

嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人中国农业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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 债券回购融资情况	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限	36
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	37
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	38

7.9 投资组合报告附注.....	38
§ 8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	39
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.4 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.....	40
§ 9 开放式基金份额变动.....	40
§ 10 重大事件揭示.....	40
10.1 基金份额持有人大会决议.....	40
10.2 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.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	43
10.9 其他重大事件.....	43
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	43
11.1 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.....	43
§ 12 备查文件目录.....	44
12.1 备查文件目录.....	44
12.2 存放地点.....	44
12.3 查阅方式.....	45

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实理财宝 7 天债券	
基金主代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 8 月 29 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,919,448,927.40 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码	070035	070036
报告期末下属分级基金的份 额总额	23,111,100.24 份	11,896,337,827.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据宏观经济指标决定组合的平均剩余期限（长/中/短）和比例分布，根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例，根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别；根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标以及个别债券的收益率与剩余期限的配比等指标进行投资。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95599
传真	(010)65215588	010-68121816

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 53 层 09-11 单元	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100005	100031
法定代表人	经雷	周慕冰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层

§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-2019 年 06 月 30 日)	
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
本期已实现收益	316,706.98	196,848,741.38
本期利润	316,706.98	196,848,741.38
本期净值收益率	1.3686%	1.5144%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 06 月 30 日)	
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
期末基金资产净值	23,111,100.24	11,896,337,827.16
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 06 月 30 日)	
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
累计净值收益率	28.4746%	31.0466%

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；(2) 嘉实理财宝 7 天债券 A 与嘉实理财宝 7 天债券 B 适用不同的销售服务费率；(3) 本基金无持有人

认购/申购或交易基金的各项费用；(4) 本基金收益在基金份额“7 天持有周期到期日”集中结转
为基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实理财宝 7 天债券 A

阶段	份额净值 收益率①	份额净值收 益率标准差 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
过去一个月	0.2214%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.1104%	0.0008%
过去三个月	0.6500%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.3134%	0.0007%
过去六个月	1.3686%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.6991%	0.0008%
过去一年	2.8794%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	1.5294%	0.0013%
过去三年	9.1738%	0.0042%	4.0500%	0.0000%	5.1238%	0.0042%
自基金合同生效 起至今	28.4746%	0.0576%	9.2355%	0.0000%	19.2391%	0.0576%

嘉实理财宝 7 天债券 B

阶段	份额净值 收益率①	份额净值收 益率标准差 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
过去一个月	0.2452%	0.0008%	0.1110%	0.0000%	0.1342%	0.0008%
过去三个月	0.7228%	0.0007%	0.3366%	0.0000%	0.3862%	0.0007%
过去六个月	1.5144%	0.0008%	0.6695%	0.0000%	0.8449%	0.0008%
过去一年	3.1782%	0.0013%	1.3500%	0.0000%	1.8282%	0.0013%
过去三年	10.1271%	0.0042%	4.0500%	0.0000%	6.0771%	0.0042%
自基金合同生效 起至今	31.0466%	0.0576%	9.2355%	0.0000%	21.8111%	0.0576%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基 准收益率变动的比较

