

嘉实定期宝 6 个月理财债券型  
证券投资基金  
2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 04 月 08 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	19
4.10 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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 债券回购融资情况.....	48
8.3 基金投资组合平均剩余期限.....	48

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
8.6 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 .....	49
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	50
8.8 期末按摊余成本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 .....	50
8.9 投资组合报告附注 .....	50
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	52
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
9.4 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 .....	52
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	54
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	58
11.9 其他重大事件 .....	58
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录 .....	58
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实定期宝 6 个月理财债券	
基金主代码	003880	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 23 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,147,728,822.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B
下属分级基金的交易代码	003880	003881
报告期末下属分级基金的份额总额	13,212,836.65 份	2,134,515,985.88 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	本基金通过对各类资产综合判断，决定各类资产的配置比例并适时进行动态调整。在期限配置上，根据对短期利率走势的判断确定并调整组合的平均期限。在个券选择方面，本基金综合运用收益率曲线分析、流动性分析、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值，发掘出具备相对价值的个券。同时，通过分析短期市场机会，积极利用市场机会获得超额收益，控制基金组合风险，谋求组合收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的 6 个月定期存款基准利率（税后）
风险收益特征	本基金为理财债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 姓名	胡勇钦	许俊

负责人	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	(010)66594942
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 27 楼 09-14 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100005	100818
法定代表人		经雷	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、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(2019 年 01 月 01 日-2019 年 12 月 31 日)		报告期(2018 年 01 月 01 日-2018 年 12 月 31 日)		2017 年 03 月 23 日（基金合同生效日） -2017 年 12 月 31 日	
	嘉实定期宝 6 个 月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月 理财债券 B	嘉实定期宝 6 个 月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月 理财债券 B	嘉实定期宝 6 个 月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月 理财债券 B
本期 已实 现收 益	570,706.72	92,399,458.38	4,021,988.79	147,995,832.96	32,220,283.66	12,432,764.96

本期利润	570,706.72	92,399,458.38	4,021,988.79	147,995,832.96	32,220,283.66	12,432,764.96
本期净值收益率	2.7112%	2.9045%	4.3279%	4.5252%	3.0005%	3.1482%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末基金资产净值	13,212,836.65	2,134,515,985.88	29,284,503.79	3,707,949,739.61	231,833,486.20	1,305,104,848.35
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
累计净值收益率	10.3739%	10.9498%	7.4676%	7.8263%	3.0005%	3.1482%

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）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（3）嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 与嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 适用不同的销售服务费率；（4）本基金收益在基金份额“6 个月持有周期到期日”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

嘉实定期宝 6 个月理财债券 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
过去三个	0.6759%	0.0068%	0.3261%	0.0000%	0.3498%	0.0068%
过去六个	1.2087%	0.0049%	0.6532%	0.0000%	0.5555%	0.0049%
过去一年	2.7112%	0.0042%	1.3000%	0.0000%	1.4112%	0.0042%
自基金合 同生效起 至今	10.3739%	0.0036%	3.6534%	0.0000%	6.7205%	0.0036%

嘉实定期宝 6 个月理财债券 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
过去三个	0.7233%	0.0068%	0.3261%	0.0000%	0.3972%	0.0068%
过去六个	1.3048%	0.0049%	0.6532%	0.0000%	0.6516%	0.0049%
过去一年	2.9045%	0.0042%	1.3000%	0.0000%	1.6045%	0.0042%
自基金合 同生效起 至今	10.9498%	0.0036%	3.6534%	0.0000%	7.2964%	0.0036%



