

# 嘉实稳健开放式证券投资基金 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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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 .....	5
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 .....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
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 .....	12
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 .....	12
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
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 .....	14
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
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 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	46

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	49
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	50
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.12 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
11.4 基金投资策略的改变 .....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
11.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	58
12.3 查阅方式 .....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
基金简称	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 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	2,270,148,258.65 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置，通过基本面分析挖掘行业优势企业，获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率
风险收益特征	中低风险证券投资基金。本基金长期系统性风险控制目标为单位基金资产净值相对于基金业绩基准的 $\beta$ 值保持在 1.0 左右。

### 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 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	134,377,485.00	-101,731,782.44	241,963,772.66
本期利润	826,170,464.09	-743,337,052.15	737,947,316.06
加权平均基金份额本期利润	0.3352	-0.2776	0.2334
本期加权平均净值利润率	27.64%	-23.78%	20.00%
本期基金份额净值增长率	32.48%	-21.67%	22.00%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	1,898,241,680.41	1,350,131,325.88	2,331,941,297.88
期末可供分配基金份额利润	0.8362	0.5187	0.8092
期末基金资产净值	3,047,271,046.51	2,636,613,334.24	3,756,131,727.17
期末基金份额净值	1.342	1.013	1.303
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	414.94%	288.70%	396.23%

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）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；（3）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

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	7.02%	0.56%	4.87%	0.44%	2.15%	0.12%

过去六个月	8.14%	0.67%	5.42%	0.51%	2.72%	0.16%
过去一年	32.48%	0.96%	23.45%	0.74%	9.03%	0.22%
过去三年	26.60%	0.92%	23.27%	0.67%	3.33%	0.25%
过去五年	47.01%	1.32%	25.99%	1.15%	21.02%	0.17%
自基金合同 生效起至今	414.94%	1.22%	300.03%	1.56%	114.91%	-0.34%

注：本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 200(大盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

巨潮大盘指数的总市值相对于 A 股市场覆盖率约为 52%，具有良好的市场代表性，用以反映 A 股市场大盘市值股票的运行情况，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

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

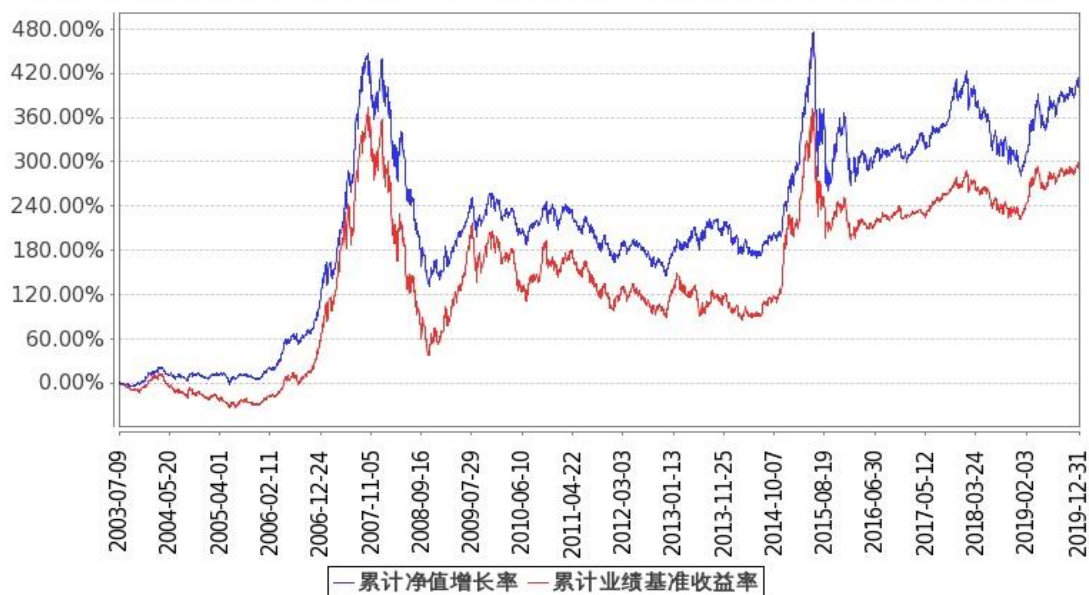
$$\text{Return}(t)=60\%*(\text{巨潮 } 200(\text{大盘}) \text{ 指数}(t)/\text{巨潮 } 200(\text{大盘}) \text{ 指数}(t-1)-1)+40%*(\text{中国债券总指数}(t)/\text{中国债券总指数}(t-1)-1)$$