嘉实理财宝 7 天债券 A 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

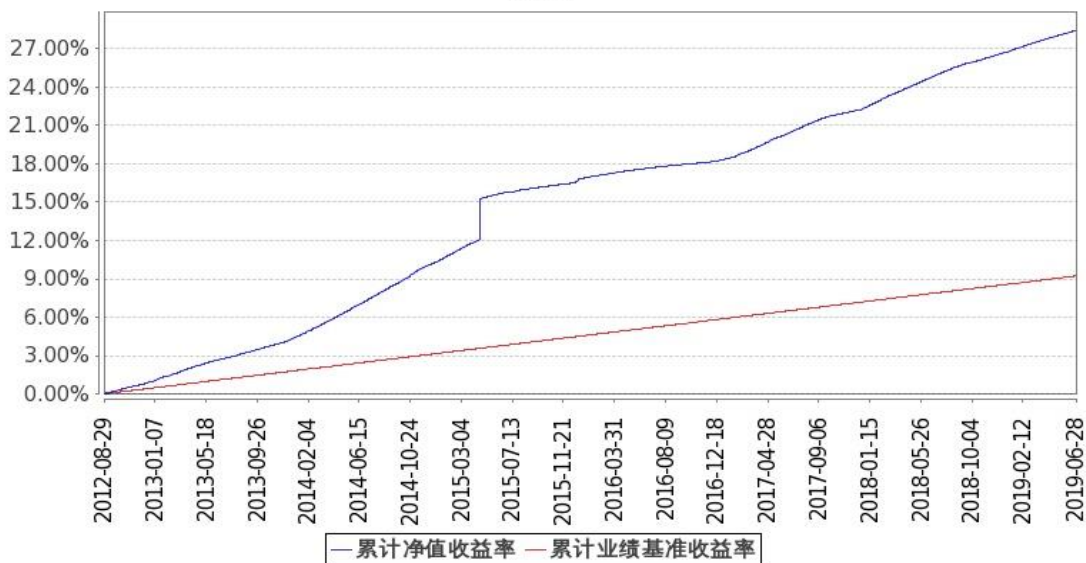


图 1：嘉实理财宝 7 天债券 A 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 8 月 29 日至 2019 年 6 月 30 日)

嘉实理财宝 7 天债券 B 累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

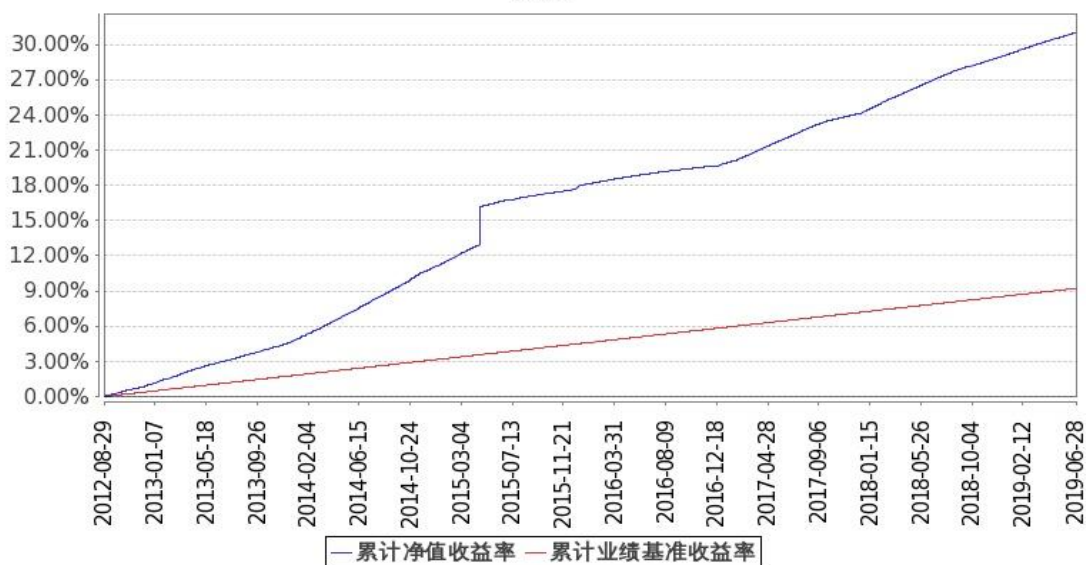


图 2：嘉实理财宝 7 天债券 B 基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 8 月 29 日至 2019 年 6 月 30 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（四）投资限制）的有关约定。

