

嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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
重要提示:
嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证监会核准注册,于2019年8月29日公开发售。

Table with 5 columns: 项目, 附注号, 本期, 上期, 上年度可比期间. Rows include 一、收入, 二、费用, 三、净利润, 四、其他综合收益, 五、综合收益总额, 六、每股收益, 七、其他综合收益, 八、综合收益总额.

2.1 基金基本情况
基金名称: 嘉实中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金代码: 159922
基金运作方式: 交易型开放式
基金合同生效日: 2019年11月13日

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

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, 力争正市场溢价下, 本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%, 年化跟踪误差率不超过0.5%。

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

2.3 基金管理人及基金托管人
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

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.1 主要会计数据和财务指标
3.1.1 期间数据和指标
3.1.2 期末数据和指标
3.1.3 主要会计数据和财务指标

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

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
3.2.2 基金业绩比较基准

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.3 基金投资组合报告
3.3.1 基金资产配置情况
3.3.2 基金行业配置情况
3.3.3 基金重仓股票

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.4 基金管理人及基金托管人
3.4.1 基金管理人
3.4.2 基金托管人

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.5 基金业绩比较基准
3.5.1 基金业绩比较基准
3.5.2 基金业绩比较基准的说明

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.6 基金投资策略
3.6.1 基金投资策略
3.6.2 基金投资策略的说明

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.7 基金风险管理
3.7.1 基金风险管理
3.7.2 基金风险管理的说明

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.8 基金信息披露
3.8.1 基金信息披露
3.8.2 基金信息披露的说明

Table with 5 columns: 项目, 2019年1月1日至2019年6月30日, 2018年1月1日至2018年6月30日, 2017年1月1日至2017年6月30日. Rows include 一、期初所有者权益合计, 二、本期新增, 三、本期减少, 四、期末所有者权益合计.

3.9 基金其他重要事项
3.9.1 基金其他重要事项
3.9.2 基金其他重要事项的说明

6.4.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
6.4.3 期末持有的公允价值计量且公允价值变动计入其他综合收益的金融资产
6.4.3.1 银行理财产品公允价值
6.4.3.2 其他理财产品公允价值

Table with 5 columns: 项目, 金额, 占基金资产净值比例. Rows include 1 权益投资, 2 基金投资, 3 固定收益投资, 4 贵金属投资, 5 金融衍生品投资, 6 买入返售金融资产.

Table with 5 columns: 代码, 行业类别, 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include A 农林牧渔, B 采矿业, C 制造业, D 电力、热力、燃气及生产和供应业, E 建筑业, F 批发和零售业, G 交通运输、仓储和邮政业, H 住宿和餐饮业, I 信息传输、软件和信息技术服务业, J 金融业, K 房地产业, L 租赁和商务服务业, M 科学研究和技术服务业, N 水利、环境和公共设施管理业, O 房地产业, P 教育, Q 卫生和社会工作, R 文化、体育和娱乐业, S 综合.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值, 占基金资产净值比例. Rows include 1 000988 顺鑫农业, 2 000972 中远海发, 3 600201 生物股份, 4 600872 中航复星, 5 002157 正邦科技, 6 002948 西南药业, 7 300263 卫宁健康, 8 000066 中国长城, 9 600031 生益股份, 10 002195 三孚五环.

7.1.3.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
7.1.3.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

Table with 5 columns: 份额类别, 持有人户数(户), 户均持有份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 本公司高级管理人员、基金托管人和运营管理部门负责人持有本基金, 本基金基金经理持有本基金.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

Table with 5 columns: 项目, 份额类别, 持有基金份额总额(万份), 占基金资产净值比例. Rows include 嘉实中证500ETF联接A, 嘉实中证500ETF联接C.

图2: 嘉实中证500ETF联接A基金份额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

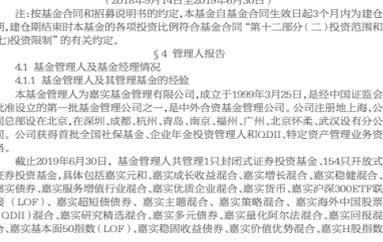


图3: 嘉实中证500ETF联接A基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