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

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

嘉实稳健混合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：嘉实稳健混合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

(2003 年 7 月 9 日至 2019 年 12 月 31 日)

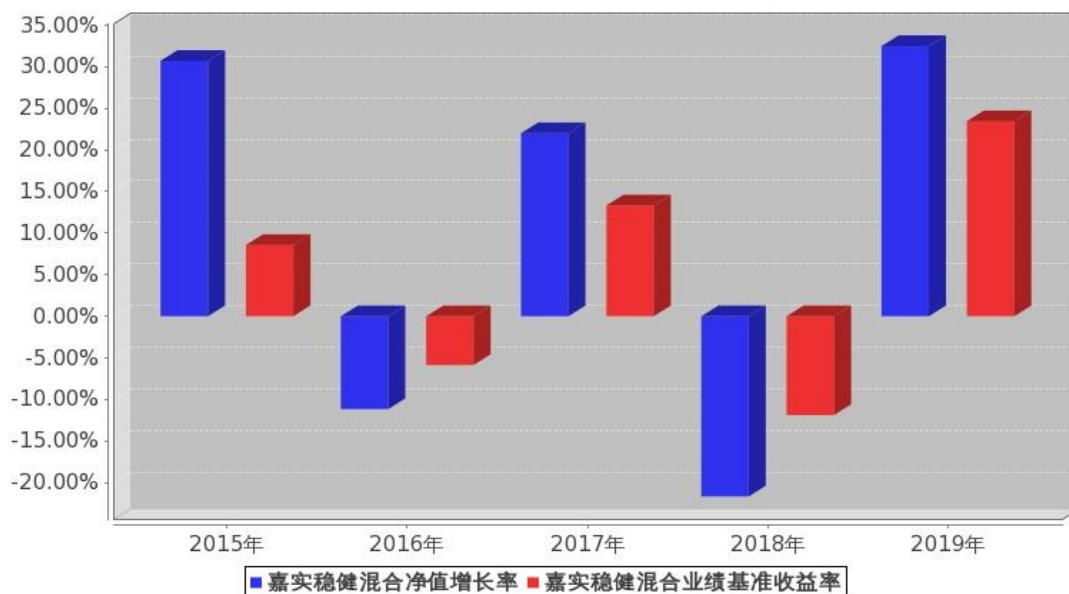
注：1. 按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同第三部分（四（一）1、（2）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（5）本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

2. 2019 年 8 月 1 日，本基金管理人发布《关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告》，归凯先生不再担任本基金基金经理职务。



### 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

嘉实稳健混合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

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
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	0.1000	11,894,993.34	16,512,424.39	28,407,417.73	-
2017 年	-	-	-	-	-
合计	0.1000	11,894,993.34	16,512,424.39	28,407,417.73	-

## § 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		
张淼	本基金、嘉实先进制造股票基金经理	2015年2月17日	-	14年	曾就职于东方基金管理有限公司研究部。2007年9月加入嘉实基金管理有限公司，先后担任研究员、研究部副总监和基金经理助理职务。硕士研究生，具有基金从业资格。
归凯	本基金、嘉实增长混合、嘉实泰和混合、嘉实新兴产业股票基金经理	2018年7月18日	2019年8月1日	13年	曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014年5月加入嘉实基金管理有限公司，任机构投资部投资经理一职。

注：（1）任职日期、离任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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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 年中国宏观经济在财政、货币、产业政策等多方作用下平稳略下行，经济结构一直处于

转型之中，市场流动性比较充裕，中美贸易战反反复复，对资本市场也是带来诸多波动，但常态化之后，市场逐步寻求确定性的结构化方向，受益于消费升级以及制造升级的板块全年表现靓丽，电子、食品饮料、家电、计算机等板块涨幅居前，钢铁、建筑装饰、公用事业板块涨幅居后。

我们一直看好中国在教育结构转变、工程师红利等背景下消费升级和制造升级的大机会，在某些细分领域，中国企业的技术已经逐渐接近全球先进水平，开始进入全球供应链，同时我们也看到过去几年，中国经济一直在转型，消费已经成为经济增长的主要贡献者。因此我们在大市值公司中，优选了食品饮料、家电、电子、通信等行业的公司进行配置，为组合带来较好回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.342 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.48%，业绩比较基准收益率为 23.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看疫情对经济和市场肯定有影响，但影响的只是节奏，不改中长期趋势。中长期来看，全球范围内负利率环境持续深化高成长企业愈发稀缺，而国内新一轮政策红利期的开启将带来资本市场改革和开放活力的加速释放，A 股市场与权益投资正在发生深刻变化，地产调控+信用刚兑打破+利率长期中枢下行的趋势将提高 A 股在大类资产中的夏普比。这将吸引海外资金和国内财富进一步增大股票市场的投资，我们正在逐步进入一个配置力量深化的时代，而新旧动能转化过程中投资的核心逻辑将继续从总量转向结构。