§ 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 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 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、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。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		
王茜	本基金、嘉实多元债券、嘉实多利分级债券、嘉实新起点混合、嘉实新起航混合、嘉实致兴定期纯债债券基金经理	2018 年 11 月 2 日		16 年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理, 中信证券固定收益部, 长盛基金管理有限公司基金经理。2008 年 11 月加盟嘉实基金管理有限公司, 现任固定收益业务体系配置策略组组长。工商管理硕士, 具有基金从业资格, 中国国籍。
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实安宝、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、嘉实快线货币、嘉实	2016 年 7 月 23 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

	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、嘉实中短债债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券基金经理				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。
张文玥	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实 3 个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券基金经理	2014 年 8 月 13 日		11 年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014 年 4 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，具有基金从业资格。

注：（1）任职日期、离职日期指公司作出决定后公告之日；（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、《嘉实理财宝 7 天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，本基金未发生异常交易行为。

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

今年以来，国内经济面临较大下行压力，以及中美贸易谈判的不确定性有所增加，在这样的背景下央行进行了全面降准、定向中期借贷便利（TMLF）和普惠金融定向降准，流动性总体合理充裕。随后政策托底和地产边际放松的提振效果有所显现，经济小幅回升，流动性边际上收紧。然后地产调控再次收紧，企业融资在年初提前放贷和政策集中发力提振后再次疲弱，同时中美贸易摩擦由持续好转突然升级加剧，经济下行压力再次显现，于是 5 月份央行及时进行了定向降准，超额续作了 MLF，并大量投放逆回购，流动性再次回归合理充裕。5 月底，包商银行突然被监管机构接管，释放出监管层有意打破银行“刚兑”信号，短期对市场信心有所影响，引发交易对手和质押券的重新梳理，以及信用风险偏好的回收，流动性分层现象较为突出。此前，1 年期 AAA 国股存单和城商行存单利差在 10bps 左右；包商事件后，1 年期 AAA 国股存单、AAA 城商行存单、AA+ 存单发行利率利差明显走阔至 20、30bps。央行而后连续三周进行了大量流动性投放，至 6 月中旬监管部门通过召开座谈会、对锦州银行存单发行进行增信、及时公告处置进度等措施对市场情绪予以平稳，流动性供需基本平衡。

年初以来，资金面总体合理充裕，局部时间边际走紧，松紧程度的波动较大截至 6 月 30 日，由于全面降准、定向降准，以及财政支出力度增大等措施释放较多增量资金，央行公开市场操作净回笼 10451 亿元（含国库现金定存）。其中，逆回购到期 40550 亿元，投放 37750 亿元；MLF 到期 24100 亿元，投放 11400 亿元；TMLF 投放 5249 亿元。年初全面降准和普惠金融定向降准释放增量资金约 5400 亿元，5 月定向降准释放增量资金约 2800 亿元。

2019 年以来货币市场中枢有所下行，半年末银行间隔夜、7 天、1 个月和 3 个月回购加权利率较去年末分别-98bps、-47bps、-11bps 和-27bps 至 1.58%、2.66%、3.41%、3.58%；短端资产价格也有一定幅度下行：3 个月、6 个月和 1 年期 AAA 存单收益率较去年末分别-48bps、-32bps、-30bps 至 2.49%、2.93%和 3.03%。1 年期国债较去年末上行 4bps 至 2.64%；1 年期国开债较去年末持平下行 3bps 至 2.72%。

2019 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券、同业存单和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制债券整体仓位。整体看，2019 年上半年本基金成功应对了市场波动，投资业绩平稳提高，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实理财宝 7 天债券 A 的基金份额净值收益率为 1.3686%，嘉实理财宝 7 天债券 B

