

# 嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金 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。



## 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实如意宝定期债券	
基金主代码	000113	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 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	
报告期末基金份额总额	896,001,991.94 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
下属分级基金的交易代码	000113	000115
报告期末下属分级基金的份 额总额	871,969,279.96 份	24,032,711.98 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金谋求本金稳妥和稳定收益，在此基础上力争较高回报。
投资策略	本基金运用“嘉实下行风险波动模型”控制组合较低波动幅度。在此基础上，本基金将深刻的基本面研究、严谨的债券分析与主动的投资风格相结合，通过“自上而下”的宏观研究与“自下而上”的微观分析，挖掘风险收益优化、满足组合收益和流动性要求的投资机会，确定和调整基金资产在非信用类固定收益类证券（国债、央行票据、政策性金融债等）和信用类固定收益类证券之间的配置比例，力争持续稳定的收益，并择机少量投资可转债，谋求增强收益。
业绩比较基准	一年期定期存款税后收益率 + 0.5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

### 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	胡勇钦	田青
	联系电话	(010)65215588	(010)67595096
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tianqingl.zh@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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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

## § 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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年12月31日)		报告期(2017年01月01日-2017年12月31日)		报告期(2016年01月01日-2016年12月31日)	
	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
本期已实现收益	31,402,986.12	840,332.78	16,206,714.59	442,310.32	12,132,423.24	1,442,547.59
本期利润	69,578,576.49	2,091,448.40	14,261,815.53	406,534.26	-13,384,413.62	85,271.94
加权平均基金份额本期利润	0.0795	0.0754	0.0162	0.0125	-0.0313	0.0022
本期加权平均净值利润率	6.90%	6.64%	1.42%	1.10%	-2.66%	0.19%
本期基金份额净值增长率	7.10%	6.73%	1.38%	1.02%	0.26%	-0.17%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末可供分配利润	118,216,378.82	2,963,724.43	99,162,985.58	3,075,274.68	142,457,701.78	5,146,766.67

期末可供分配基金份额利润	0.1356	0.1233	0.1129	0.1010	0.1607	0.1503
期末基金资产净值	991,723,865.14	27,033,372.16	977,319,525.03	33,515,928.08	1,028,666,918.60	39,389,000.70
期末基金份额净值	1.137	1.125	1.113	1.101	1.161	1.150
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基金份额累计净值增长率	36.01%	33.16%	26.99%	24.77%	25.26%	23.51%

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）嘉实如意宝定期债券 A/B 收取认（申）购费和赎回费，嘉实如意宝定期债券 C 从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、对于持有期限不少于 30 日的本类别基金份额的赎回亦不收取赎回费，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费；（3）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；（4）期末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

嘉实如意宝定期债券 A/B

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	1.62%	0.06%	0.51%	0.01%	1.11%	0.05%
过去六个月	3.84%	0.07%	1.01%	0.01%	2.83%	0.06%
过去一年	7.10%	0.07%	2.02%	0.01%	5.08%	0.06%
过去三年	8.86%	0.07%	6.19%	0.01%	2.67%	0.06%
过去五年	34.80%	0.11%	12.86%	0.01%	21.94%	0.10%
自基金合同生效起至今	36.01%	0.11%	15.16%	0.01%	20.85%	0.10%

嘉实如意宝定期债券 C

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	1.65%	0.06%	0.51%	0.01%	1.14%	0.05%
过去六个月	3.62%	0.07%	1.01%	0.01%	2.61%	0.06%
过去一年	6.73%	0.07%	2.02%	0.01%	4.71%	0.06%
过去三年	7.63%	0.07%	6.19%	0.01%	1.44%	0.06%
过去五年	32.24%	0.11%	12.86%	0.01%	19.38%	0.10%
自基金合同 生效起至今	33.16%	0.11%	15.16%	0.01%	18.00%	0.10%