中国宏观经济可能较长时间内中低水平增长，增速很难再回升，宏观政策全力求稳为资本市场提供了较为友好的政策环境，在此背景下，仍然会有一些快速成长的细分行业和优质上市公司。货币政策主动收紧概率较低，预计全年维度看流动性整体保持合理充裕，匹配信贷和社融总量稳健投放，但边际上宽松力量将弱于 19 年。股市资金监管周期性回归中性，海外资金+保险资金预计继续成为市场增量来源，市场活跃度仍然具备。我们依然看好在消费升级和制造升级背景下给资本市场带来的投资机会，未来仍然会聚焦这两个领域，积极寻找护城河较高、有望持续成长的优质龙头公司。

#### 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

(1) 报告期内基金未实施利润分配。

(2) 本基金的基金管理人于 2020 年 1 月 15 日发布《嘉实稳健开放式证券投资基金 2019 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2019 年 12 月 31 日，每 10 份基金份额发放现金红利 0.1000 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。

#### 4.9 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”）在嘉实稳健开放式证券投资基金（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、基金份额申购赎回价格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

安永华明（2020）审字第 60468756\_A04 号

嘉实稳健开放式证券投资基金

嘉实稳健开放式证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 一、审计意见

我们审计了嘉实稳健开放式证券投资基金的财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表，2019 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的嘉实稳健开放式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实稳健开放式证券投资基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实稳健开放式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

### 三、其他信息

嘉实稳健开放式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 四、管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估嘉实稳健开放式证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督嘉实稳健开放式证券投资基金的财务报告过程。

### 五、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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 评价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。

(4) 对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，就可能导致对嘉实稳健开放式证券投资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稳健开放式证券投



资基金不能持续经营。

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

我们与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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师 王珊珊

中国注册会计师 王海彦

中国 北京

2020 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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	196,291,743.06	82,935,590.22
结算备付金		1,891,272.62	730,938.06
存出保证金		320,656.69	365,578.33
交易性金融资产	7.4.7.2	2,853,174,232.60	2,207,591,112.97
其中：股票投资		2,196,668,232.60	1,610,681,963.17
基金投资		-	-
债券投资		656,506,000.00	596,909,149.80
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	-	349,959,644.94
应收证券清算款		-	28,263,217.54
应收利息	7.4.7.5	12,283,942.27	11,936,465.12
应收股利		-	-
应收申购款		180,123.28	102,559.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,064,141,970.52	2,681,885,106.98
<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		-	-
应付证券清算款		-	39,482,038.83
应付赎回款		11,411,486.61	861,561.53
应付管理人报酬		3,822,785.08	3,452,764.68
应付托管费		637,130.88	575,460.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	625,370.94	449,533.12
应交税费		-	8.55
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	374,150.50	450,405.23
负债合计		16,870,924.01	45,271,772.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,121,933,789.47	1,286,482,008.36
未分配利润	7.4.7.10	1,925,337,257.04	1,350,131,325.88
所有者权益合计		3,047,271,046.51	2,636,613,334.24
负债和所有者权益总计		3,064,141,970.52	2,681,885,106.98

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.342 元，基金份额总额 2,270,148,258.65 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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	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
一、收入		884,380,769.64	-681,897,145.48
1. 利息收入		23,417,784.50	30,435,670.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,465,689.24	1,672,901.42
债券利息收入		21,873,964.88	28,348,302.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		78,130.38	414,466.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		169,091,022.33	-70,785,007.78

填列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	133,011,495.53	-104,642,293.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,073,098.70	9,669.90
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	37,152,625.50	33,847,615.89
3. 公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	7.4.7.16	691,792,979.09	-641,605,269.71
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	78,983.72	57,461.23
减：二、费用		58,210,305.55	61,439,906.67
1. 管理人报酬		44,772,440.89	46,975,167.28
2. 托管费		7,462,073.54	7,829,194.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	5,800,224.58	6,376,210.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		2.93	3.21
7. 其他费用	7.4.7.19	175,563.61	259,331.10
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		826,170,464.09	-743,337,052.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		826,170,464.09	-743,337,052.15