### 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

**嘉实定期宝6个月理财债券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**

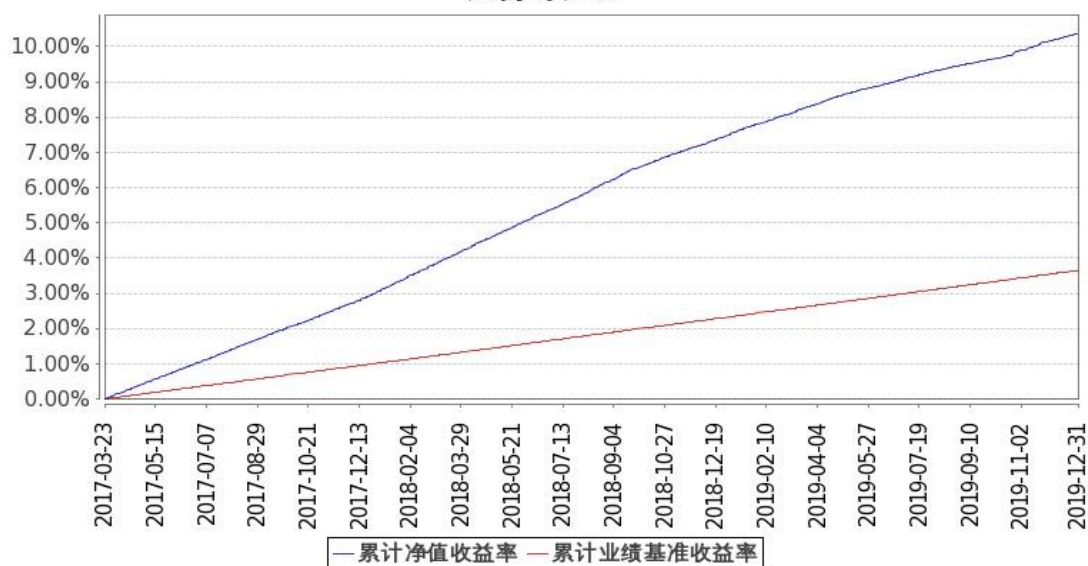


图 1：嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 基金份额累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 3 月 23 日至 2019 年 12 月 31 日)

**嘉实定期宝6个月理财债券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**

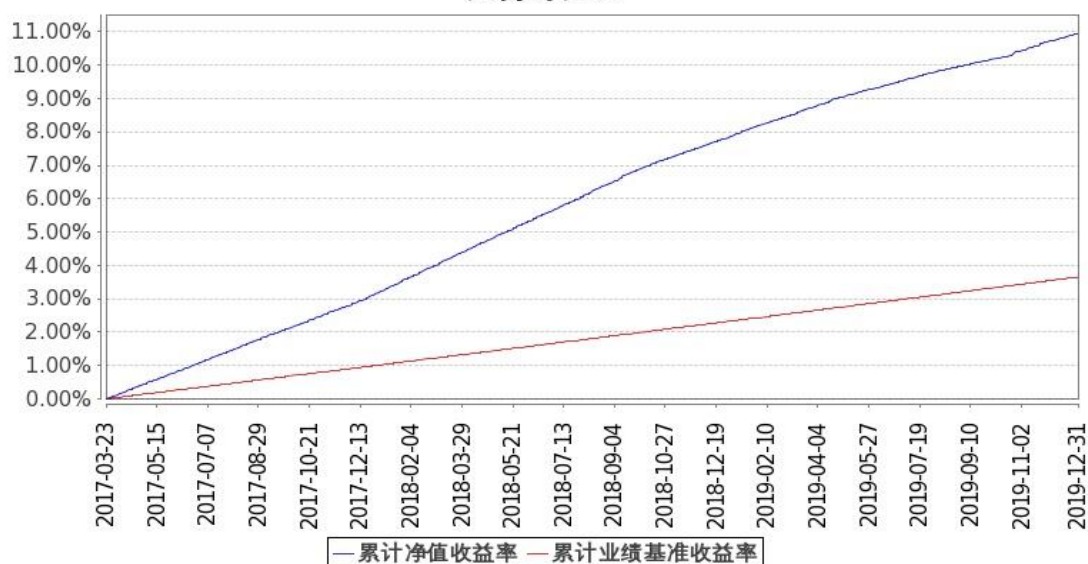


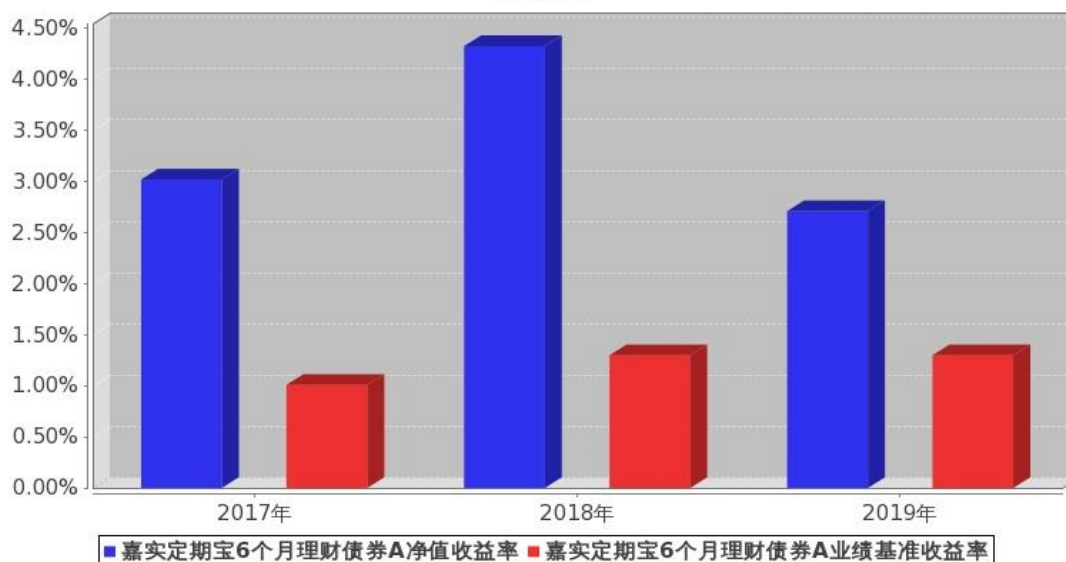
图 2：嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 基金份额累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017 年 3 月 23 日至 2019 年 12 月 31 日)