的基金份额净值收益率为 1.5144%，业绩比较基准收益率为 0.6695%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后看三季度基本面和政策面对债券市场比较友好。基本面来看，地产投资高位回落、出口消费乏力，基建和社融增速短期内难以快速回升，通胀上行压力也逐步减弱。在此背景下货币政策从宽货币向紧货币的转变将会有所延迟，经济基本面和政策面共同对债券市场形成支撑。但同时三季度债券供给较大，且贸易谈判不确定性一直存在，可能对市场形成一定冲击。四季度基本面可能逐步趋于平稳，政策可能在边际上有所调整。货币政策逐步减少短期操作，预计等量续作 MLF 的降准搭配以 LPR 为贷款报价利率机制降息操作。宽信用的前提是宽货币，故降准旨在维稳资金面，亦不会“大水满贯”；降息旨在进一步降低小微企业融资实际利率。央行货币政策委员会 2019 年二季度例提出“在推动高质量发展中防范化解风险，把握好处置风险的力度和节奏，稳定市场预期”。

包商银行接管事件将会对银行业结构产生深远影响，低等级中小银行同业负债利率中将包含合理的信用利差，其继续通过同业负债去参与其他投资，以此来增加杠杆、增加盈利的行为将逐步收缩，中小银行的同业业务占比也会下降。包商事件后产生流动性分层及杠杆投资模式的变迁，同业存单刚兑的打破督促市场普遍加强交易对手和质押券的风险管理，非银机构赖以生存的加杠杆套利模式会被迫进行调整，双重影响下将直接影响中低评级个券的投资和估值。

本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，以确保组合安全性和流动性为首要任务，兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，平衡配置同业存款和债券投资，谨慎控制组合的信用配置，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

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

根据本基金基金合同第十六部分（二）收益分配原则的约定：“3. 本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，在基金份额“7 天持有周期到期日”集中支付”、“5. 本基金每日进行收益计算并分配时，在基金份额“7 天持有周期到期日”累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式”的内容，本期 A 类份额已实现收益为 316,706.98 元，每日分配，到期支付，合计分配 316,706.98 元，B 类份额已实现收益为 196,848,741.38 元，每日分配，到期支付，合计分配 196,848,741.38 元，符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

4.8 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,702,720,149.65	4,704,328,687.13
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	13,550,586,106.87	12,469,652,474.10
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,550,586,106.87	12,469,652,474.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	22,876,890.24	47,927,324.89
应收股利		-	-
应收申购款		68,005.00	35,005.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		15,276,251,151.76	17,221,943,491.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,346,099,126.89	4,025,651,281.51
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,844,986.29	2,969,308.11
应付托管费		842,958.92	879,794.96
应付销售服务费		110,861.55	115,653.30
应付交易费用	6.4.7.7	192,458.89	173,377.36
应交税费		-	3,007.77
应付利息		1,044,131.70	3,102,317.50
应付利润		5,550,397.85	6,246,087.59
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	117,302.27	409,000.00

负债合计		3,356,802,224.36	4,039,549,828.10
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	11,919,448,927.40	13,182,393,663.02
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		11,919,448,927.40	13,182,393,663.02
负债和所有者权益总计		15,276,251,151.76	17,221,943,491.12

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，嘉实理财宝 7 天债券 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 23,111,100.24 份；嘉实理财宝 7 天债券 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,896,337,827.16 份。基金份额总额合计为 11,919,448,927.40 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		265,639,414.88	306,599,509.15
1. 利息收入		261,228,423.99	306,393,341.96
其中：存款利息收入	6.4.7.11	38,810,607.84	157,533,839.38
债券利息收入		221,180,843.66	112,950,108.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,236,972.49	35,909,394.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,410,990.89	206,167.19
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	4,410,990.89	206,167.19
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-	-

减：二、费用		68,473,966.52	37,699,739.81
1. 管理人报酬		17,567,279.27	16,953,065.60
2. 托管费		5,205,119.75	5,023,130.50
3. 销售服务费		684,154.73	668,474.82
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		44,858,266.95	14,825,815.78
其中：卖出回购金融资产支出		44,858,266.95	14,825,815.78
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.15	159,145.82	229,253.11
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		197,165,448.36	268,899,769.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		197,165,448.36	268,899,769.34

