

# 嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2020 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5 托管人报告	15
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 债券回购融资情况	36
7.3 基金投资组合平均剩余期限	37
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	38
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	39

7.9 投资组合报告附注.....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	41
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>41</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	42
10.4 基金投资策略的改变.....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>44</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

## 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实理财宝 7 天债券	
基金主代码	070035	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 8 月 29 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,078,036,049.90 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码	070035	070036
报告期末下属分级基金的份 额总额	19,677,202.79 份	7,058,358,847.11 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	根据宏观经济指标决定组合的平均剩余期限（长/中/短）和比例分布，根据各类资产的流动性特征决定组合中各类资产的投资比例，根据各类资产的信用等级及担保状况，决定组合的风险级别；根据明细资产的剩余期限、资信等级、流动性指标以及个别债券的收益率与剩余期限的配比等指标进行投资。
业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95599
传真	(010)65215588	010-68121816
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼	北京东城区建国门内大街 69 号

	09-14 单元	
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号 凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100005	100031
法定代表人	经雷	周慕冰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
本期已实现收益	216,317.50	113,102,175.76
本期利润	216,317.50	113,102,175.76
本期净值收益率	1.0722%	1.2180%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
期末基金资产净值	19,677,202.79	7,058,358,847.11
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
累计净值收益率	31.4368%	34.4579%

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；（2）嘉实理财宝 7 天债券 A 与嘉实理财宝 7 天债券 B 适用不同的销售服务费率；（3）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用；（4）本基金收益在基金份额“7 天持有周期到期日”集中结转

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实理财宝 7 天债券 A

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1201%	0.0005%	0.1110%	0.0000%	0.0091%	0.0005%
过去三个月	0.4351%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.0985%	0.0010%
过去六个月	1.0722%	0.0014%	0.6732%	0.0000%	0.3990%	0.0014%
过去一年	2.3057%	0.0012%	1.3537%	0.0000%	0.9520%	0.0012%
过去三年	9.0432%	0.0025%	4.0537%	0.0000%	4.9895%	0.0025%
自基金合同生 效起至今	31.4368%	0.0538%	10.5892%	0.0000%	20.8476%	0.0538%

嘉实理财宝 7 天债券 B

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1439%	0.0005%	0.1110%	0.0000%	0.0329%	0.0005%
过去三个月	0.5076%	0.0010%	0.3366%	0.0000%	0.1710%	0.0010%
过去六个月	1.2180%	0.0014%	0.6732%	0.0000%	0.5448%	0.0014%
过去一年	2.6032%	0.0012%	1.3537%	0.0000%	1.2495%	0.0012%
过去三年	9.9961%	0.0025%	4.0537%	0.0000%	5.9424%	0.0025%
自基金合同生 效起至今	34.4579%	0.0538%	10.5892%	0.0000%	23.8687%	0.0538%