注：本基金业绩比较基准：一年期定期存款税后收益率+0.5%

上述“一年期定期存款税后收益率”是指当期封闭期的第1个工作日中国人民银行发布的一年期“金融机构人民币存款基准利率”。该业绩比较基准能反映本基金绝对回报型债券基金的产品定位，符合本基金的风险收益特征，易于被投资人广泛理解，因而较为适当。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Benchmark}(0) = 1000$$

$$\text{Return}(t) = 100\% \times (\text{一年期定期存款税后收益率} + 0.5\%) / 365$$

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

其中  $t=1, 2, 3, \dots$ 。

### 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

**嘉实如意宝定期债券A/B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**

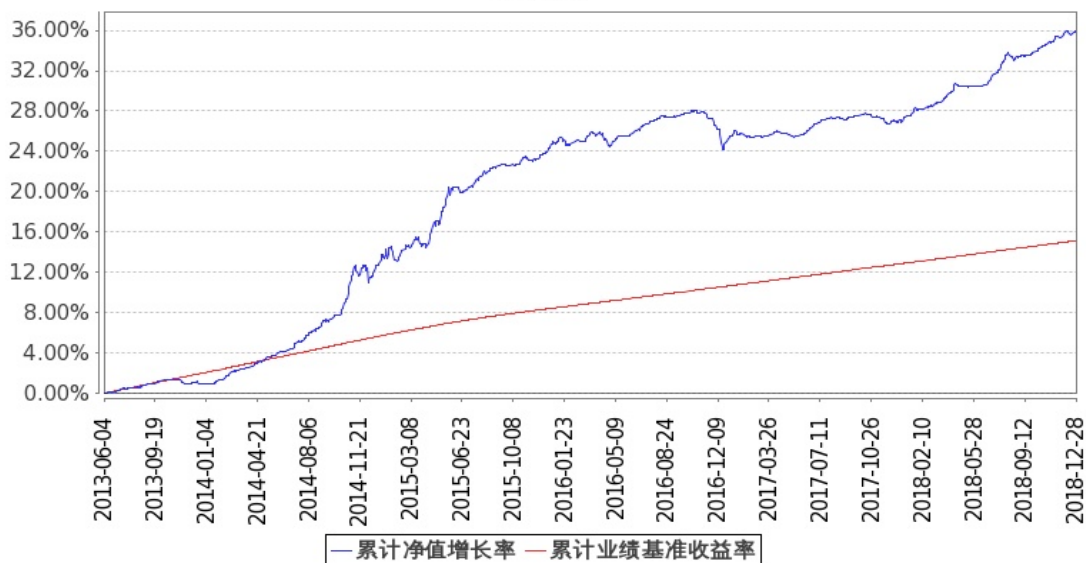


图 1：嘉实如意宝定期债券 A/B 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013 年 6 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日)

