

嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年年度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
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	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告	54
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	55
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	55
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	55
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	55
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	56
8.8 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	56
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	56
8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	56
8.11 投资组合报告附注.....	57
§9 基金份额持有人信息.....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§10 开放式基金份额变动.....	59
§11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8 其他重大事件.....	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
§13 备查文件目录.....	78
13.1 备查文件目录.....	78
13.2 存放地点.....	78
13.3 查阅方式.....	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新兴市场债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实新兴市场债券	
基金主代码	000342	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 26 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	338,043,557.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2
下属分级基金的交易代码	000342	000341
报告期末下属分级基金的份额总额	318,912,991.32 份	19,130,565.90 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增。
投资策略	<p>本基金主要投资策略包括：</p> <p>1、资产配置策略：本基金通过研究全球新兴市场经济运行趋势，深入分析不同国家和地区财政及货币政策对经济运行的影响，结合对中长期利率走势、通货膨胀及各类债券的收益率、波动性的预期，自上而下地决定债券组合久期，对投资组合类属资产的比例进行最优化配置和动态调整。</p> <p>2、债券投资策略：本基金在债券投资方面，将运用久期策略、信用债券投资策略、货币投资策略、其它债券投资策略（期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略）等策略，在控制基金组合风险的基础上，追求实现良好收益率的目标。</p> <p>房地产投资信托投资策略：本基金会少量选择拥有优质房地产资产、良好管理能力和稳健资产负债表的房地产投资信托进行投资，在扩大分红收益和资本增长的同时注意分散风险。</p> <p>3、衍生工具投资策略：本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用衍生工具，控制下跌风险，对冲汇率风险，实现保值和锁定收益。</p> <p>4、组合风险控制措施：“嘉实下行风险波动模型”，从组合层面以及个券层面分别度量组合潜在的下行风险，根据宏观环境以及证券市场表现，设置一定的阈值，将组合可能的下行波动控制在较小范围内。</p>
业绩比较基准	同期人民币一年期定期存款利率+1%
风险收益特征	本基金为债券型基金，主要投资于新兴市场的各类债券，其预期风险和预期收益低于股票型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588	
传真	(010)65215588	(010)66105798	
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	北京市西城区复兴门内大街55号	
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55号	
邮政编码	100005	100140	
法定代表人	经雷	陈四清	

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The HongkongandShanghai Banking Corporation Limited
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
邮政编码		-

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年12月31日)		报告期(2019年1月1日-2019年12月31日)		报告期(2018年1月1日-2018年12月31日)	
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2
本期已实现收益	-19,125,716.48	-4,517,690.49	56,200,923.77	9,871,775.32	-1,579,345.82	-2,877,738.17
本期利润	-34,627,177.12	-11,923,918.32	75,748,198.13	24,054,050.75	-963,522.60	1,281,909.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0442	-0.5569	0.0937	0.9869	-0.0136	0.0438
本期加权平均净值利润率	-3.43%	-6.92%	6.92%	12.06%	-1.18%	0.60%
本期基金份额净值增长率	-4.25%	1.80%	13.66%	11.18%	1.95%	-3.42%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
期末可供分配利润	156,669,034.75	39,007,758.30	555,790,435.08	53,490,157.88	21,464,281.16	38,642,442.35
期末可供分配基金	0.4913	2.0390	0.5144	2.2259	0.4123	1.5008

份额利润						
期末基金资产净值	416,702,560.26	155,420,250.50	1,474,771,953.78	205,036,440.95	62,534,000.27	194,371,137.69
期末基金份额净值	1.307	1.245	1.365	1.223	1.201	1.100
3.1.3 累计期末指标	2020 年末		2019 年末		2018 年末	
基金份额累计净值增长率	30.70%	24.50%	36.50%	22.30%	20.10%	10.00%

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。

（4）嘉实新兴市场 C2 的期末基金份额净值单位为美元。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实新兴市场 A1

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	2.51%	0.35%	0.62%	0.01%	1.89%	0.34%

过去六个月	1.08%	0.31%	1.25%	0.01%	-0.17%	0.30%
过去一年	-4.25%	0.60%	2.51%	0.01%	-6.76%	0.59%
过去三年	10.95%	0.39%	7.70%	0.01%	3.25%	0.38%
过去五年	28.77%	0.33%	13.16%	0.01%	15.61%	0.32%
自基金合同生效起 至今	30.70%	0.32%	13.43%	0.01%	17.27%	0.31%

嘉实新兴市场 C2

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	6.87%	0.27%	0.62%	0.01%	6.25%	0.26%
过去六个月	9.31%	0.24%	1.25%	0.01%	8.06%	0.23%
过去一年	1.80%	0.59%	2.51%	0.01%	-0.71%	0.58%
过去三年	9.31%	0.36%	7.70%	0.01%	1.61%	0.35%
过去五年	24.87%	0.29%	13.16%	0.01%	11.71%	0.28%
自基金合同生效起 至今	24.50%	0.28%	13.43%	0.01%	11.07%	0.27%