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

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

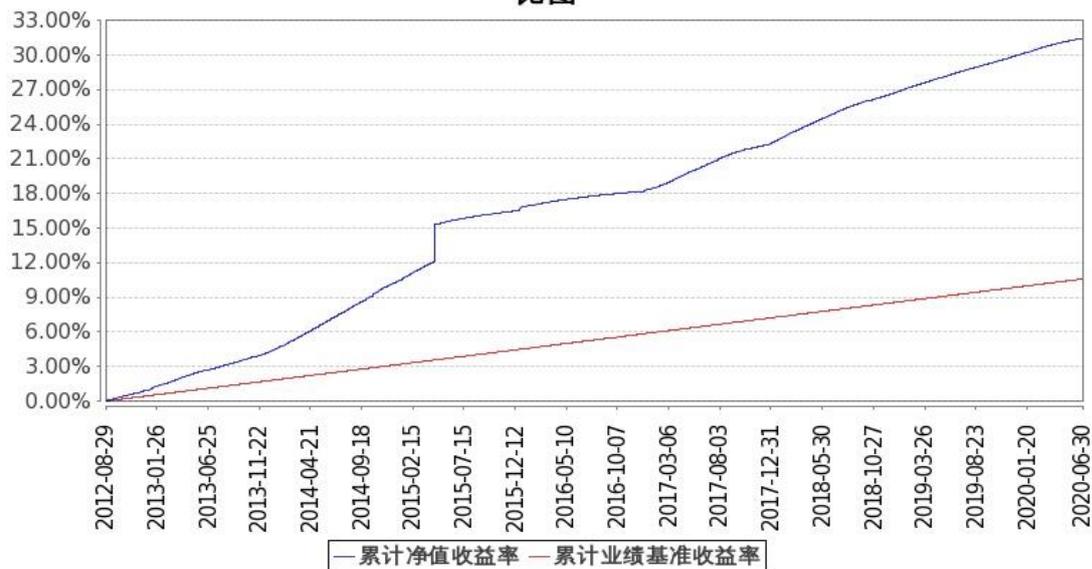


图 1: 嘉实理财宝 7 天债券 A 基金份额累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 8 月 29 日至 2020 年 6 月 30 日)

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

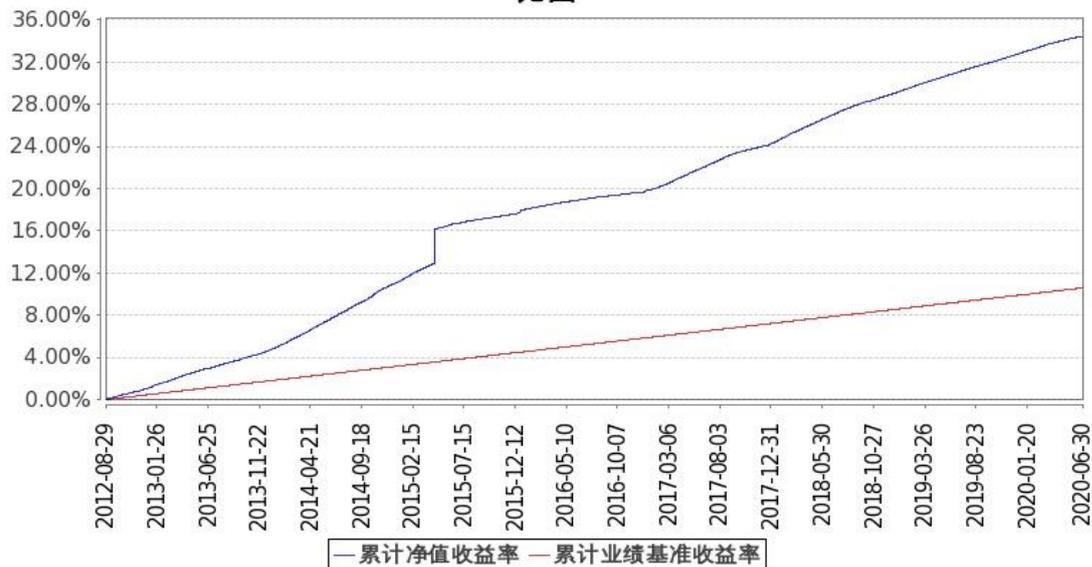


图 2: 嘉实理财宝 7 天债券 B 基金份额累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 8 月 29 日至 2020 年 6 月 30 日)

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2020 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 190 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、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王茜	本基金、嘉实多元	2018 年 11 月 2-		17 年	曾任武汉市商业银行

	债券、嘉实多利分级债券、嘉实新起点混合、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实鑫和一年持有期混合基金经理	日			信贷资金管理部总经理助理，中信证券固定收益部，长盛基金管理有限公司基金经理。2008 年 11 月加盟嘉实基金管理有限公司，现任固定收益业务体系配置策略组组长。工商管理硕士，具有基金从业资格。
张文玥	本基金、嘉实安心货币、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、嘉实增益宝货币、嘉实融享货币基金经理	2014 年 8 月 13 日		12 年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士，具有基金从业资格。
李金灿	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实宝、嘉实薪金宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券、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、嘉实融享货币、嘉实汇鑫中短债债券基金经理	2016 年 7 月 23 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。

注：（1）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、《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，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 1 次，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