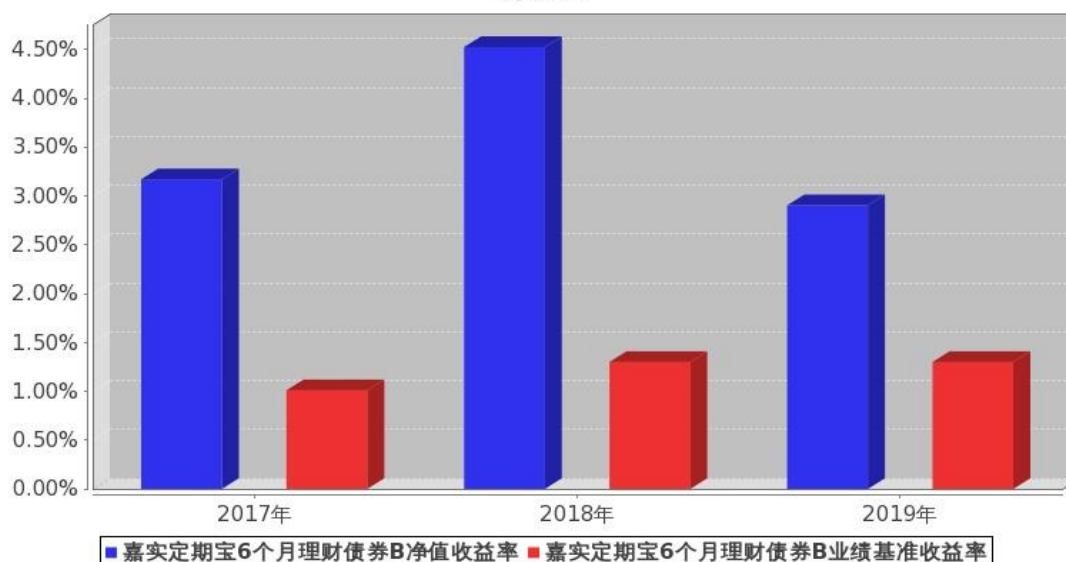
注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(十二(二)投资范围和(四)投资限制)的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

**嘉实定期宝6个月理财债券A基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



**嘉实定期宝6个月理财债券B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注:本基金基金合同生效日为2017年3月23日,2017年度的相关数据根据当年实际存续期(2017年3月23日至2017年12月31日)计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:元

嘉实定期宝6个月理财债券A

年度	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注

	转实收基金	赎回款转出金额	本年变动	分配合计	
2019 年	487,672.99	244,105.72	-161,071.99	570,706.72	-
2018 年	1,695,411.69	4,397,104.26	-2,070,527.16	4,021,988.79	-
2017 年	4,361,682.56	25,533,762.09	2,324,839.01	32,220,283.66	-
合计	6,544,767.24	30,174,972.07	93,239.86	36,812,979.17	-

## 嘉实定期宝 6 个月理财债券 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2019 年	77,039,657.17	32,635,856.15	-17,276,054.94	92,399,458.38	-
2018 年	105,434,774.58	10,471,111.93	32,089,946.45	147,995,832.96	-
2017 年	103,273.35	9,468,358.17	2,861,133.44	12,432,764.96	-
合计	182,577,705.10	52,575,326.25	17,675,024.95	252,828,056.30	-

## § 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国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，总部设在北京并设深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 资格和特定资产管理业务资格。

截止 2019 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 176 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、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、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券。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		
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、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、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、嘉实汇鑫中短债债券基金经理	2017 年 5 月 25 日	-	10 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。
张文玥	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、理财宝 7 天债券、	2017 年 3 月 23 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

	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、嘉实融享货币基金经理				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。
李瞳	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、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实现金添利货币、嘉实中短债债券、嘉实汇鑫中短债债券基金经理	2017年5月25日	-	10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。

注:(1)基金经理张文明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、李瞳的任职日期是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、《嘉实定期宝 6 个月理财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 5 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

2019 年由于贸易冲突的冲击和周期性因素，2019 年全球主要发达经济体均经济状况均放缓。欧日放缓程度更大，经济陷入疲弱，美国经济缓中有韧性，相对其他发达经济体较好，美联储年内三次降息对美国经济形成了托底，经济出现回暖迹象，但通胀持续疲弱。

