随着货币政策转向稳健中性和减税降费等积极财政政策继续发力,基建投资加码的程度也有所抬升,市场对企业利润的预期有比较明显的边际提升,这也一定程度上体现在权益资产的定价上。与此同时,一季度内中美关系出现阶段性缓和的可能性提升,也使得对去年市场信心产生负面影响的另一大要素均出现了改善。整体来看,当前M2与社融的增速与名义GDP增速仍有一定距离,稳增长的经济目标下货币政策仍需持续发力对冲,而政策对经济基本面的任何边际利好都将通过市场走强表现出来,

在A股内部的结构上,各版块呈现普涨态势。在投资热情见涨、成交活跃的市场环境下,投资者对资产弹性的重视程度显著大于盈利和估值,使得成长风格的跑赢了价值风格,中小板、创业板的涨幅显著高于大盘蓝筹板块。市场热点方面,受到盈利预期好转影响,农业、计算机、非银金融等行业,和养老产业、白酒和金融科技等主题出现了较大的涨幅。

报告期内,本组合严格遵守基金合同的约定,基于量化模型,构建对股票Alpha的测度,并通过行业、风格、风险等维度的控制,进行组合优化。同时,组合根据国家政策、宏观经济周期以及对市场风格、境外资金、机构投资者的监控,积极布局市场发展方向。组合后续将坚持主动股票型的高仓位运作,坚持整体稳健的投资风格,逐步优选具有未来发展潜力的高成长企业,以及当前财报持续稳健向好的确定性优质成长企业,我们将在量化投资的框架内对模型进行相应调整和优化,进一步控制风险和波动,希望取得更好的投资效果,回馈投资者。

4.5 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0.945元;本报告期基金份额净值增长率为33.10%,业绩比较基准收益率为30.95%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	104,719,291.45	90.66
	其中:股票	104,719,291.45	90.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,226,000.00	4.52
	其中:债券	5,226,000.00	4.52
	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	-	-
	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	4,706,221.71	4.07
8	其他资产	850,951.50	0.74
9	合计	115,502,464.66	100.00

5.2 报告期末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	3,823,678.70	3.35
B	采矿业	1,851,754.00	1.62
C	制造业	59,718,382.19	52.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,399,029.00	2.10
E	建筑业	2,968,382.00	2.60
F	批发和零售业	7,175,363.50	6.29
G	交通运输、仓储和邮政业	978,035.00	0.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,199,451.36	8.94
J	金融业	2,215,100.00	1.94
K	房地产业	3,153,130.70	2.77
L	租赁和商务服务业	1,782,487.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	1,819,625.00	1.60
N	水利、环境和公共设施管理业	4,442,053.00	3.90
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,632.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	1,554,086.00	1.36
S	综合	637,102.00	0.56
	合计	104,719,291.45	91.84

5.3 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

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	000034	神州数码	102,100	1,610,117.00	1.41
2	600845	宝信软件	48,900	1,605,876.00	1.41
3	601369	陕鼓动力	235,200	1,571,136.00	1.38
4	002115	三维通信	126,800	1,564,712.00	1.37
5	002168	惠程科技	135,200	1,561,560.00	1.37
6	002697	红旗连锁	272,700	1,559,844.00	1.37
7	300388	国祯环保	147,200	1,545,600.00	1.36
8	002611	东方精工	374,400	1,542,528.00	1.35
9	002738	中矿资源	82,400	1,491,440.00	1.31
10	002376	新北洋	84,200	1,486,130.00	1.30

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	5,226,000.00	4.58
	其中:政策性金融债	5,226,000.00	4.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,226,000.00	4.58

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	108603	国开1804	52,000	5,226,000.00	4.58

注:报告期末,本基金仅持有上述1支债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					23,689.32
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃、超额收益显著的股指期货合约进行投资。 本基金投资于股指期货,对基金总体风险的影响很小,并符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	220.68
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	118.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	338.70

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	22,822,910.00
报告期期间基金总申购份额	4,500,000.00
减:报告期期间基金总赎回份额	4,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	22,822,910.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内,基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件;

(2)《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》;

(3)《嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;

(4)《嘉实中关村A股交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;

(6) 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公告的各项原稿。

8.2 存放地点

(1)北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

(2)北京市西城区阜市口大街1号院1号楼中国建设银行投资托管业务部

8.3 查阅方式

(1)书面查询:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件。

(2)网站查询:基金