**嘉实如意宝定期债券C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**

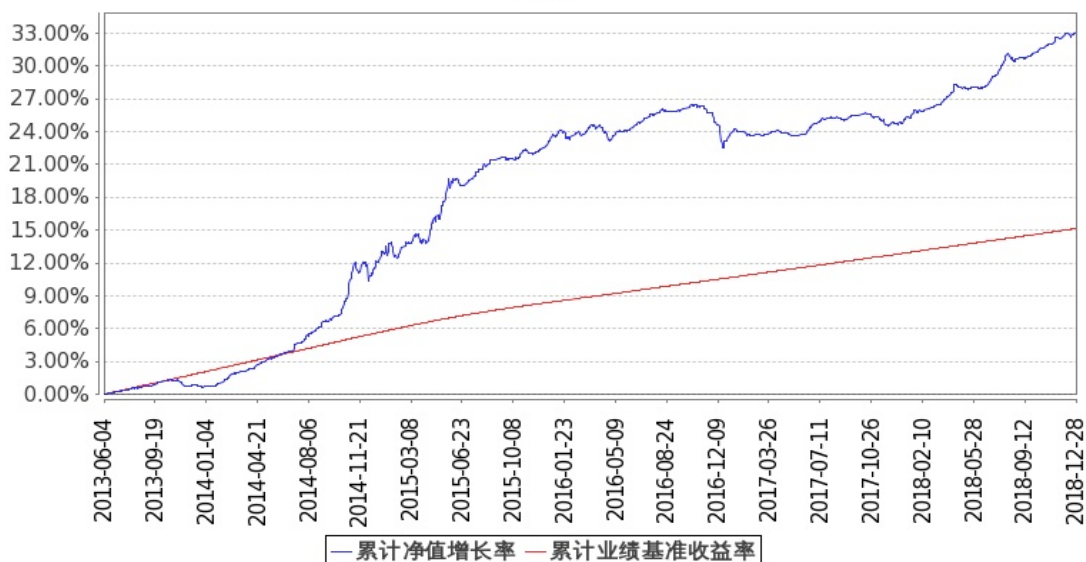


图 2：嘉实如意宝定期债券 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

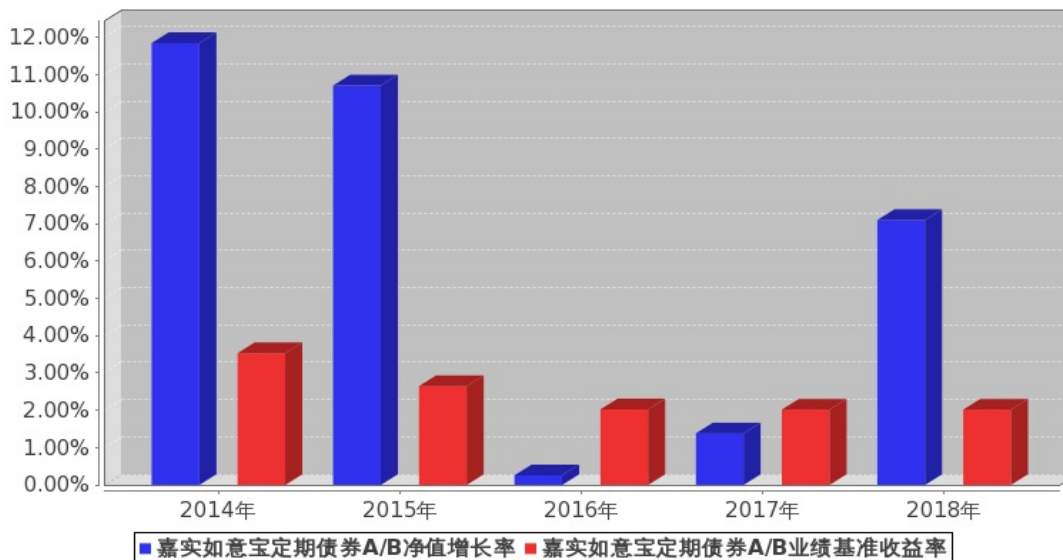
(2013 年 6 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日)

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“第十二部分（二）投资范围和（四）投资限制”的有

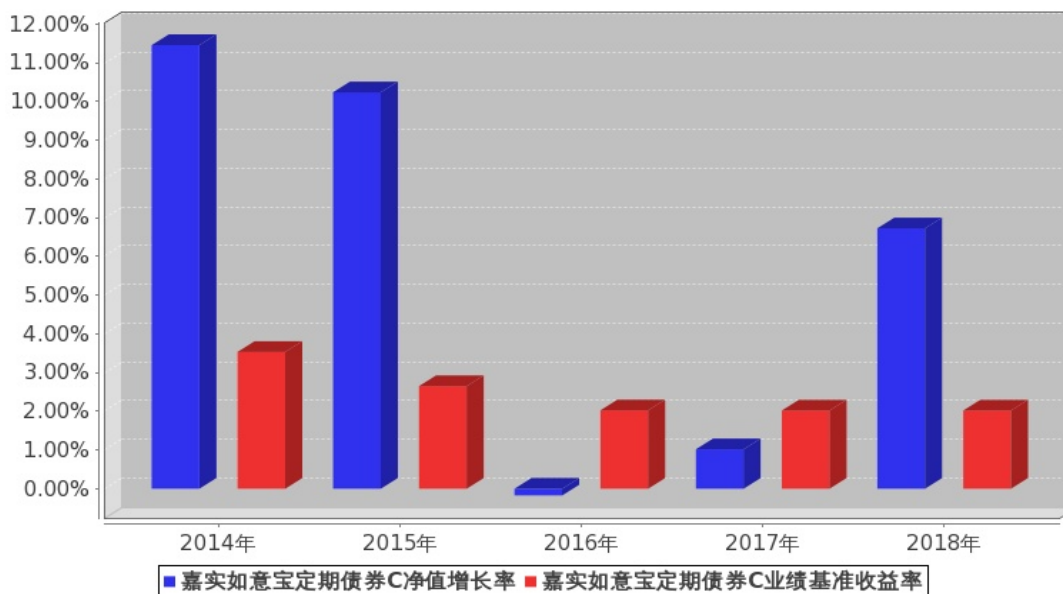
关约定。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实如意宝定期债券A/B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实如意宝定期债券C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：元