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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)	1,286,482,008.36	1,350,131,325.88	2,636,613,334.24
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期	-	826,170,464.09	826,170,464.09

利润)			
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)	-164,548,218.89	-250,964,532.93	-415,512,751.82
其中: 1. 基金申购款	27,612,431.51	39,913,055.48	67,525,486.99
2. 基金赎回款	-192,160,650.40	-290,877,588.41	-483,038,238.81
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,121,933,789.47	1,925,337,257.04	3,047,271,046.51
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)	1,424,190,429.29	2,331,941,297.88	3,756,131,727.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-743,337,052.15	-743,337,052.15
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)	-137,708,420.93	-210,065,502.12	-347,773,923.05
其中: 1. 基金申购款	42,097,442.80	60,376,297.45	102,473,740.25
2. 基金赎回款	-179,805,863.73	-270,441,799.57	-450,247,663.30
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)	-	-28,407,417.73	-28,407,417.73
五、期末所有者权益(基金净值)	1,286,482,008.36	1,350,131,325.88	2,636,613,334.24

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：

<u>经雷</u>	<u>罗丽丽</u>	<u>罗丽丽</u>
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

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]67 号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，嘉实理财通系列开放式证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)和嘉实债券开放式证券投资基金，基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 1,030,248,511.17 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构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。

本基金于 2007 年 5 月 30 日进行了基金份额拆分操作，当日本基金拆分前基金份额净值为人民币 2.024 元，本基金管理人按照 1:2.023867075 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。拆分后，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.023867075 份。本基金于 2007 年 5 月 31 日进行了变更登记。

本基金限于投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场前 50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司股票，投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%；债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。本基金的业绩比较基准为：60%\*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下统称“企业会计准则”)编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第

2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

##### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允

价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

#### (5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；



(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式或再投资方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利发放日前一工作日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，未选择分红方式的基金份额持有人的分红方式为现金红利；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3) 基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(4) 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(5) 如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

(6) 基金收益分配比例按照有关规定执行；

(7) 在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；年度分配在基金会计年度结束后四个月内完成；

法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行

和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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	196,291,743.06	82,935,590.22
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月及以上	-	-
其他存款	-	-
合计	196,291,743.06	82,935,590.22

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			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	1,689,438,982.47	2,196,668,232.60	507,229,250.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	651,949,368.80	656,506,000.00	4,556,631.20
	合计	651,949,368.80	656,506,000.00	4,556,631.20
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	2,341,388,351.27	2,853,174,232.60	511,785,881.33	

项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,795,105,571.93	1,610,681,963.17	-184,423,608.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	89,149.80	-3,850.20
	银行间市场	592,399,638.80	4,420,361.20
	合计	592,492,638.80	4,416,511.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,387,598,210.73	2,207,591,112.97	-180,007,097.76

#### 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	-	-
合计	-	-
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	349,959,644.94	-
合计	349,959,644.94	-

##### 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	上年度末

	2019 年 12 月 31 日	2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	31,392.25	48,381.78
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	851.00	328.90
应收债券利息	12,251,553.98	11,552,547.58
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	335,039.70
应收申购款利息	0.74	2.66
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	144.30	164.50
合计	12,283,942.27	11,936,465.12

#### 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	625,370.94	447,993.18
银行间市场应付交易费用	-	1,539.94
合计	625,370.94	449,533.12

#### 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	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	4,150.50	405.23
应付证券出借违约金	-	-
其他	-	-
预提费用	120,000.00	200,000.00
应付指数使用费	-	-
应付替代款	-	-
可退替代款	-	-
合计	374,150.50	450,405.23

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

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	2,603,098,180.16	1,286,482,008.36
本期申购	55,870,595.74	27,612,431.51
本期赎回（以“-”号填列）	-388,820,517.25	-192,160,650.40
本期末	2,270,148,258.65	1,121,933,789.47

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,033,344,545.70	-683,213,219.82	1,350,131,325.88
本期利润	134,377,485.00	691,792,979.09	826,170,464.09
本期基金份额交易产生的变动数	-269,480,350.29	18,515,817.36	-250,964,532.93
其中：基金申购款	44,668,561.32	-4,755,505.84	39,913,055.48
基金赎回款	-314,148,911.61	23,271,323.20	-290,877,588.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,898,241,680.41	27,095,576.63	1,925,337,257.04