注：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：

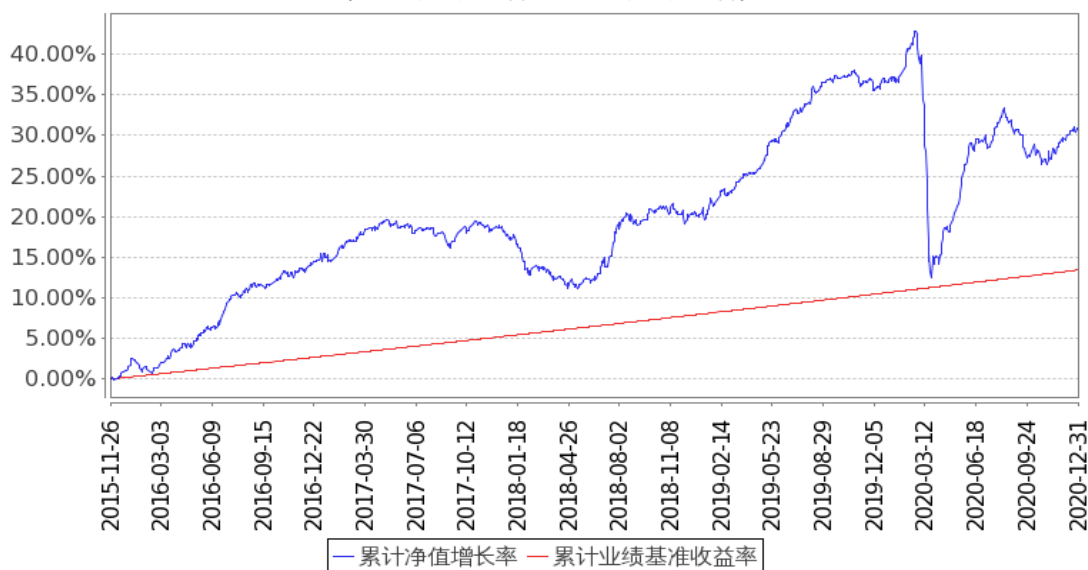
$$\text{Return}(t) = 100\% \times (\text{人民币一年期定期存款利率} + 1\%)^{(1/365)}$$

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

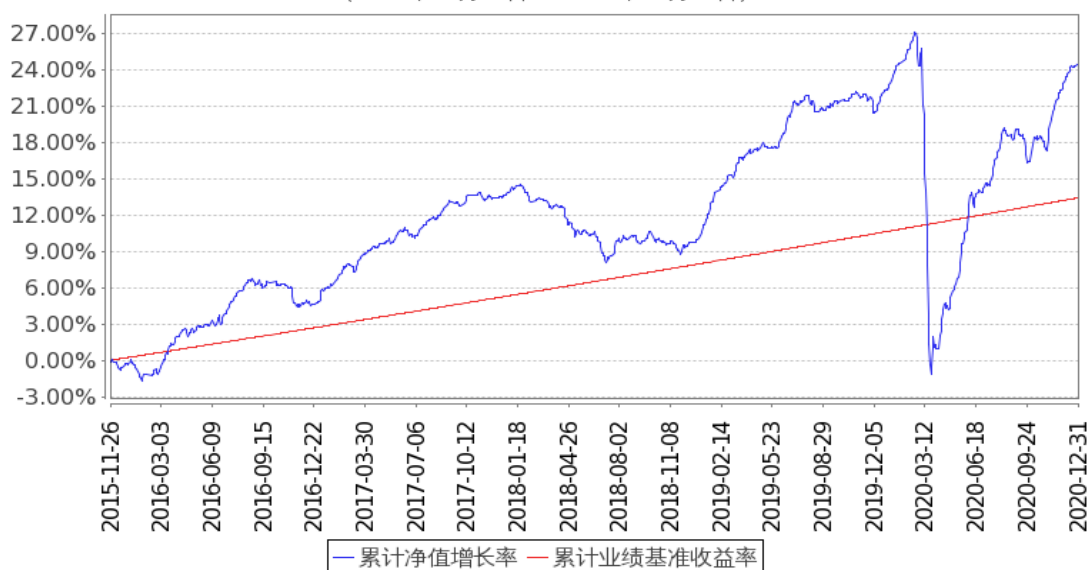
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

嘉实新兴市场A1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
(2015年11月26日至2020年12月31日)