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	13,182,393,663.02	-	13,182,393,663.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	197,165,448.36	197,165,448.36
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）	-1,262,944,735.62	-	-1,262,944,735.62
其中：1. 基金申购款	404,885,239.81	-	404,885,239.81
2. 基金赎回款	-1,667,829,975.43	-	-1,667,829,975.43
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）	-	-197,165,448.36	-197,165,448.36
五、期末所有者权益	11,919,448,927.40	-	11,919,448,927.40

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	益（基金净值）		
一、期初所有者权益（基金净值）	2,339,001,236.89	-	2,339,001,236.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	268,899,769.34	268,899,769.34
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）	17,933,342,931.77	-	17,933,342,931.77
其中：1. 基金申购款	21,077,189,606.51	-	21,077,189,606.51
2. 基金赎回款	-3,143,846,674.74	-	-3,143,846,674.74
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）	-	-268,899,769.34	-268,899,769.34
五、期末所有者权益（基金净值）	20,272,344,168.66	-	20,272,344,168.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2012]1047 号《关于核准嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 9,527,600,820.82 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《嘉实理财

宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 9,528,525,870.62 份基金份额，其中认购资金利息折合 925,049.80 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金根据投资者认(申)购本基金的金额，在投资者持有基金份额达到或者超过 500 万份时，设置为 A 类基金份额；在投资者持有基金份额低于 500 万份时，设置为 B 类基金份额，因此形成不同的基金份额等级。不同基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，分别设置基金代码，并单独公布每万份基金净收益和 7 日年化收益率。本基金每份基金份额自基金合同生效日或申购确认日起每两个月为一个运作期，运作期到期日前不得赎回。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资于法律法规允许的金融工具包括：现金，银行协议存款，通知存款，一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单，剩余期限(或回售期限)在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据、短期融资券、超短期融资券，及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下: (1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	2,720,149.65
定期存款	1,700,000,000.00
其中:存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	500,000,000.00
存款期限 3 个月及以上	1,200,000,000.00
其他存款	-
合计	1,702,720,149.65

注:定期存款的存款期限指票面存期。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2019 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	13,550,586,106.87	13,558,788,000.00	8,201,893.13	0.0688
	合计	13,550,586,106.87	13,558,788,000.00	8,201,893.13	0.0688
资产支持证券		-	-	-	-
合计		13,550,586,106.87	13,558,788,000.00	8,201,893.13	0.0688

注:偏离金额=影子定价-摊余成本, 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末(2019年6月30日), 本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本期末(2019年6月30日), 本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末(2019年6月30日), 本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	597.32
应收定期存款利息	2,301,388.82
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	20,574,904.10
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	22,876,890.24

6.4.7.6 其他资产

本期末(2019年6月30日), 本基金无其他资产(其他应收款、待摊费用等)。

6.4.7.7 应付交易费用

单位: 人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	192,458.89
合计	192,458.89

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	117,302.27
合计	117,302.27

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,780,654.24	22,780,654.24
本期申购	8,318,312.05	8,318,312.05
本期赎回（以“-”号填列）	-7,987,866.05	-7,987,866.05
本期末	23,111,100.24	23,111,100.24

嘉实理财宝 7 天债券 B

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,159,613,008.78	13,159,613,008.78
本期申购	396,566,927.76	396,566,927.76
本期赎回（以“-”号填列）	-1,659,842,109.38	-1,659,842,109.38
本期末	11,896,337,827.16	11,896,337,827.16

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	316,706.98	-	316,706.98
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-316,706.98	-	-316,706.98
本期末	-	-	-
嘉实理财宝 7 天债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	196,848,741.38	-	196,848,741.38
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-196,848,741.38	-	-196,848,741.38
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	28,495.39
定期存款利息收入	38,777,750.76
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,750.11
其他	611.58
合计	38,810,607.84