嘉实如意宝定期债券 A/B

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.5500	47,742,144.76	206,180.78	47,948,325.54	-
2017 年	0.6390	56,065,938.18	317,581.97	56,383,520.15	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	1.1890	103,808,082.94	523,762.75	104,331,845.69	



嘉实如意宝定期债券 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018 年	0.5000	1,130,174.33	68,416.70	1,198,591.03	-
2017 年	0.6070	1,869,566.12	93,589.23	1,963,155.35	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	1.1070	2,999,740.45	162,005.93	3,161,746.38	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2018 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、144 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实增强收益定期债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、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、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、

嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实主题增强混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实价值增强混合、嘉实新添瑞混合、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实丰益信用定期债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实稳荣债券、嘉实新添瑞混合、嘉实新添华定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉	2013 年 6 月 4 日	-	14 年	经济学硕士，2004 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，在公司多个业务部门工作，2005 年开始从事投资相关工作，曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理。

	实新添丰定期混合、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合、嘉实新添荣定期混合、嘉实战略配售混合、嘉实新添康定期混合、嘉实致盈债券基金经理				
--	--	--	--	--	--

注：（1）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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《嘉实如意宝定期开放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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.3 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 12 次，均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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年是在对外贸易战、对内去杠杆两条主线交叉作用下变化最快的一年，资本市场从年初对权益的追捧、对金融监管对债市的强烈看空转换到经济下行压力大、风险偏好下行明显带来的权益市场深度调整而债市一枝独秀。

年初市场对全球通胀、加息预期走强以及监管加码担忧较强，资金面宽松程度超预期；之后伴随监管政策并未落地、中美贸易战风波、节后复工偏缓和大宗商品下跌、地方政府债务清理等引发基本面预期的进一步下行；二季度国内信用环境不断恶化、信用传导不畅，信用风险上升，内外双重压力下政策层面较上半年有明显转向，8-9 月，在宽信用政策不断出台但收效不佳的情况下，财政政策继续发力，重点在于加快地方债发行、以及推进减税降费等，政策面出现放松；中美贸易摩擦一波三折，对市场影响明显，对经济影响逐步体现，叠加国内基本面下行态势明显，政府稳增长诉求上升，降准、创设 TMLF、推出风险缓释工具等稳定民企预期、维持资金面宽松的相关政策也在不断出台。

债券市场年初延续调整半月有余，随后分别在资金面超预期宽松、信用大幅收缩、贸易战、宏观经济预期差从而政策放松等不同时期的主导因素下收益下行，全年仅在地方债供给冲击、通胀预期阶段性提高、资金面可能的收缩（定向正回购）等情况下出现 20bp 以内的调整。类属上从利率债+高等级信用债为主，拓展到下半年在疏导信用传导机制的情况下信用息差得到一定幅度

的修复的行情主线上，同时资金宽松，全年出现了久期、杠杆、适度信用下沉均获得较好收益的情况，债市录得明显正收益。

权益方面，全年股市在诸多利空因素的影响下波动显著变大，投资者风险偏好下降趋势明显，国内 A 股主要指数均出现了 20% 以上的下跌，下跌幅度和持续性在 A 股历史上也极为罕见。纵观全年，除了经济下行对上市公司业绩造成的负面影响外，风险偏好的急剧下降很大程度上持续压制股票市场的估值，使得市场承受业绩与估值的双重压力。从内部的结构上看，全年市场热点切换较快，市场风格缺少持续的主线，同时黑天鹅事件频发，部分行业受产业政策预期的改变也出现了很大的波动。