2019 年，中国 GDP 增速下滑有所加快，实际增速从 6.6% 下降至 6.2%，名义增速从 8.85% 下降至 7.2%。从需求端看，三类支出增速均下行。其中出口增速下行幅度较大，从 9.87% 下行至 -0.3%，消费增速次之，从 8.98% 下降至 8.10%，投资增速从 5.9% 下降至 5.2%。固定资产投资中，制造业是主要拖累因素，地产投资成为支撑 2019 年增速的主要力量，基建投资从低位逐步回升，但幅度略低于预期。同时外需下降和贸易摩擦共同拖累出口，造成 2019 年出口增速大幅下行。从工业企业效益看，2019 年规模以上工业企业利润增速继续下降，利润增速从 10.3% 下降至 -2.9%，营业收入增速从 8.6% 下降至 4.2%。尽管 2019 年经济呈现供需两弱，但通胀持续走高。CPI 从去年末的 1.9% 上升至 4.5%，其中食品价格增速从 2.5% 上升至 19.1%，非食品价格增速从 1.7% 下降至 1%。CPI 指数走高主要受猪肉价格拉动，剔除食品和能源的核心 CPI 也呈现下降趋势，增速从 1.8% 下降至 1.4%。工业品价格前三季度持续下行，增速由正转负，11 月以来略有上行，PPI 拐点初现。

2019 年，在房地产严控基调不变，中美贸易冲突不断升级，基建发力缓慢背景下，央行全年对流动性的定调为合理充裕，在两次全面降准，三次定向降准，和及时的公开市场操作推动下，资金面总体较充裕。1 至 5 月，面对较大的经济下行压力，央行年初普惠金融定向降准，实施全面降准和 TMLF 操作，推动流动性合理充裕，资金价格中枢与去年四季度相当，但波动性明显加大。5 月下旬，为应对中美贸易冲突大幅升级和包商银行事件爆发的冲击，央行开展再贴现和常备借贷便利操作，叠加 5 月实施的定向降准，5 月下旬至 6 月，流动性一度很充裕，资金价格中枢下移。11 月，央行货币政策执行报告确认经济面临下行压力，删除把好货币供给“总闸门”措辞，MLF 和公开市场逆回购利率接连小幅下调至 3.25% 和 2.50%，1 年和 5 年 LPR 贷款利率也随之下行至 4.15% 和 4.80%，流动性再次回归合理充裕，资金价格中枢有所下移。2019 年末，社会融资规模存量为 251.31 万亿元，同比增长 10.7%，增速比上年同期高 0.4 个百分点。货币供应量 M2 余额为 198.65 万亿元，同比增长 8.7%，增速分别比上年同期高 0.6 个百分点。

影响 2019 年债市走势的主要因素为基本面和通胀，一方面内外需同步回落带动 GDP 增速下行，另一方面猪肉拉动通胀走高。2019 年收益率曲线整体经历了从牛平到熊陡又再度牛平的过程。其中一季度由于一致预期较为浓厚，收益率曲线走平，4 月份调整后长端上行幅度更大曲线走陡。9 月收益率再次上行带动曲线变陡，但随着央行降息，曲线重新走平。5 月底的包商事件对同业存



单发行造成较大冲击，6 月各评级同业存单净融资额一度全面转负，下半年 AA+及以下评级同业存单规模持续收缩，中低评级城商行、农商行存单续作仍较为困难。2019 年同业存单净融资规模较之前大幅缩减，其中 AA+及以下银行净融资额全面转负，中小行负债管理承压。2019 年末隔夜、7 天、1 个月和 3 个月回购加权利率较 2018 年末分别下行 22BP、6BP、59BP 和 46BP 至 2.31%、3.07%、2.93%和 3.39%；银行间市场国债收益率曲线呈现小幅下移，2019 年末国债收益率曲线 1 年、3 年、5 年、7 年和 10 年期收益率较 2018 年末分别下行 24BP、14BP、8BP、13BP 和 9BP 至 2.36%、2.73%、2.89%、3.04%和 3.14%。10 年期与 1 年期国债期限利差为 77BP，较 2018 年末扩大 14BP。

2019 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，谨慎筛选组合投资个券，严控信用风险；灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看，2019 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

本报告期嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 的基金份额净值收益率为 2.7112%，嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 的基金份额净值收益率为 2.9045%，业绩比较基准收益率为 1.3000%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年是实现小康社会的最后一年。2012 年党的十八大报告明确提出我国将在 2020 年全面建成小康社会，实现国内生产总值和城乡居民人均收入比 2010 年翻一番。今明两年作为政策收尾的关键年份，其经济增长成效对目标是否能够顺利完成至关重要。12 月中央经济工作会议上，指出“稳字当头”，坚持宏观政策要稳、微观政策要活、社会政策要托底的政策框架，稳增长的诉求较强。在经济下行压力加大的背景下，基建投资增速 2020 年有望继续回升。中央经济工作会议提出“积极的财政政策要大力提质增效”，为了保障财政对基建的支持力度，2020 年赤字率有望提高至 3%。专项债发挥更大的作用。预计 2020 年专项债发行规模在 3-3.5 万亿左右，对基建形成有力支撑。同时 PSL 也有可能重新投放，政策性银行提供配套融资。