2020 年上半年，央行主导下货币政策保持稳健，货币市场收益率波动性保持低位，债券市场利率整体下行。宏观经济数据显示，整体经济增长受疫情扩散蔓延的不利影响，叠加外部环境发生明显变化及需求端“几碰头”等因素影响出现明显下行压力，央行加大了逆周期调节力度。从国际上看，受疫情影响，国际金融市场动荡加剧，对我国金融市场造成一定影响，主要发达经济体增长有所放缓。美国经济增长出现衰退风险，PMI 开始收缩，失业人数急剧增加，美联储紧急降息至零，推出大力度量化宽松，宣布无限额买资产。OECD 下调 2020 年全球经济增速，IMF 和国际金融协会预计今年全球经济将萎缩。海外疫情给我国出口带来较大不确定性，国内房地产、汽车等传统支柱产业进入调整期，消费增长相对乏力，经济内生增长动力不强。国内政策要进一步加大财政货币政策调节力度，采取多方面措施，着力扩内需、助复产、保就业，帮助各类企业尤其是中小微企业、外贸企业、个体工商户渡过特殊难关，保障基本民生。央行更加注重货币政策执行的前瞻性、针对性和灵活性，稳健的货币政策要更加灵活适度，引导贷款市场利率下行，保持流动性合理充裕，保持物价水平总体稳定，根据经济和市场运行情况，运用公开市场操作和各类创新工具对市场资金面进行预调微调。

今年上半年，央行实施了三次降准，并通过再贷款、再贴现、中期借贷便利等操作，提供中长期流动性支持，及时设立 3000 亿元的专项再贷款和增加 5000 亿元的再贷款再贴现额度，和 1 万亿美元的普惠性再贷款，直达实体的货币政策创新等，有力精准地支持疫情防控和复工复产。价格方面，央行两次下调再贷款利率共 50BP，下调再贴现利率 25BP，逆回购和 MLF 操作利率降息 30BP，1 年期 LPR 利率下降 30BP，下调超额准备金利率等，引导利率下行。央行通过结构性降息支持实

体经济发展，稳定房地产市场的预期，防止再次出现房地产价格泡沫。预计今年下半年货币政策会相机抉择，随着形势的变化而微调。未来面临内外因素交织的局面下，资金面在表面平稳的环境下，依然存在多重不确定因素。

今年上半年银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 1.52%和 2.04%，较去年下半年均值 2.32%和 2.70%大幅下行。上半年债券市场收益率整体下行，2 季末 1 年期和 10 年期国开债收益率分别收于 2.19%和 3.10%，较去年 4 季度末 2.50%和 3.58%大幅下行。上半年信用债市场在资金宽松和估值下行推动下，收益率也跟随利率债下行。2 季末 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率由去年 4 季度末的 3.18%降至 2.73%，同期中等级别的 AA+级短融收益率则由 3.28%下行至 2.91%。

2020 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务；灵活配置逆回购、银行存单、债券和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制银行存款和债券资产配置比例，组合保持中性久期，在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险；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，上半年本基金成功应对了市场和规模波动，投资业绩平稳，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期嘉实理财宝 7 天债券 A 的基金份额净值收益率为 1.0722%，嘉实理财宝 7 天债券 B 的基金份额净值收益率为 1.2180%，业绩比较基准收益率为 0.6732%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际货币基金组织（IMF）6 月 24 日发布《世界经济展望报告》更新内容，预计 2020 年全球经济将萎缩 4.9%，较 4 月份报告下调 1.9 个百分点。IMF 在报告中说，新冠疫情及防控措施对全球经济的负面冲击超出预期，对低收入家庭的影响尤其严重。同时，全球经济复苏进程也较预期更为缓慢。基于下半年继续保持社交距离、经济创伤加剧、企业增加卫生安全措施以及金融环境保持现状等基准假设，IMF 预计全球经济今年将萎缩 4.9%，但有望在 2021 年增长 5.4%。具体来看，报告预计今年发达经济体经济将萎缩 8%，新兴市场和发展中经济体将萎缩 3%，分别较 4 月份下调 1.9 个百分点和 2 个百分点。其中，美国经济将萎缩 8%，欧元区经济将萎缩 10.2%，日本经济将萎缩 5.8%，均低于 4 月份预测。

国内经济随着前期多重政策叠加执行，基本面处于环比改善的通道，房地产销售已恢复到去年同期水平，基建投资预计在二季度财政明显发力的影响下三季度会在增速上得以体现，制造业投资和消费虽然复苏迟缓，但环比改善也具有较强的确定性。进入到四季度，经济继续改善的动

能将明显受到财政空间遏制，即本轮经济的环比复苏存在上限，同时受疫情防控常态化的影响以及就业压力对收入增速和消费意愿的滞后影响，消费和制造业投资增速年内都将保持低位，四季度经济环比改善将明显弱化。