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,660,800,922.53
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	18,595,263,731.64
减：应收利息总额	61,126,200.00
买卖债券差价收入	4,410,990.89

6.4.7.13 其他收入

本期（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金无其他收入。

6.4.7.14 交易费用

本期（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金无交易费用。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	58,859.86
银行划款手续费	32,243.55
债券托管账户维护费	17,853.84
其他	600.00
合计	159,145.82

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的管理费	17,567,279.27	16,953,065.60
其中：支付销售机构的客户维护费	9,147.50	12,388.42

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 0.27%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 × 0.27% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	5,205,119.75	5,023,130.50

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 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 × 0.08% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	2,398.54	649,484.31	651,882.85
中国农业银行	8,581.05	-	8,581.05
合计	10,979.59	649,484.31	660,463.90
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	3,717.22	625,917.55	629,634.77
中国农业银行	8,806.65	-	8,806.65
合计	12,523.87	625,917.55	638,441.42

注：本基金 A 类基金份额销售服务费年费率 0.30%，B 类基金份额销售服务费年费率 0.01%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：各类别基金日销售服务费=各类别基金份额前一日资产净值 × 各类别基金份额适用的销售服务费率 / 当年天数。对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起享受 B 类基金份额持有人的费率；对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

6.4.10.3 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

本期 2019年1月1日至2019年6月30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
中国农业银行股份有限公司	-	-	-	-	1,161,123,000.00	332,590.20
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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
中国农业银行股份有限公司	29,696,122.52	-	-	-	120,000,000.00	8,972.33

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），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。

6.4.10.4.2 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（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	2,720,149.65	28,495.39	1,388,607.12	43,004.55
中国农业银行股份有限公司_定期	-	4,141,666.71	-	-

注：本基金的活期银行存款和部分定期银行存款由基金托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
312,414.52	4,159.73	132.73	316,706.98	-
嘉实理财宝 7 天债券 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
196,566,927.76	977,636.09	-695,822.47	196,848,741.38	-

6.4.12 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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(2019年6月30日)，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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 3,346,099,126.89 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
111908075	19 中信银 行 CD075	2019 年 7 月 1 日	99.71	4,000,000	398,826,260.16
111908077	19 中信银 行 CD077	2019 年 7 月 1 日	99.69	2,881,000	287,207,336.91
111909174	19 浦发银 行 CD174	2019 年 7 月 1 日	99.41	4,000,000	397,622,484.34
111910190	19 兴业银 行 CD190	2019 年 7 月 1 日	99.71	5,000,000	498,532,710.97
111911058	19 平安银 行 CD058	2019 年 7 月 1 日	99.69	1,051,000	104,774,353.02
120412	12 农发 12	2019 年 7 月 1 日	100.04	3,000,000	300,122,109.83
160016	16 付息国 债 16	2019 年 7 月 1 日	100.03	1,000,000	100,025,982.20
160420	16 农发 20	2019 年 7 月 1 日	100.02	1,000,000	100,022,885.16
180018	18 付息国 债 18	2019 年 7 月 1 日	100.06	1,000,000	100,059,864.45
199914	19 贴现国 债 14	2019 年 7 月 1 日	99.92	1,500,000	149,879,924.76
111915158	19 民生银	2019 年 7 月 2 日	99.69	155,000	15,451,974.05

	行 CD158				
111915225	19 民生银行 CD225	2019 年 7 月 2 日	99.41	5,000,000	497,028,105.46
111811305	18 平安银行 CD305	2019 年 7 月 3 日	99.77	1,348,000	134,491,142.20
111915157	19 民生银行 CD157	2019 年 7 月 3 日	99.69	4,000,000	398,760,620.45
合计				34,935,000	3,482,805,753.96