2019 年中央经济工作会议要求保持流动性合理充裕。在偏宽松的货币政策基调下，为应对专项债发行和推动实体融资成本下降，预计 2020 年流动性总体仍保持较充裕状态。2020 年初，随着新冠肺炎疫情的形势发展，央行主动加大公开市场逆回购投放，并下调 7 天逆回购和 14 天逆回购 10BP 至 2.40%和 2.55%。后续预计 MLF 和 LPR 利率、以及 SLF 利率水平仍然存在小幅下调空间，

引导市场利率下行，降低银行负债成本。随着市场预期好转，对外开放度加深，外资会继续有所流入，稳外储有需要，以及中美贸易第一阶段文本协议要求不进行汇率竞争性贬值，人民币可能有小幅升值。

2020 年还是资管新规过渡期的最后一年，届时清理转型达标等压力较大，或对债券市场形成一定影响。2019 年末，银保监会和人民银行就规范现金管理类理财产品管理的征求意见稿下发，现金管理类产品的监管规则整体与货币市场基金等同类产品监管标准保持一致，过渡期至 2020 年末结束，这对现金管理类银行理财产品的转型运作将起到积极的推动作用。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 合规管理：主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 内部审计：按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内审，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 法律事务：负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成监察稽核报告、合规报告和各项统计、专题报告。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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（三）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“6 个月持有周期到期日”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“6 个月持有周期到期日”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 570,706.72 元，每日分配，到期支付，合计分配 570,706.72 元，B 类份额已实现收益为 92,399,458.38 元，每日分配，到期支付，合计分配 92,399,458.38 元，符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

#### 4.9 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。

#### 4.10 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2020)第23724号

嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 一、 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金(以下简称“嘉实定期宝 6 个月理财债券基金”)的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了嘉实定期宝 6 个月理财债券基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 二、 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实定期宝 6 个月理财债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 三、 管理层和治理层对财务报表的责任

嘉实定期宝 6 个月理财债券基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财

务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实定期宝6个月理财债券基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实定期宝6个月理财债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督嘉实定期宝6个月理财债券基金的财务报告过程。

#### 四、 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实定期宝 6 个月理财债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致嘉实定期宝 6 个月理财债券基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天  
会计师事务所(特殊普通合伙)

注册会计师  
薛 竞

中国 · 上海市

周 祎

2020 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	300,927,828.57	1,149,022,005.84
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	2,080,848,342.50	3,175,361,769.93
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,080,848,342.50	3,175,361,769.93
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	199,979,739.97	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	12,991,316.15	59,459,822.46
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		2,594,747,227.19	4,383,843,598.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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		428,060,237.91	609,066,766.39
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		615,640.14	956,253.29

应付托管费		205,213.43	318,751.19
应付销售服务费		22,679.12	36,778.65
应付交易费用	7.4.7.7	51,186.07	59,804.85
应交税费		-	-
应付利息		66,183.18	556,608.72
应付利润		17,768,264.81	35,205,391.74
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	229,000.00	409,000.00
负债合计		447,018,404.66	646,609,354.83
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	2,147,728,822.53	3,737,234,243.40
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		2,147,728,822.53	3,737,234,243.40
负债和所有者权益总计		2,594,747,227.19	4,383,843,598.23

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 13,212,836.65 份；嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,134,515,985.88 份。基金份额总额合计为 2,147,728,822.53 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		114,824,049.48	179,847,237.71
1. 利息收入		108,445,507.17	174,552,788.61
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,916,699.56	103,437,084.79
债券利息收入		86,937,749.30	65,316,026.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,591,058.31	5,799,677.01
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,378,542.31	5,294,449.10
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	6,378,542.31	5,294,449.10
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)	7.4.7.13	-	-
减：二、费用		21,853,884.38	27,829,415.96
1. 管理人报酬		9,570,788.44	10,317,374.05
2. 托管费		3,197,421.97	3,439,125.09
3. 销售服务费		359,043.02	512,790.32
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		8,412,128.68	13,062,697.31
其中：卖出回购金融资产支出		8,412,128.68	13,062,697.31
6. 税金及附加		3,055.74	14,786.29
7. 其他费用	7.4.7.15	311,446.53	482,642.90
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		92,970,165.10	152,017,821.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		92,970,165.10	152,017,821.75

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	3,737,234,243.40	-	3,737,234,243.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	92,970,165.10	92,970,165.10
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)	-1,589,505,420.87	-	-1,589,505,420.87