2020 年上半年共有 71 只债券违约，涉及金额 875.37 亿元，同比去年上升 45.98%，新增违约主体 11 家，主要涉及民营企业以及少部分地方、中央国有企业，违约的债券类别主要是超短期融资券、中期票据、公司债和企业债等。违约原因主要是由于新冠疫情的影响，部分公司的生产经营活动受到了冲击，当前的资金流动性紧张，信用风险仍在持续暴露。

今年以来，货币政策节奏变化较明显，央行一季度货币政策应对疫情，整体宽松；央行货币政策二季度随着疫情稳定和复工复产逐步推进，整体“适度”。央行行长易纲 6 月 18 日在第 12 届陆家嘴论坛上表示，疫情应对期间的金融支持政策是阶段性的，要注意激励约束相融，关注政策后遗症，保持总量适度，并提前考虑相关工具的适时退出。央行下半年货币政策基调延续稳健，但政策工具或以“直达性”工具为主，继续降低实体融资利率。

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同第十六部分（二）收益分配原则的约定：“3. 本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，在基金份额“7 天持有周

期到期日”集中支付”、“5. 本基金每日进行收益计算并分配时，在基金份额“7 天持有周期到期日”累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式”的内容，本期 A 类份额已实现收益为 216,317.50 元，每日分配，到期支付，合计分配 216,317.50 元，B 类份额已实现收益为 113,102,175.76 元，每日分配，到期支付，合计分配 113,102,175.76 元，符合法律法规的规定和本基金基金合同的约定。

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,082,688,031.49	4,383,842,781.78
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	7,432,140,328.84	8,009,029,621.84
其中: 股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		7,432,140,328.84	8,009,029,621.84
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	9,902,078.84	41,605,855.95
应收股利		-	-
应收申购款		71,606.18	22,145.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,524,802,045.35	12,434,500,404.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,243,073,558.44	3,032,549,931.16
应付证券清算款		199,921,857.53	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,030,018.10	2,228,044.90
应付托管费		601,486.84	660,161.43
应付销售服务费		79,914.05	87,659.20
应付交易费用	6.4.7.7	132,840.44	82,785.37
应交税费		-	114.44
应付利息		314,722.66	1,344,328.05
应付利润		493,297.49	3,029,868.78
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,299.90	229,000.00
负债合计		2,446,765,995.45	3,040,211,893.33
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	7,078,036,049.90	9,394,288,511.62
未分配利润	6.4.7.10	-	-

所有者权益合计		7,078,036,049.90	9,394,288,511.62
负债和所有者权益总计		9,524,802,045.35	12,434,500,404.95

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，嘉实理财宝 7 天债券 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 19,677,202.79 份；嘉实理财宝 7 天债券 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 7,058,358,847.11 份。基金份额总额合计为 7,078,036,049.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		150,989,091.94	265,639,414.88
1. 利息收入		149,566,485.91	261,228,423.99
其中：存款利息收入	6.4.7.11	54,940,286.83	38,810,607.84
债券利息收入		87,740,937.69	221,180,843.66
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,885,261.39	1,236,972.49
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,422,606.03	4,410,990.89
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,422,606.03	4,410,990.89
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-	-
减：二、费用		37,670,598.68	68,473,966.52
1. 管理人报酬		12,560,574.01	17,567,279.27
2. 托管费		3,721,651.57	5,205,119.75

3. 销售服务费		494,408.07	684,154.73
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		20,731,458.46	44,858,266.95
其中：卖出回购金融资产支出		20,731,458.46	44,858,266.95
6. 税金及附加		173.44	-
7. 其他费用	6.4.7.15	162,333.13	159,145.82
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		113,318,493.26	197,165,448.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		113,318,493.26	197,165,448.36

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,394,288,511.62	-	9,394,288,511.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	113,318,493.26	113,318,493.26
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)	-2,316,252,461.72	-	-2,316,252,461.72
其中：1. 基金申购款	121,229,354.56	-	121,229,354.56
2. 基金赎回款	-2,437,481,816.28	-	-2,437,481,816.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-113,318,493.26	-113,318,493.26
五、期末所有者权益(基金净值)	7,078,036,049.90	-	7,078,036,049.90