#### 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	1,433,762.73	1,628,956.44
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	26,124.33	38,049.51
其他	5,802.18	5,895.47
合计	1,465,689.24	1,672,901.42

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	2,322,902,439.60	2,608,988,723.58
减：卖出股票成本总额	2,189,890,944.07	2,713,631,017.15
买卖股票差价收入	133,011,495.53	-104,642,293.57

#### 7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	301,277,259.39	714,417,695.65
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	291,198,450.00	689,916,830.10
减：应收利息总额	11,151,908.09	24,491,195.65
买卖债券差价收入	-1,073,098.70	9,669.90

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	37,152,625.50	33,847,615.89
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	37,152,625.50	33,847,615.89

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	691,792,979.09	-641,605,269.71
股票投资	691,652,858.89	-653,642,489.51
债券投资	140,120.20	12,037,219.80
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	691,792,979.09	-641,605,269.71

## 7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	73,031.77	52,375.47
基金转出费收入	5,951.95	5,085.76
债券认购手续费返还	-	-
印花税手续费返还	-	-
其他	-	-
合计	78,983.72	57,461.23

## 7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	5,798,500.33	6,373,710.49
银行间市场交易费用	1,724.25	2,500.00
合计	5,800,224.58	6,376,210.49

## 7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	40,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	18,363.61	22,131.10
上市年费	-	-
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
指数使用费	-	-
红利手续费	-	-
其他	1,200.00	1,200.00
合计	175,563.61	259,331.10

## 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

2020 年 1 月 15 日，本基金管理人发布《嘉实稳健开放式证券投资基金 2019 年年度收益分配公告》，收益分配基准日为 2019 年 12 月 31 日，权益登记日、除息日为 2020 年 1 月 16 日，红利发放日为 2020 年 1 月 17 日，收益分配方案为每 10 份基金份额派发现金红利 0.1000 元。

### 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	基金管理人股东
立信投资有限责任公司	基金管理人股东
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人股东

### 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	44,772,440.89	46,975,167.28
其中：支付销售机构的客户维护费	4,915,303.20	5,145,391.10

注：1. 本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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 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托管费	7,462,073.54	7,829,194.59

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

**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**

无。

**7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**7.4.10.5.2 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。

## 7.4.10.6 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		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	
	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	196,291,743.06	1,433,762.73	82,935,590.22	1,628,956.44

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

## 7.4.10.7 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

本期（2019年1月1日至2019年12月31日），本基金未实施利润分配。

2020年1月15日，本基金管理人发布《嘉实稳健开放式证券投资基金2019年年度收益分配公告》，收益分配基准日为2019年12月31日，权益登记日、除息日为2020年1月16日，红利发放日为2020年1月17日，收益分配方案为每10份基金份额派发现金红利0.1000元。

## 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002230	科大讯飞	2019年7月17日	2021年7月19日	非公开发行锁定	27.10	30.38	276,753	7,500,006.30	8,407,756.14	-
002230	科大讯飞	2019年7月17日	2020年7月20日	非公开发行锁定	27.10	32.48	276,753	7,500,006.30	8,988,937.44	-
688088	虹软科技	2019年7月15日	2020年1月22日	科创板新股锁定	28.88	45.75	16,944	489,342.72	775,188.00	-
688389	普门科技	2019年10月29日	2020年5月6日	科创板新股锁定	9.10	13.56	6,931	63,072.10	93,984.36	-
601658	邮储	2019	2020	网下配	5.50	5.71	796,578	4,381,179.00	4,548,460.38	-

	银行	年 12 月 2 日	年 6 月 10 日	售新股 锁定						
688166	博瑞医药	2019 年 10 月 29 日	2020 年 5 月 8 日	科创板 新股锁 定	12.71	25.64	8,041	102,201.11	206,171.24	-
688368	晶丰明源	2019 年 9 月 27 日	2020 年 4 月 14 日	科创板 新股锁 定	56.68	75.13	2,557	144,930.76	192,107.41	-
688181	八亿时空	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新发未 上市	43.98	43.98	4,306	189,377.88	189,377.88	-
002973	侨银环保	2019 年 12 月 27 日	2020 年 1 月 6 日	新发未 上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-
688081	兴图新科	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 6 日	新发未 上市	28.21	28.21	3,153	88,946.13	88,946.13	-

注:1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期,最终日期以上上市公司公告为准。

2. 基金持有的股票在流通受限期内,如获得股票红利、送股、转增股、配股的,则该股票的数量和期末成本总额相应调整,新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本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，本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人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本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人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。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