其中：1. 基金申购款	527,748,236.30	-	527,748,236.30
2. 基金赎回款	-2,117,253,657.17	-	-2,117,253,657.17
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）	-	-92,970,165.10	-92,970,165.10
五、期末所有者权益（基金净值）	2,147,728,822.53	-	2,147,728,822.53
项目	上年度可比期间 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）	1,536,938,334.55	-	1,536,938,334.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	152,017,821.75	152,017,821.75
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）	2,200,295,908.85	-	2,200,295,908.85
其中：1. 基金申购款	2,857,863,247.94	-	2,857,863,247.94
2. 基金赎回款	-657,567,339.09	-	-657,567,339.09
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）	-	-152,017,821.75	-152,017,821.75
五、期末所有者权益（基金净值）	3,737,234,243.40	-	3,737,234,243.40

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

罗丽丽

罗丽丽

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 基金基本情况

嘉实定期宝 6 个月理财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[2014]1001 号《关于准予嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金注册的批复》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《嘉实定期宝 6 个月理财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 1,958,525,243.73 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 271 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,959,039,948.99 份基金份额,其中认购资金利息折合 514,705.26 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金根据投资者认购、申购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费,因此形成不同的基金份额类别,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。当投资者在单个基金账户保留的 A 类基金份额达到 B 类基金份额的最低份额要求时,注册登记机构自动将投资者在该基金账户保留的 A 类基金份额全部升级为 B 类基金份额。当投资者在单个基金账户保留的 B 类基金份额不能满足 B 类基金份额最低份额要求时,注册登记机构自动将投资者在该基金账户保留的 B 类基金份额全部降级为 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,通知存款,短期融资券,超短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,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,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为:中国人民银行公布的 6 个月定期存款基准利率(税后)。

### 7.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券

投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 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。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认

为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用。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“6 个月持有周期到

期日”集中支付。本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日净收益等于零时，当日投资人不记收益。本基金每日进行收益计算并分配时，在基金份额“6 个月持有周期到期日”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，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在基金份额“6 个月持有周期到期日”累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回全部基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。本基金同类每份基金份额享有同等分配权。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	927,828.57	2,022,005.84
定期存款	300,000,000.00	1,147,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	200,000,000.00	-
存款期限 3 个月及以上	100,000,000.00	1,147,000,000.00
其他存款	-	-
合计	300,927,828.57	1,149,022,005.84

注：定期存款的存款期限指票面存期。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 年 12 月 31 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	2,080,848,342.50	2,083,557,000.00	2,708,657.50	0.1261
	合计	2,080,848,342.50	2,083,557,000.00	2,708,657.50	0.1261
资产支持证券		-	-	-	-
合计		2,080,848,342.50	2,083,557,000.00	2,708,657.50	0.1261
项目		上年度末 2018 年 12 月 31 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	3,175,361,769.93	3,180,084,000.00	4,722,230.07	0.1264
	合计	3,175,361,769.93	3,180,084,000.00	4,722,230.07	0.1264
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,175,361,769.93	3,180,084,000.00	4,722,230.07	0.1264

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。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。



## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	199,979,739.97	-
合计	199,979,739.97	-
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	227.04	343.23
应收定期存款利息	1,288,249.91	44,833,687.44
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	11,553,913.36	14,625,791.79
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	148,925.84	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	12,991,316.15	59,459,822.46

## 7.4.7.6 其他资产

无。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	51,186.07	59,804.85
合计	51,186.07	59,804.85

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
其他	-	-
预提费用	229,000.00	409,000.00
应付指数使用费	-	-
应付替代款	-	-
可退替代款	-	-
合计	229,000.00	409,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 嘉实定期宝 6 个月理财债券 A

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	29,284,503.79	29,284,503.79
本期申购	708,579.13	708,579.13
本期赎回 (以“-”号填列)	-16,780,246.27	-16,780,246.27
本期末	13,212,836.65	13,212,836.65

##### 嘉实定期宝 6 个月理财债券 B

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	3,707,949,739.61	3,707,949,739.61
本期申购	527,039,657.17	527,039,657.17
本期赎回 (以“-”号填列)	-2,100,473,410.90	-2,100,473,410.90
本期末	2,134,515,985.88	2,134,515,985.88

注：报告期间基金总申购份额含红利再投。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实定期宝 6 个月理财债券 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	570,706.72	-	570,706.72
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	-570,706.72	-	-570,706.72
本期末	-	-	-
嘉实定期宝 6 个月理财债券 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	92,399,458.38	-	92,399,458.38
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	-92,399,458.38	-	-92,399,458.38
本期末	-	-	-

## 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	20,395.43	13,602.91
定期存款利息收入	13,894,684.13	103,414,331.66
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,620.00	9,150.22
其他	-	-
合计	13,916,699.56	103,437,084.79