项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	13,182,393,663.02	-	13,182,393,663.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	197,165,448.36	197,165,448.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,262,944,735.62	-	-1,262,944,735.62
其中：1. 基金申购款	404,885,239.81	-	404,885,239.81
2. 基金赎回款	-1,667,829,975.43	-	-1,667,829,975.43
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-197,165,448.36	-197,165,448.36
五、期末所有者权益(基金净值)	11,919,448,927.40	-	11,919,448,927.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

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

有限公司普华永道中天验字(2012)第 320 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 8 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 9,528,525,870.62 份基金份额,其中认购资金利息折合 925,049.80 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	2,688,031.49
定期存款	2,080,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	300,000,000.00
存款期限 3 个月及以上	1,780,000,000.00
其他存款	-
合计	2,082,688,031.49

注：定期存款的存款期限指票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	7,432,140,328.84	7,430,516,000.00	-1,624,328.84	-0.0229
	合计	7,432,140,328.84	7,430,516,000.00	-1,624,328.84	-0.0229
资产支持证券		-	-	-	-
合计		7,432,140,328.84	7,430,516,000.00	-1,624,328.84	-0.0229

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

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	767.34
应收定期存款利息	8,085,667.43
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	1,815,644.07
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	-
合计	9,902,078.84

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	132,840.44
合计	132,840.44

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30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	-
预提费用	118,299.90
合计	118,299.90

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 嘉实理财宝 7 天债券 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	20,529,208.50	20,529,208.50
本期申购	6,461,916.18	6,461,916.18
本期赎回(以“-”号填列)	-7,313,921.89	-7,313,921.89
本期末	19,677,202.79	19,677,202.79

##### 嘉实理财宝 7 天债券 B

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	9,373,759,303.12	9,373,759,303.12
本期申购	114,767,438.38	114,767,438.38
本期赎回(以“-”号填列)	-2,430,167,894.39	-2,430,167,894.39
本期末	7,058,358,847.11	7,058,358,847.11

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	216,317.50	-	216,317.50
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	-216,317.50	-	-216,317.50
本期末	-	-	-
嘉实理财宝 7 天债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	113,102,175.76	-	113,102,175.76
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	-113,102,175.76	-	-113,102,175.76
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	39,757.30
定期存款利息收入	54,900,529.53
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	54,940,286.83

## 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至 2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,638,727,863.59
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	10,595,543,257.55
减：应收利息总额	41,762,000.01
买卖债券差价收入	1,422,606.03

#### 6.4.7.13 其他收入

无。

#### 6.4.7.14 交易费用

无。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至 2020年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	34,338.19
债券托管账户维护费	17,901.52
其他	695.04
合计	162,333.13

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,560,574.01	17,567,279.27
其中：支付销售机构的客户维护费	7,963.81	9,147.50

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 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.27% / 当年天数。

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,721,651.57	5,205,119.75

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.08% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.08% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	1,933.81	464,199.50	466,133.31
中国农业银行	7,603.30	-	7,603.30
合计	9,537.11	464,199.50	473,736.61

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

注:本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%, 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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位: 人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	19,596,337,000.00	2,220,802.58
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	-	-	-	1,161,123,000.00	332,590.20

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	2,688,031.49	39,757.30	2,720,149.65	28,495.39
中国农业银行股份有限公司_定期	-	-	-	4,141,666.71

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

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

嘉实理财宝 7 天债券 A				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
217,824.32	3,065.24	-4,572.06	216,317.50	-
嘉实理财宝 7 天债券 B				
已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
114,767,438.38	866,736.61	-2,531,999.23	113,102,175.76	-

#### 6.4.12 期末(2020年06月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 2,243,073,558.44 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
111905111	19 建设银行 CD111	2020 年 7 月 1 日	99.81	2,970,000	296,422,748.69