报告期内本基金继续本着稳健投资原则，在风险和收益之间进行平衡。中高等级信用债持仓为主获取稳定收益，二季度后通过杠杆拉长信用久期，并积极参与利率债交易，提升组合业绩。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实如意宝定期债券 A/B 基金份额净值为 1.137 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.10%；截至本报告期末嘉实如意宝定期债券 C 基金份额净值为 1.125 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.73%；业绩比较基准收益率为 2.02%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济仍在寻底过程中，下行周期尚未结束。但阶段性来看，政策对于宽信用和稳增长的诉求近期在加大：1) 2019 年地方债将从 1 月开始提前发行，考验市场承接能力，2) 地产新开工加快、基建对冲加大，一定程度上对冲年初出口快速下滑的拖累；3) 社融和 M1 在一季度或边际企稳，对风险偏好起到一定提振作用。总体看，经济下行进入深水区，逆周期调控加码，未来一个阶段宏观环境进入宽货币+宽信用的组合。

债券市场趋势暂不改变，但由于绝对收益较低同时政策托底逐步累积，债市下行空间有限，风险收益比有所下降，同时债市结构发生变化，信用利差有望进一步压缩，曲线阶段性陡峭化，市场波动可能有所加大。中期来看，基本面下行过程中利率中枢仍是震荡下移的过程。居民加杠杆乏力依然是影响趋势所在，也是下行超预期的风险。利率中期内不改变方向。

权益市场方面，随着政策托底手段的逐步到位，之前过于悲观的市场情绪得到一定修复，并改变过去半年市场单边下跌的态势，在未来一段时间内将震荡波动，阶段性的风险偏好改善和流动性回升，对市场情绪起到稳定作用，趋势性的大行情可能较难见到。展望未来，在经济衰退、流动性宽松和外资持续流入的市场环境下，市场风格将更加均衡，主题更为活跃，自下而上的投资机会大概率多于 2018 年，并提供更好的投资标的。

本基金将继续本着稳健投资的原则，以中高等级信用债持仓为主，信用债部分运用息差而不是

久期策略提升收益，通过利率债调节组合久期，中等杠杆水平，保持组合流动性，平衡类属配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2018 年 12 月 7 日发布《嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金 2018 年第一次收益分配公告》，收益分配基准日为 2018 年 11 月 27 日，本期 A 类/B 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.5500 元，本期 C 类份额每 10 份基金份额发放现金红利 0.5000 元。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。本基金的收益分配符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 4.8 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内本基金实施利润分配的金额：嘉实如意宝定期债券 A/B 为 47,948,325.54 元，嘉实如意宝定期债券 C 为 1,198,591.03 元。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金 2018 年度财务会计报告已由普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师许薛竞、张勇签字出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2019)第22731号）。

投资者可通过登载于本基金管理人网站的年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	379,259.78	4,814,987.79
结算备付金		15,978,000.13	17,579,826.06
存出保证金		12,934.03	8,481.10
交易性金融资产	7.4.7.2	1,408,938,414.00	1,201,038,017.24
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-

债券投资		1,408,938,414.00	1,201,038,017.24
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	13,480,020.45
应收利息	7.4.7.5	28,473,639.93	25,116,260.57
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,453,782,247.87	1,262,037,593.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		433,224,281.96	250,199,837.70
应付证券清算款		79,487.20	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		614,518.38	600,783.00
应付托管费		175,576.67	171,652.31
应付销售服务费		9,298.89	11,384.75
应付交易费用	7.4.7.7	19,487.08	21,583.79
应交税费		117,319.54	-
应付利息		395,040.85	-43,101.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	390,000.00	240,000.00
负债合计		435,025,010.57	251,202,140.10
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	896,001,991.94	908,597,192.85
未分配利润	7.4.7.10	122,755,245.36	102,238,260.26
所有者权益合计		1,018,757,237.30	1,010,835,453.11
负债和所有者权益总计		1,453,782,247.87	1,262,037,593.21

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，嘉实如意宝定期债券 A/B 份额净值 1.137 元，基金份额总额 871,969,279.96 份；嘉实如意宝定期债券 C 份额净值 1.125 元，基金份额总额 24,032,711.98 份。基金份额总额合计为 896,001,991.94 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金