## 7.4.7.12 债券投资收益

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12月	2018年1月1日至2018年12月

	31日	月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	17,532,097,959.11	7,320,273,421.23
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	17,405,137,863.67	7,257,299,163.32
减：应收利息总额	120,581,553.13	57,679,808.81
买卖债券差价收入	6,378,542.31	5,294,449.10

#### 7.4.7.13 其他收入

无。

#### 7.4.7.14 交易费用

无。

#### 7.4.7.15 其他费用

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12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	300,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	54,046.00	41,407.86
上市年费	-	-
债券托管账户维护费	36,000.00	39,000.00
指数使用费	-	-
红利手续费	-	-
其他	1,400.53	2,235.04
合计	311,446.53	482,642.90

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,570,788.44	10,317,374.05
其中：支付销售机构的客户维护费	24,138.59	138,002.54

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018
----	-------------------------------	----------------------------------

	12 月 31 日	年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,197,421.97	3,439,125.09

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实定期宝 6 个月理财 债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财 债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	1,305.91	317,669.91	318,975.82
中国银行	39,702.19	-	39,702.19
合计	41,008.10	317,669.91	358,678.01
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实定期宝 6 个月理财 债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财 债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	2,854.15	334,905.91	337,760.06
中国银行	173,045.22	119.00	173,164.22
合计	175,899.37	335,024.91	510,924.28

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%，B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：各类别基金份额日销售服务费 = 各类别基金份额前一日基金资产净值 × 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。

#### 7.4.10.3 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 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
中国银行	-	401,701,882.97	-	-	-	-
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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
中国银行	-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.4.2 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

无。

#### 7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 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
中国银行股份有限公司_活期	927,828.57	20,395.43	2,022,005.84	13,602.91
中国银行股份有限公司_定期	-	-	-	424,666.24

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

嘉实定期宝 6 个月理财债券 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
487,672.99	244,105.72	-161,071.99	570,706.72	-
嘉实定期宝 6 个月理财债券 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
77,039,657.17	32,635,856.15	-17,276,054.94	92,399,458.38	-

## 7.4.12 期末(2019 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 7.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 428,060,237.91 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
190211	19 国开 11	2020 年 1 月 2 日	99.92	4,413,000	440,937,920.68
合计				4,413,000	440,937,920.68

## 7.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

无。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

## 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为理财债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。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工作流程、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。

#### 7.4.13.2 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通过券款对付的方式进行交割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。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 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 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
AAA	1,131,339,598.44	1,956,267,671.90
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,131,339,598.44	1,956,267,671.90

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，存单使用发行人主体评级。

### 7.4.13.3 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 7.4.12.2 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。

#### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	300,927,828.57	-	-	-	300,927,828.57
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,085,499,725.86	995,348,616.64	-	-	2,080,848,342.50
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	199,979,739.97	-	-	-	199,979,739.97
应收证券清算款	-	-	-	-	-

应收利息	-	-	-	12,991,316.15	12,991,316.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,586,407,294.40	995,348,616.64	-	12,991,316.15	2,594,747,227.19
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	428,060,237.91	-	-	-	428,060,237.91
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	615,640.14	615,640.14
应付托管费	-	-	-	205,213.43	205,213.43
应付销售服务费	-	-	-	22,679.12	22,679.12
应付交易费用	-	-	-	51,186.07	51,186.07
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	66,183.18	66,183.18
应付利润	-	-	-	17,768,264.81	17,768,264.81
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	229,000.00	229,000.00
负债总计	428,060,237.91	-	-	18,958,166.75	447,018,404.66
利率敏感度缺口	1,158,347,056.49	995,348,616.64	-	-5,966,850.60	2,147,728,822.53
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	1,149,022,005.84	-	-	-	1,149,022,005.84
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,697,093,301.48	1,478,268,468.45	-	-	3,175,361,769.93
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	-	-	-	59,459,822.46	59,459,822.46
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,846,115,307.32	1,478,268,468.45	-	59,459,822.46	4,383,843,598.23
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	609,066,766.39	-	-	-	609,066,766.39
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	956,253.29	956,253.29
应付托管费	-	-	-	318,751.19	318,751.19
应付销售服务费	-	-	-	36,778.65	36,778.65
应付交易费用	-	-	-	59,804.85	59,804.85
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	556,608.72	556,608.72
应付利润	-	-	-	35,205,391.74	35,205,391.74
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	409,000.00	409,000.00
负债总计	609,066,766.39	-	-	37,542,588.44	646,609,354.83
利率敏感度缺口	2,237,048,540.93	1,478,268,468.45	-	21,917,234.02	3,737,234,243.40

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 12 月 31 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）。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 2,080,848,342.50 元，无属于第三层次的余额（上年度末：无属于第一层次的余额，第二层次 3,175,361,769.93 元，无属于第三层次的余额）。