111907126	19 招商银行 CD126	2020 年 7 月 1 日	99.95	298,000	29,784,099.07
111907163	19 招商银行 CD163	2020 年 7 月 1 日	99.78	1,000,000	99,775,913.02
111910422	19 兴业银行 CD422	2020 年 7 月 1 日	99.50	2,000,000	198,995,983.60
111915516	19 民生银行 CD516	2020 年 7 月 1 日	99.26	2,000,000	198,514,752.06
111982053	19 北京农商银行 CD119	2020 年 7 月 1 日	99.97	3,000,000	299,908,446.81
112009121	20 浦发银行 CD121	2020 年 7 月 1 日	98.93	6,630,000	655,883,741.61
112011109	20 平安银行 CD109	2020 年 7 月 1 日	99.71	2,000,000	199,425,214.14
170016	17 附息国债 16	2020 年 7 月 1 日	100.15	200,000	20,029,467.06
170209	17 国开 09	2020 年 7 月 1 日	100.44	100,000	10,043,859.62
170310	17 进出 10	2020 年 7 月 1 日	100.21	200,000	20,041,656.01
209918	20 贴现国债 18	2020 年 7 月 1 日	99.95	1,400,000	139,936,780.24
209919	20 贴现国债 19	2020 年 7 月 1 日	99.94	600,000	59,961,691.51
209922	20 贴现国债 22	2020 年 7 月 1 日	99.86	1,700,000	169,760,012.79
合计				24,098,000	2,398,484,366.23

#### 6.4.12.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金投资于各类货币市场工具，属于高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票、债券和混合型基金。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结

构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。公司管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	100,000,070.00
A-1 以下	-	-
未评级	199,806,781.50	50,002,946.26
合计	199,806,781.50	150,003,016.26

注：短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。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	6,812,560,080.11	7,258,526,965.64
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	6,812,560,080.11	7,258,526,965.64

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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资

品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于本报告期末，除附注 6.4.12 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产					
银行存款	2,082,688,031.49	-	-	-	2,082,688,031.49
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	6,842,537,518.35	589,602,810.49	-	-	7,432,140,328.84
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	-	-	-	9,902,078.84	9,902,078.84
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	71,606.18	71,606.18
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,925,225,549.84	589,602,810.49	-	9,973,685.02	9,524,802,045.35
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	2,243,073,558.44	-	-	-	2,243,073,558.44
应付证券清算款	-	-	-	199,921,857.53	199,921,857.53
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,030,018.10	2,030,018.10
应付托管费	-	-	-	601,486.84	601,486.84
应付销售服务费	-	-	-	79,914.05	79,914.05
应付交易费用	-	-	-	132,840.44	132,840.44
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	314,722.66	314,722.66
应付利润	-	-	-	493,297.49	493,297.49
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	118,299.90	118,299.90
负债总计	2,243,073,558.44	-	-	203,692,437.01	2,446,765,995.45
利率敏感度缺口	6,682,151,991.40	589,602,810.49	-	-193,718,751.99	7,078,036,049.90
上年度末 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	4,253,842,781.78	130,000,000.00	-	-	4,383,842,781.78
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	7,911,006,473.78	98,023,148.06	-	-	8,009,029,621.84
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	-	-	-	41,605,855.95	41,605,855.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	22,145.38	22,145.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,164,849,255.56	228,023,148.06	-	41,628,001.33	12,434,500,404.95
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	3,032,549,931.16	-	-	-	3,032,549,931.16
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,228,044.90	2,228,044.90
应付托管费	-	-	-	660,161.43	660,161.43
应付销售服务费	-	-	-	87,659.20	87,659.20
应付交易费用	-	-	-	82,785.37	82,785.37
应付税费	-	-	-	114.44	114.44

应付利息	-	-	-	1,344,328.05	1,344,328.05
应付利润	-	-	-	3,029,868.78	3,029,868.78
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	229,000.00	229,000.00
负债总计	3,032,549,931.16	-	-	7,661,962.17	3,040,211,893.33
利率敏感度缺口	9,132,299,324.40	228,023,148.06	-	33,966,039.16	9,394,288,511.62

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，若市场利率变动 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动（2019 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 6.4.14 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 7,432,140,328.84 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 8,009,029,621.84 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。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	7,432,140,328.84	78.03
	其中：债券	7,432,140,328.84	78.03
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	2,082,688,031.49	21.87
4	其他各项资产	9,973,685.02	0.10
5	合计	9,524,802,045.35	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	23.18

	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	2,243,073,558.44	31.69
	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回购的资金余额均未超过资产净值的 40%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	78
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

注：报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 127 天。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	35.35	34.52
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	44.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	19.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.92	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	30.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	134.43	34.52

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	389,687,951.60	5.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,085,515.63	0.43
	其中：政策性金融债	30,085,515.63	0.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	199,806,781.50	2.82
6	中期票据	-	-
7	同业存单	6,812,560,080.11	96.25
8	其他	-	-
9	合计	7,432,140,328.84	105.00
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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