本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		92,228,978.98	35,438,032.86
1. 利息收入		57,031,570.95	55,586,863.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	194,702.16	1,336,450.77
债券利息收入		56,787,107.47	53,508,548.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		49,761.32	741,863.89
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,229,385.48	18,168,155.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-4,229,385.48	-18,168,155.45
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	39,426,705.99	-1,980,675.12
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	87.52	-
减：二、费用		20,558,954.09	20,769,683.07
1. 管理人报酬		7,274,424.17	7,304,082.14
2. 托管费		2,078,406.92	2,086,880.71
3. 销售服务费		125,947.47	147,395.20
4. 交易费用	7.4.7.18	54,265.71	25,398.65
5. 利息支出		10,400,525.11	10,900,153.45
其中：卖出回购金融资产支出		10,400,525.11	10,900,153.45
6. 税金及附加		178,824.72	-
7. 其他费用	7.4.7.19	446,559.99	305,772.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		71,670,024.89	14,668,349.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71,670,024.89	14,668,349.79

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实如意宝定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	908,597,192.85	102,238,260.26	1,010,835,453.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71,670,024.89	71,670,024.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-12,595,200.91	-2,006,123.22	-14,601,324.13
其中：1. 基金申购款	391,209.55	56,123.60	447,333.15
2. 基金赎回款	-12,986,410.46	-2,062,246.82	-15,048,657.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-49,146,916.57	-49,146,916.57
五、期末所有者权益（基金净值）	896,001,991.94	122,755,245.36	1,018,757,237.30
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	920,451,450.85	147,604,468.45	1,068,055,919.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,668,349.79	14,668,349.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-11,854,258.00	-1,687,882.48	-13,542,140.48

其中：1. 基金申购款	447,379.23	56,999.06	504,378.29
2. 基金赎回款	-12,301,637.23	-1,744,881.54	-14,046,518.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-58,346,675.50	-58,346,675.50
五、期末所有者权益（基金净值）	908,597,192.85	102,238,260.26	1,010,835,453.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

王红

张公允

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

### 7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
德意志资产管理(亚洲)有限公司	基金管理人的股东

### 7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.4.2 关联方报酬

##### 7.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	7,274,424.17	7,304,082.14
其中：支付销售机构的客户维护费	95,300.52	121,635.86

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.7% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,078,406.92	2,086,880.71

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

##### 7.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	62,521.46	62,521.46
中国建设银行	-	60,362.67	60,362.67
合计	-	122,884.13	122,884.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	68,993.35	68,993.35

中国建设银行	-	72,288.71	72,288.71
合计	-	141,282.06	141,282.06

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额资产净值 × 0.40% / 当年天数。（2）本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费。

#### 7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息收入	交易金额	利息 支出
中国建设银行	-	30,288,213.29	-	-	-	-

注：本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日），基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

##### 7.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2018 年 12 月 31 日）及上年度末（2017 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

#### 7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限 公司_活期	379,259.78	47,018.23	4,814,987.79	41,447.07

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

#### 7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日）及上年度可比期间（2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.5 期末(2018 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(2018 年 12 月 31 日), 本基金未持有因认购 新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2018 年 12 月 31 日), 本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 212,024,281.96 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
101664062	16 中铝业 MTN003	2019 年 1 月 2 日	100.25	200,000	20,050,000.00
101656057	16 厦门航空 MTN003	2019 年 1 月 2 日	99.82	300,000	29,946,000.00
101756020	17 河钢集 MTN006	2019 年 1 月 2 日	103.05	95,000	9,789,750.00
101756023	17 苏轨交 MTN001	2019 年 1 月 2 日	103.03	200,000	20,606,000.00
101669005	16 海淀国资 MTN001	2019 年 1 月 4 日	99.63	300,000	29,889,000.00
101660025	16 滁州城投 MTN001	2019 年 1 月 4 日	100.38	100,000	10,038,000.00
101754013	17 河钢集 MTN001	2019 年 1 月 4 日	101.92	12,000	1,223,040.00
101756040	17 闽能源 MTN001	2019 年 1 月 4 日	102.00	200,000	20,400,000.00
101759002	17 川发展 MTN001	2019 年 1 月 4 日	102.95	100,000	10,295,000.00
101800230	18 汇金 MTN002	2019 年 1 月 4 日	103.39	200,000	20,678,000.00
101800372	18 南电 MTN001	2019 年 1 月 4 日	104.27	200,000	20,854,000.00
101800901	18 光明 MTN002	2019 年 1 月 4 日	100.77	276,000	27,812,520.00
合计				2,183,000	221,581,310.00

