

嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

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08月29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。本半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8月23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,应阅读年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中小企业量化活力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	嘉实中小企业量化活力灵活配置混合
基金代码	000430
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月4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
报告期末基金资产总额	117,000,707,006
基金合同的期限	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用量化、主动化的投资策略,从中小企业经营、发展和创新的内在动力出发,通过深入的行业分析、风险分析和行业配置,精选质地优良、估值合理的中小企业股票,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金主要通过量化、主动化的投资策略,精选质地优良、估值合理的中小企业股票,在严格控制风险的前提下,追求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证1000指数*95%+银行存款利率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金,风险收益介于股票型基金和货币市场基金之间,属于较高风险、较高收益的基金品种。

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
法定代表人	胡明晓	田卉
信息披露负责人	胡明晓	010906216608
客户服务电话	service@jrfund.com	13191816000
传真	010906216608	010906275683

2.4 信息披露方式

基金年度报告和半年度报告的管理人互联网网址	http://www.jrfund.com
基金管理人年度报告和半年度报告的托管人互联网网址	北京中建行[2018]8号函嘉实基金管理有限公司

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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日至2019年06月30日)
本期实现收益	15,310,469.08
本期利润	22,040,522.08
加权平均基金份额本期利润	0.1936
本期加权平均净值利润率	21.37%
本期基金份额净值	26.77%

3.1.2 期末未分配利润	报告期(2019年06月30日)
期初未分配利润	-14,287,917.00
本期未分配利润	-1,0221
期末未分配利润	104,666,774.00

3.1.3 累计未分配利润	报告期(2019年06月30日)
期初未分配利润	-10.70%

注: (1) 本期已实现收益指本基金本期利息收入、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将低于所列数字; (3) 本期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之和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(单位:份)	申购(赎回)时点数	赎回(申购)时点数	申购(赎回)时点数	申购(赎回)时点数	申购(赎回)时点数
过去一个月	2.20%	1,040.00	1,040.00	2.40%	-0.08%	
过去二个月	-5.60%	1,025.00	942.00	1.00%	2.00%	-0.12%
过去六个月	25.77%	1,080.00	1,061.00	1.79%	7.86%	-0.11%
过去一年	32.44%	1,154.00	1,078.00	1.18%	3.11%	-0.01%
自基金合同生效以来	1.32%	1,113.00	1,029.00	1.29%	0.00%	0.00%

注:本基金业绩比较基准为:中证1000指数*95%+中证综合债券指数*5%

中证1000指数是由中证指数有限公司编制,其成分股是选择中证800指数样本之外规模偏小且流动性好的1000只股票组成,与沪深300和中证500等指数形成互补。中证1000指数成分股的平均市值与市值中位数较小,行业分布广,行业集中度低,更能综合反映沪深证券市场中小市值公司的整体状况。而中证综合债券指数是综合反映银行间和交易所市场货币、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数,能够反映债券市场总体走势。

本基金的业绩基准指按照构建公式每交易日进行计算,计算方式如下:

Benchmark(0)=1000

Return(t)=95%*(中证1000指数(t)/中证1000指数(t-1)+1)*5%*(中证综合债券指数(t)/中证综合债券指数(t-1))

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

3.3 主要财务指标和基金净值表现

3.3.1 期间数据和指标

金额单位:人民币元

3.3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日至2019年06月30日)
本期实现收益	15,310,469.08
本期利润	22,040,522.08
加权平均基金份额本期利润	0.1936
本期加权平均净值利润率	21.37%
本期基金份额净值	26.77%

3.3.1.2 期末未分配利润	报告期(2019年06月30日)
期初未分配利润	-14,287,917.00
本期未分配利润	-1,0221
期末未分配利润	104,666,774.00

3.3.1.3 累计未分配利润	报告期(2019年06月30日)
期初未分配利润	-10.70%

注: (1) 本期已实现收益指本基金本期利息收入、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将低于所列数字; (3) 本期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之和已实现部分的孰低数。

3.3.2 基金净值表现

3.3.2.1 期间数据和指标

金额单位:人民币元

3.3.2.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日至2019年06月30日)
本期实现收益	15,310,469.08
本期利润	22,040,522.08
加权平均基金份额本期利润	0.1936
本期加权平均净值利润率	21.37%
本期基金份额净值	26.77%

3.3.2.2 期末未分配利润	报告期(2019年06月30日)
期初未分配利润	-14,287,917.00
本期未分配利润	-1,0221
期末未分配利润	104,666,774.00

3.3.2.3 累计未分配利润	报告期(2019年06月30日)
期初未分配利润	-10.70%

注: (1) 本期已实现收益指本基金本期利息收入、投资收益、其他收入(