**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**

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	-	-
AAA 以下	-	89,149.80
未评级	-	-
合计	-	89,149.80

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。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。

**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**

无。

**7.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。



### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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。本基金的基金管理人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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	196,291,743.06	-	-	-	196,291,743.06
结算备付金	1,891,272.62	-	-	-	1,891,272.62
存出保证金	320,656.69	-	-	-	320,656.69
交易性金融资产	350,656,000.00	305,850,000.00	-	-2,196,668,232.60	2,853,174,232.60
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	-	-	-	12,283,942.27	12,283,942.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	17,379.78	-	-	162,743.50	180,123.28
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	549,177,052.15	305,850,000.00	-	-2,209,114,918.37	3,064,141,970.52
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,411,486.61	11,411,486.61
应付管理人报酬	-	-	-	3,822,785.08	3,822,785.08
应付托管费	-	-	-	637,130.88	637,130.88
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	625,370.94	625,370.94
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	374,150.50	374,150.50
负债总计	-	-	-	16,870,924.01	16,870,924.01
利率敏感度缺口	549,177,052.15	305,850,000.00	-	-2,192,243,994.36	3,047,271,046.51
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	82,935,590.22	-	-	-	82,935,590.22
结算备付金	730,938.06	-	-	-	730,938.06
存出保证金	365,578.33	-	-	-	365,578.33
交易性金融资产	291,100,000.00	305,809,149.80	-	-1,610,681,963.17	2,207,591,112.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	349,959,644.94	-	-	-	349,959,644.94

应收证券清算款	-	-	-	28,263,217.54	28,263,217.54
应收利息	-	-	-	11,936,465.12	11,936,465.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	5,302.06	-	-	97,257.74	102,559.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	725,097,053.61	305,809,149.80	-	1,650,978,903.57	2,681,885,106.98
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	39,482,038.83	39,482,038.83
应付赎回款	-	-	-	861,561.53	861,561.53
应付管理人报酬	-	-	-	3,452,764.68	3,452,764.68
应付托管费	-	-	-	575,460.80	575,460.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	449,533.12	449,533.12
应付税费	-	-	-	8.55	8.55
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	450,405.23	450,405.23
负债总计	-	-	-	45,271,772.74	45,271,772.74
利率敏感度缺口	725,097,053.61	305,809,149.80	-	-1,605,707,130.83	2,636,613,334.24

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

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,627,729.87	-2,410,872.37
	市场利率下降 25 个基点	1,637,738.90	2,430,697.29

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,196,668,232.60	72.09	1,610,681,963.17	61.09
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,196,668,232.60	72.09	1,610,681,963.17	61.09

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）

分析	业绩比较基准上升 5%	193,492,975.82	172,431,883.48
	业绩比较基准下降 5%	-193,492,975.82	-172,431,883.48

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,173,170,725.58 元，属于第二层次的余额为人民币 680,003,507.02 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次人民币 1,610,720,967.17 元，第二层次人民币 596,870,145.80 元，无属于第三层次的余额）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生转换（上年度：无）。

##### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.3 其他事项

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	权益投资	2,196,668,232.60	71.69
	其中：股票	2,196,668,232.60	71.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	656,506,000.00	21.43
	其中：债券	656,506,000.00	21.43
	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	198,183,015.68	6.47
8	其他各项资产	12,784,722.24	0.42
9	合计	3,064,141,970.52	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	100,001,967.00	3.28
C	制造业	1,026,167,248.84	33.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,094,291.40	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	236,628,608.71	7.77
J	金融业	470,221,236.18	15.43
K	房地产业	159,639,810.00	5.24
L	租赁和商务服务业	118,468,324.35	3.89
M	科学研究和技术服务业	74,298,647.22	2.44
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	141,520.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,196,668,232.60	72.09

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	1,911,700	163,373,882.00	5.36
2	600036	招商银行	4,119,445	154,808,743.10	5.08
3	600519	贵州茅台	110,831	131,113,073.00	4.30