### 7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 221,200,000.00 元，于 2019 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	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	1,408,938,414.00	96.92
	其中：债券	1,408,938,414.00	96.92
	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	16,357,259.91	1.13
8	其他各项资产	28,486,573.96	1.96
9	合计	1,453,782,247.87	100.00

### 8.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未持有股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未持有股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日），本基金未持有股票。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	182,194,275.00	17.88
	其中：政策性金融债	110,579,000.00	10.85
4	企业债券	280,444,139.00	27.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	946,300,000.00	92.89
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,408,938,414.00	138.30

## 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	101800542	18 首钢 MTN001	500,000	51,505,000.00	5.06
2	101661019	16 中建材 MTN001	500,000	50,445,000.00	4.95
3	136607	16 宁安 01	500,000	49,735,000.00	4.88
4	127429	G16 京汽 1	500,000	49,495,000.00	4.86
5	101800171	18 华润置地 MTN001	400,000	41,536,000.00	4.08

## 8.7 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。

## 8.8 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贵金属投资明细

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 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。



## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

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。

### 8.12.2

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,934.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,473,639.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,486,573.96

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
嘉实如意宝定期债券 A/B	506	1,723,259.45	853,982,654.26	97.94	17,986,625.70	2.06
嘉实如意宝定期债券 C	354	67,889.02	11,659,192.79	48.51	12,373,519.19	51.49

合计	846	1,059,104.01	865,641,847.05	96.61	30,360,144.89	3.39
----	-----	--------------	----------------	-------	---------------	------

注：(1) 嘉实如意宝定期债券 A/B: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实如意宝定期债券 A/B 份额占嘉实如意宝定期债券 A/B 总份额比例、个人投资者持有嘉实如意宝定期债券 A/B 份额占嘉实如意宝定期债券 A/B 总份额比例；

(2) 嘉实如意宝定期债券 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实如意宝定期债券 C 份额占嘉实如意宝定期债券 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实如意宝定期债券 C 份额占嘉实如意宝定期债券 C 总份额比例。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实如意宝定期债券 A/B	0
	嘉实如意宝定期债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实如意宝定期债券 A/B	0
	嘉实如意宝定期债券 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实如意宝定期债券 A/B	嘉实如意宝定期债券 C
基金合同生效日（2013 年 6 月 4 日）基金份额总额	1,196,345,855.03	520,384,110.12
本报告期期初基金份额总额	878,156,539.45	30,440,653.40
本报告期基金总申购份额	262,108.17	129,101.38
减：本报告期基金总赎回份额	6,449,367.66	6,537,042.80
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	871,969,279.96	24,032,711.98

注：报告期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2018 年 3 月 21 日本基金管理人发布公告，经雷先生任公司总经理，公司董事长赵学军先生不再代任公司总经理职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 90,000.00 元，该审计机构已连续 6 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

财富证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	18,629.57	100.00%	-
申万宏源证 券有限公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注 1：本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2：交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；
- (3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- (4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3: 报告期内，本基金退租以下交易单元：中信证券股份有限公司退租上海交易单元 1 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券股份有限公司	258,158,088.50	34.54%	15,495,600,000.00	72.38%	-	-
中信建投证券股份有限公司	174,159,190.41	23.30%	12,000,000.00	0.06%	-	-
华泰证券股份有限公司	188,171,749.30	25.17%	5,902,400,000.00	27.57%	-	-
申万宏源证券有限公司	126,976,040.00	16.99%	-	-	-	-

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2018/01/01 至 2018/12/31	849,616,822.42	-	-	849,616,822.42	94.82
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能

对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2019 年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 03 月 26 日