6.4.12.2 交易所市场债券正回购

本期末(2019年6月30日)，本基金无交易所市场债券正回购余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金投资于各类货币市场工具，属于高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和 workflows、组织纪律。业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察

稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于信用等级在 AAA 以下的企业债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	150,419,096.72	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	150,419,096.72	-

注:1. 上年度末 (2018 年 12 月 31 日), 本基金未持有按长期信用评级的债券投资。2. 长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级, 并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末 (2019 年 6 月 30 日) 及上年度末 (2018 年 12 月 31 日), 本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	12,650,056,243.75	11,291,351,501.39
AAA 以下	-	396,666,238.43
未评级	-	-
合计	12,650,056,243.75	11,688,017,739.82

注:长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级, 并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告, 存单采用发行人主体评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额, 另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

于本报告期末, 除附注 6.4.12.2 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息

(该利息金额不重大)外, 本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息, 可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息, 因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%。本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外, 其余均能以合理价格适时变现。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险, 包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,502,720,149.65	200,000,000.00	-	-	1,702,720,149.65
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	13,257,839,964.81	292,746,142.06	-	-	13,550,586,106.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	22,876,890.24	22,876,890.24
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	68,005.00	68,005.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,760,560,114.46	492,746,142.06	-	22,944,895.24	15,276,251,151.76
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,346,099,126.89	-	-	-	3,346,099,126.89
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,844,986.29	2,844,986.29
应付托管费	-	-	-	842,958.92	842,958.92
应付销售服务费	-	-	-	110,861.55	110,861.55
应付交易费用	-	-	-	192,458.89	192,458.89
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	1,044,131.70	1,044,131.70

应付利润	-	-	-	5,550,397.85	5,550,397.85
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	117,302.27	117,302.27
负债总计	3,346,099,126.89	-	-	10,703,097.47	3,356,802,224.36
利率敏感度缺口	11,414,460,987.57	492,746,142.06	-	-12,241,797.77	11,919,448,927.40
上年度末 2018 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	4,704,328,687.13	-	-	-	4,704,328,687.13
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	9,333,914,156.87	3,135,738,317.23	-	-	12,469,652,474.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	47,927,324.89	47,927,324.89
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	35,005.00	35,005.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	14,038,242,844.00	3,135,738,317.23	-	47,962,329.89	17,221,943,491.12
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	4,025,651,281.51	-	-	-	4,025,651,281.51
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,969,308.11	2,969,308.11
应付托管费	-	-	-	879,794.96	879,794.96
应付销售服务费	-	-	-	115,653.30	115,653.30
应付交易费用	-	-	-	173,377.36	173,377.36
应付税费	-	-	-	3,007.77	3,007.77
应付利息	-	-	-	3,102,317.50	3,102,317.50
应付利润	-	-	-	6,246,087.59	6,246,087.59
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	409,000.00	409,000.00
负债总计	4,025,651,281.51	-	-	13,898,546.59	4,039,549,828.10
利率敏感度缺口	10,012,591,562.49	3,135,738,317.23	-	-34,063,783.30	13,182,393,663.02

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动（2018 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，未持有权益类证券，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 13,550,586,106.87 元，无属于第一、第三层次的余额（上年度末：第二层次 12,469,652,474.10 元，无属于第一、第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本报告期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未

发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 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	固定收益投资	13,550,586,106.87	88.70
	其中：债券	13,550,586,106.87	88.70
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	1,702,720,149.65	11.15
4	其他各项资产	22,944,895.24	0.15
5	合计	15,276,251,151.76	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	27.38	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	3,346,099,126.89	28.07
	其中：买断式回购融资	-	-

注：（1）报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数，报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。（2）报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 40%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	61

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 120 天。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	21.22	28.07
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	31.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	58.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	2.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	14.94	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	127.97	28.07

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

7.5 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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	349,965,771.41	2.94