4	601888	中国国旅	1,331,853	118,468,324.35	3.89
5	002475	立讯精密	3,172,740	115,805,010.00	3.80
6	600887	伊利股份	3,604,509	111,523,508.46	3.66
7	000002	万科A	3,147,000	101,270,460.00	3.32
8	000063	中兴通讯	2,839,100	100,475,749.00	3.30
9	601799	星宇股份	973,000	92,415,540.00	3.03
10	601336	新华保险	1,826,982	89,796,165.30	2.95
11	000858	五粮液	654,500	87,055,045.00	2.86
12	600741	华域汽车	3,211,028	83,454,617.72	2.74
13	600406	国电南瑞	3,552,664	75,245,423.52	2.47
14	300012	华测检测	4,983,142	74,298,647.22	2.44
15	601899	紫金矿业	15,953,300	73,225,647.00	2.40
16	600276	恒瑞医药	822,997	72,028,697.44	2.36
17	000651	格力电器	1,082,131	70,966,150.98	2.33
18	300750	宁德时代	618,100	65,765,840.00	2.16
19	300036	超图软件	3,220,800	64,190,544.00	2.11
20	000725	京东方A	14,043,400	63,757,036.00	2.09
21	600048	保利地产	3,607,500	58,369,350.00	1.92
22	601166	兴业银行	2,812,800	55,693,440.00	1.83
23	300369	绿盟科技	2,264,000	41,023,680.00	1.35
24	002912	中新赛克	276,800	34,876,800.00	1.14
25	600585	海螺水泥	500,000	27,400,000.00	0.90
26	601808	中海油服	1,394,600	26,776,320.00	0.88
27	002230	科大讯飞	553,506	17,396,693.58	0.57
28	000963	华东医药	454,972	11,092,217.36	0.36
29	601658	邮储银行	1,137,968	6,549,005.78	0.21
30	002415	海康威视	92,443	3,026,583.82	0.10
31	688111	金山办公	14,659	2,402,610.10	0.08
32	688088	虹软科技	16,944	775,188.00	0.03
33	688023	安恒信息	2,728	381,920.00	0.01
34	688268	华特气体	5,216	228,721.60	0.01
35	688089	嘉必优	5,546	206,422.12	0.01
36	688166	博瑞医药	8,041	206,171.24	0.01
37	688368	晶丰明源	2,557	192,107.41	0.01
38	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.01
39	688078	龙软科技	2,811	143,642.10	0.00
40	603882	金域医学	2,763	141,520.86	0.00
41	603501	韦尔股份	829	118,878.60	0.00
42	688357	建龙微纳	2,332	110,700.04	0.00
43	688310	迈得医疗	3,276	94,905.72	0.00
44	688389	普门科技	6,931	93,984.36	0.00
45	688081	兴图新科	3,153	88,946.13	0.00

46	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
47	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
48	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00
49	600600	青岛啤酒	52	2,652.00	0.00
50	600511	国药股份	76	2,074.04	0.00

#### 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%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	108,760,612.69	4.13
2	002475	立讯精密	98,895,567.43	3.75
3	601336	新华保险	76,709,654.55	2.91
4	601799	星宇股份	76,309,988.00	2.89
5	600600	青岛啤酒	76,182,629.82	2.89
6	000858	五粮液	75,942,753.61	2.88
7	600703	三安光电	75,711,997.17	2.87
8	600741	华域汽车	74,965,621.22	2.84
9	600406	国电南瑞	74,260,331.56	2.82
10	300036	超图软件	73,093,872.19	2.77
11	600030	中信证券	72,011,827.61	2.73
12	600519	贵州茅台	71,773,609.60	2.72
13	601211	国泰君安	70,498,565.18	2.67
14	002415	海康威视	70,021,729.28	2.66
15	601688	华泰证券	66,009,786.30	2.50
16	000401	冀东水泥	64,128,756.42	2.43
17	600276	恒瑞医药	57,893,193.42	2.20
18	601166	兴业银行	54,674,290.02	2.07
19	000725	京东方A	53,608,664.00	2.03
20	600048	保利地产	53,420,058.00	2.03

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000963	华东医药	111,062,399.21	4.21
2	002415	海康威视	87,235,542.93	3.31
3	601088	中国神华	84,648,690.11	3.21
4	601933	永辉超市	79,311,855.69	3.01
5	600600	青岛啤酒	79,233,769.71	3.01
6	000401	冀东水泥	79,081,710.20	3.00
7	601336	新华保险	79,064,746.20	3.00
8	600030	中信证券	77,511,491.30	2.94