(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。

## § 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	固定收益投资	2,080,848,342.50	80.19
	其中：债券	2,080,848,342.50	80.19
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	199,979,739.97	7.71
	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	300,927,828.57	11.60
4	其他各项资产	12,991,316.15	0.50
5	合计	2,594,747,227.19	100.00

## 8.2 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	10.49	
	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	428,060,237.91	19.93
	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 20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 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	165
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	186
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限（天数）	原因	调整期
1	2019-01-25	186	被动	1

### 8.3.2 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	20.06	19.93
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	5.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	7.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-



	浮动利率债		
5	120 天（含）—397 天（含）	72.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	120.21	19.93

#### 8.4 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。

#### 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	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	949,508,744.06	44.21
	其中：政策性 金融债	949,508,744.06	44.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,131,339,598.44	52.68
8	其他	-	-
9	合计	2,080,848,342.50	96.89
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。

#### 8.6 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	190211	19 国开 11	4,800,000	479,606,167.97	22.33
2	111909421	19 浦发银行 CD421	3,200,000	311,333,902.92	14.50
3	190405	19 农发 05	2,000,000	199,847,238.18	9.31
4	190206	19 国开 06	1,700,000	170,050,811.90	7.92

5	111913114	19 浙商银行 CD114	1,300,000	128,487,201.21	5.98
6	190201	19 国开 01	1,000,000	100,004,526.01	4.66
7	111909015	19 浦发银行 CD015	1,000,000	99,823,818.88	4.65
8	111915535	19 民生银行 CD535	1,000,000	97,407,038.96	4.54
9	111912120	19 北京银行 CD120	700,000	68,045,893.34	3.17
10	111986310	19 长沙银行 CD170	500,000	49,763,063.11	2.32

### 8.7 “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	0.2162%
报告期内偏离度的最低值	-0.0473%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0913%

#### 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%。

### 8.8 期末按摊余成本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

无。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 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 1.00 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，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

#### 8.9.2 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。

#### 8.9.3 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	12,991,316.15
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	12,991,316.15

## § 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 定期 宝 6 个月 理财 债券 A	1,215	10,874.76	-	-	13,212,836.65	100.00
嘉实 定期 宝 6 个月 理财 债券 B	16	133,407,249.12	2,134,515,985.88	100.00	-	-
合计	1,231	1,744,702.54	2,134,515,985.88	99.38	13,212,836.65	0.62

注：(1) 嘉实定期宝 6 个月理财债券 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定期宝 6 个月理财债券 A 份额占嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 份额占嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 总份额比例；

(2) 嘉实定期宝 6 个月理财债券 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定期宝 6 个月理财债券 B 份额占嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 份额占嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 总份额比例。

## 9.2 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	317,584,173.94	14.79
2	银行类机构	317,271,190.77	14.77
3	银行类机构	215,897,185.96	10.05
4	银行类机构	205,815,002.69	9.58
5	银行类机构	202,940,047.56	9.45
6	银行类机构	105,965,724.97	4.93
7	银行类机构	105,965,717.00	4.93
8	银行类机构	105,080,713.69	4.89
9	银行类机构	101,470,023.43	4.72
10	银行类机构	101,382,119.15	4.72

## 9.3 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	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	53,924.00	0.41
	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B	-	-
	合计	53,924.00	0.00

## 9.4 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	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	0
	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	0~10
	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B
基金合同生效日	1,495,483,485.49	463,556,463.50

(2017 年 3 月 23 日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份 额总额	29,284,503.79	3,707,949,739.61
本报告期基金总申购 份额	708,579.13	527,039,657.17
减:本报告期基金总 赎回份额	16,780,246.27	2,100,473,410.90
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	13,212,836.65	2,134,515,985.88

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投。

## § 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

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 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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 100,000.00 元，该审计机构已连续 3 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

#### 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	
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

东吴证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
广发证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

华创证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	6	-	-	-	-	新增 2 个
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	新增 1 个
申万宏源证 券有限公司	3	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增
西南证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-



浙商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	5	-	-	-	-	新增 2 个
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有 限公司	1	-	-	-	-	新增
中泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	7	-	-	-	-	新增 2 个
中银国际证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

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. 中国中投证券有限责任公司更名为中国中金财富证券有限公司。

### 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
兴业证券股份有限公司	-	-	220,000,000.00	100.00%	-	-

### 11.8 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%。

### 11.9 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	嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金恢复申购业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 01 月 29 日
2	嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金暂停申购业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 01 月 30 日
3	嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金恢复申购业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 03 月 11 日
4	嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金暂停申购业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 03 月 14 日
5	嘉实基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞等为嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 代销机构的公告	上海证券报、管理人网站	2019 年 03 月 21 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金基金合同》；

- (3) 《嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实定期宝 6 个月理财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) 报告期内嘉实定期宝 6 个月理财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 E-mail: [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 04 月 08 日