2	央行票据	-	-
3	金融债券	550,564,091.71	4.62
	其中：政策性金融债	400,144,994.99	3.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	12,650,056,243.75	106.13
8	其他	-	-
9	合计	13,550,586,106.87	113.68
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：上表中，付息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	111919101	19 恒丰银行 CD101	7,000,000	695,119,468.20	5.83
2	111910190	19 兴业银行 CD190	5,000,000	498,532,710.97	4.18
3	111992536	19 河北银行 CD015	5,000,000	497,449,932.23	4.17
4	111915225	19 民生银行 CD225	5,000,000	497,028,105.46	4.17
5	111919097	19 恒丰银行 CD097	5,000,000	496,640,222.71	4.17
6	111994000	19 徽商银行 CD024	5,000,000	496,584,502.58	4.17
7	111908075	19 中信银行 CD075	4,000,000	398,826,260.16	3.35
8	111911058	19 平安银行 CD058	4,000,000	398,760,620.45	3.35
8	111915157	19 民生银行 CD157	4,000,000	398,760,620.45	3.35
10	111909174	19 浦发银行 CD174	4,000,000	397,622,484.34	3.34

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1547%

报告期内偏离度的最低值	-0.0538%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0674%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.0000 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提收益或损失。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

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。

7.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,876,890.24
4	应收申购款	68,005.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,944,895.24

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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	户均持有的基金份 额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)		持有份额	占总份额 比例 (%)	持有份额	占总份额 比例 (%)
嘉实理财宝 7 天债券 A	5,440	4,248.36	425,678.72	1.84	22,685,421.52	98.16
嘉实理财宝 7 天债券 B	6	1,982,722,971.19	11,896,337,827.16	100.00	-	-
合计	5,446	2,188,661.21	11,896,763,505.88	99.81	22,685,421.52	0.19

注：(1)嘉实理财宝 7 天债券 A: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理财宝 7 天债券 A 份额占嘉实理财宝 7 天债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 A 份额占嘉实理财宝 7 天债券 A 总份额比例；

(2)嘉实理财宝 7 天债券 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理财宝 7 天债券 B 份额占嘉实理财宝 7 天债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 B 份额占嘉实理财宝 7 天债券 B 总份额比例。

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	银行类机构	7,818,596,515.00	65.60
2	银行类机构	2,250,656,959.94	18.88
3	银行类机构	730,728,677.67	6.13
4	银行类机构	634,016,855.14	5.32
5	银行类机构	407,408,118.02	3.42
6	银行类机构	54,930,701.39	0.46
7	个人	1,111,867.38	0.01
8	个人	440,717.25	0.00
9	个人	385,505.85	0.00
10	个人	385,237.77	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实理财宝 7 天债券 A	700.78	0.00
	嘉实理财宝 7 天债券 B	-	-
	合计	700.78	0.00

8.4 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实理财宝 7 天债券 A	0
	嘉实理财宝 7 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实理财宝 7 天债券 A	0
	嘉实理财宝 7 天债券 B	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
基金合同生效日（2012 年 8 月 29 日）基金份额总额	5,847,460,658.26	3,681,065,212.36
本报告期期初基金份额总额	22,780,654.24	13,159,613,008.78
本报告期基金总申购份额	8,318,312.05	396,566,927.76
减：本报告期基金总赎回份额	7,987,866.05	1,659,842,109.38
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	23,111,100.24	11,896,337,827.16

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

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。

2019 年 6 月 6 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》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公

告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
广发证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	新增
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
世纪证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 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
长江证券股份有限公司	-	-	500,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加嘉实财富为嘉实旗下基金代销机构并参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019 年 1 月 18 日
2	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与嘉实财富定投业务的公告	证券时报、管理人网站	2019 年 3 月 8 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		比例达到或者超过 20% 的时间区间					
机构	1	2019/01/01 至 2019/06/30	7,701,849,387.09	116,747,127.91	-	7,818,596,515.00	65.60
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 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

12.3 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 08 月 29 日