9	000651	格力电器	76,264,404.32	2.89
10	001979	招商蛇口	74,973,168.91	2.84
11	600703	三安光电	72,189,868.11	2.74
12	300012	华测检测	70,376,655.38	2.67
13	601688	华泰证券	70,371,819.40	2.67
14	601211	国泰君安	70,082,289.78	2.66
15	600872	中炬高新	69,636,808.47	2.64
16	600036	招商银行	63,887,757.57	2.42
17	002475	立讯精密	60,056,178.08	2.28
18	601111	中国国航	56,616,946.30	2.15
19	601155	新城控股	54,089,035.23	2.05
20	601398	工商银行	52,819,137.00	2.00

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,084,224,354.61
卖出股票收入（成交）总额	2,322,902,439.60

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	203,560,000.00	6.68
2	央行票据	-	-
3	金融债券	452,946,000.00	14.86
	其中：政策性金融债	452,946,000.00	14.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	656,506,000.00	21.54

#### 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	120009	12 付息国债 09	2,000,000	203,560,000.00	6.68
2	190304	19 进出 04	1,500,000	150,255,000.00	4.93
3	110208	11 国开 08	1,000,000	102,290,000.00	3.36

4	190201	19 国开 01	900,000	90,027,000.00	2.95
5	190301	19 进出 01	600,000	60,024,000.00	1.97

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细  
无。

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  
无。

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  
无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
无。

## 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	320,656.69
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,283,942.27
5	应收申购款	180,123.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,784,722.24

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
无。

## § 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

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 (%)
154,002	14,741.03	7,164,008.25	0.32	2,262,984,250.40	99.68

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.91	0.00

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2003 年 7 月 9 日) 基 金份额总额	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	2,603,098,180.16
本报告期基金总申购份额	55,870,595.74
减：本报告期基金总赎回份额	388,820,517.25
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	2,270,148,258.65

注：报告期间基金总申购份额含转换入份额，基金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

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。

2019 年 8 月 1 日本基金管理人发布《关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告》，归凯先生不再担任基金经理职务，由张淼女士单独管理本基金。

#### (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。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 80,000.00 元，该审计机构已连续 17 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	
中信证券股	7	599,453,819.22	13.73%	418,679.88	13.89%	新增 2

份有限公司						个
华创证券有 限责任公司	2	414,217,581.06	9.48%	289,953.55	9.62%	-
方正证券股 份有限公司	5	359,568,239.43	8.23%	251,699.34	8.35%	-
中国国际金 融股份有限 公司	5	321,372,590.23	7.36%	202,886.77	6.73%	新增 2 个
光大证券股 份有限公司	2	317,352,823.03	7.27%	222,146.97	7.37%	新增 1 个
广发证券股 份有限公司	4	289,046,570.47	6.62%	202,333.05	6.71%	-
东兴证券股 份有限公司	1	279,621,291.04	6.40%	195,734.90	6.49%	-
西南证券股 份有限公司	2	237,753,413.65	5.44%	150,096.70	4.98%	-
新时代证券 股份有限公 司	2	210,476,831.17	4.82%	144,331.33	4.79%	-
华泰证券股 份有限公司	6	196,969,504.36	4.51%	137,878.66	4.57%	新增 2 个
中信建投证 券股份有限 公司	4	181,898,369.03	4.16%	127,329.28	4.22%	-
民生证券股 份有限公司	2	166,861,310.58	3.82%	116,804.04	3.87%	-
国元证券股 份有限公司	1	160,666,222.18	3.68%	112,466.36	3.73%	-
海通证券股	2	147,010,824.47	3.37%	102,908.83	3.41%	-

份有限公司						
招商证券股 份有限公司	2	144,232,948.14	3.30%	100,964.22	3.35%	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	96,784,504.16	2.22%	67,750.55	2.25%	-
瑞银证券有 限责任公司	2	94,842,002.83	2.17%	66,389.41	2.20%	新增 1 个
安信证券股 份有限公司	3	54,804,863.73	1.25%	38,363.40	1.27%	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	54,674,290.02	1.25%	38,272.00	1.27%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	4	30,265,705.05	0.69%	21,186.27	0.70%	-
申万宏源证 券有限公司	3	9,728,288.57	0.22%	6,809.80	0.23%	-
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
天源证券经 纪有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增
湘财证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	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
华创证券有限责任公司	126,259.39	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 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	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及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01月04日
2	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2019年01月28日
3	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	上海证券报、管理人网站	2019年03月08日
4	关于增加青岛农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019年03月26日
5	关于旗下基金投资科大讯飞非公开发行股票的公告	上海证券报、管理人网站	2019年07月18日
6	关于增加海银基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2019年07月23日
7	关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告	上海证券报、管理人网站	2019年08月01日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实理财通系列开放式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。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 04 月 08 日