#### 7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位: 元

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	112009121	20 浦发银行 CD121	10,000,000	989,266,578.60	13.98
2	111905111	19 建设银行 CD111	5,000,000	499,028,196.45	7.05
3	111982053	19 北京农商银行 CD119	3,000,000	299,908,446.81	4.24
4	112021174	20 渤海银行 CD174	3,000,000	299,643,324.96	4.23
5	112096226	20 汇丰银行 CD019	2,000,000	199,989,349.06	2.83
6	112096345	20 东亚银行 CD016	2,000,000	199,942,599.95	2.82
7	012002100	20 中车 SCP005	2,000,000	199,806,781.50	2.82
8	111909305	19 浦发银行 CD305	2,000,000	199,551,752.76	2.82
9	112099793	20 天津银行 CD132	2,000,000	199,510,588.85	2.82

10	112011109	20 平安银行 CD109	2,000,000	199,425,214.14	2.82
----	-----------	------------------	-----------	----------------	------

### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.2092%
报告期内偏离度的最低值	-0.0398%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0827%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

#### 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 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。

#### 7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

#### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	9,902,078.84
4	应收申购款	71,606.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,973,685.02

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (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 (%)
嘉实理财宝 7 天债券 A	5,571	3,532.08	435,665.78	2.21	19,241,537.01	97.79
嘉实理财宝 7 天债券 B	2	3,529,179,423.56	7,058,358,847.11	100.00	-	-
合计	5,573	1,270,058.51	7,058,794,512.89	99.73	19,241,537.01	0.27

注：(1) 嘉实理财宝 7 天债券 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 A 份额占嘉实理财宝 7 天债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 A 份额占嘉实理财宝 7 天债券 A 总份额比例；

(2) 嘉实理财宝 7 天债券 B：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 B 份额占嘉实理财宝 7 天债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实理财宝 7 天债券 B 份额占嘉实理财宝 7 天债券 B 总份额比例。

## 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	银行类机构	7,001,983,599.84	98.93
2	银行类机构	56,375,247.27	0.80
3	个人	451,185.17	0.01
4	个人	394,338.50	0.01
5	个人	386,898.18	0.01
6	个人	384,397.09	0.01
7	个人	267,048.97	0.00
8	个人	266,770.43	0.00
9	个人	263,102.50	0.00
10	个人	263,037.61	0.00

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业	嘉实理财宝 7 天债券 A	633.29	0.00
	嘉实理财宝 7 天债券 B	-	-

人员持有本基金			
	合计	633.29	0.00

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实理财宝 7 天债券 A	0
	嘉实理财宝 7 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实理财宝 7 天债券 A	0
	嘉实理财宝 7 天债券 B	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实理财宝 7 天债券 A	嘉实理财宝 7 天债券 B
基金合同生效日（2012 年 8 月 29 日）基金份额总额	5,847,460,658.26	3,681,065,212.36
本报告期期初基金份额总额	20,529,208.50	9,373,759,303.12
本报告期基金总申购份额	6,461,916.18	114,767,438.38
减：本报告期基金总赎回份额	7,313,921.89	2,430,167,894.39
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	19,677,202.79	7,058,358,847.11

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2020 年 4 月 8 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》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 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》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

## (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

报告期内，本基金管理人、托管人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**

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	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	2	-	-	-	-	-
世纪证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证	1	-	-	-	-	-

券股份有限 公司						
-------------	--	--	--	--	--	--

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

## 10.8 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 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020/01/01 至 2020/06/30	7,036,226,812.14	86,686,787.70	120,930,000.00	7,001,983,599.84	98.93
	2	2020/01/02 至 2020/06/23	2,281,855,842.14	27,382,052.25	2,309,237,894.39	-	-

个人	-	-	-	-	-	-
产品特有风险						
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>						

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2020 年 7 月 15 日发布《关于以通讯方式召开嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金基金份额持有人大会的公告》，决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会，审议《关于嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金转型有关事项的议案》。基金份额持有人送达表决票起止时间：自 2020 年 7 月 28 日起，至 2020 年 8 月 27 日 17:00 止（送达时间以本基金管理人收到表决票时间为准），会议计票日（即本次会议召开日）：2020 年 8 月 28 日。相关审议结果详见本基金管理人后续公告。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

### 12.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话

400-600-8800, 或发电子邮件, E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 08 月 29 日