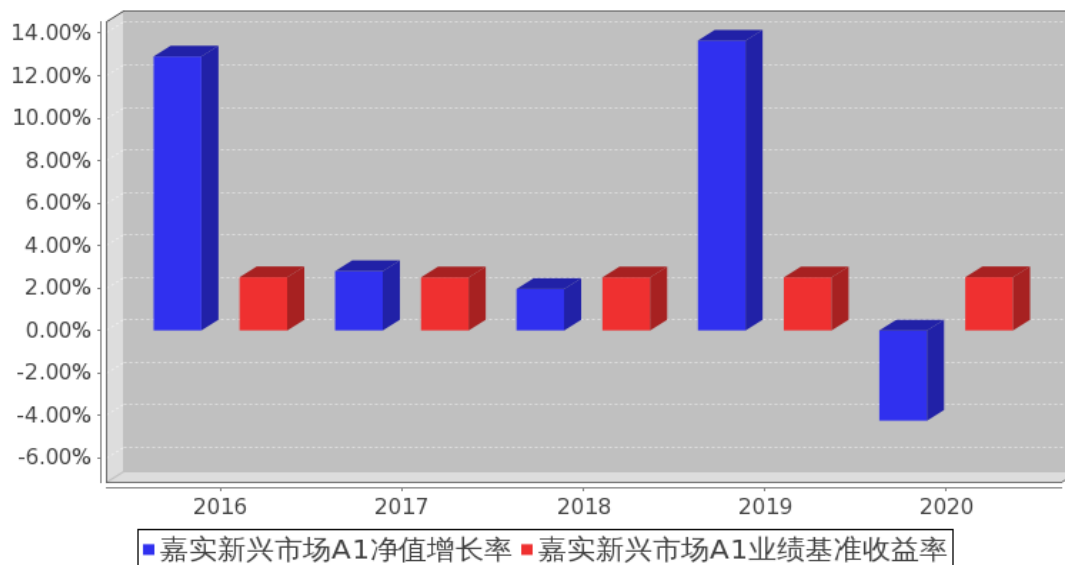
嘉实新兴市场C2累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015年11月26日至2020年12月31日)



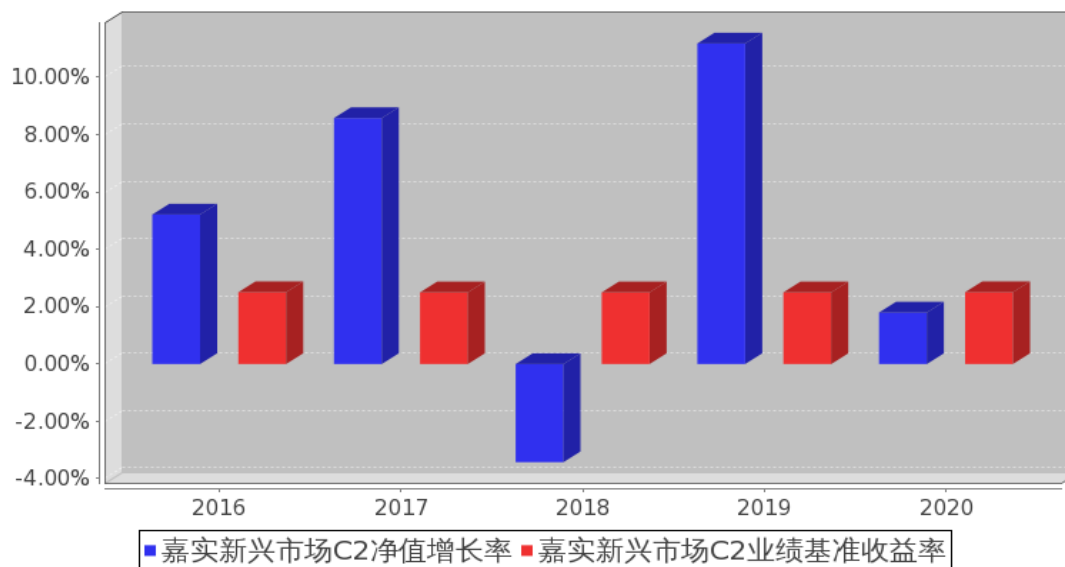
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实新兴市场A1基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实新兴市场C2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



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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,总部设在北京并设北京、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2020年12月31日,基金管理人共管理205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、嘉实海外中国股票混合(QDII)、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-LOF)、嘉实主题新动力混合、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、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、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 年国开债指数、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、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF（QDII）、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。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		
关子宏	本基金基金经理	2015 年 11 月 26 日	-	20 年	2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司，现兼任嘉实国际资产管理公司首席投资官。曾任职于霸菱资产管理（亚洲）有限公司担任亚洲债券投资总监，瑞士信贷资产管理有限公司（新加坡及北京）的亚洲固定收益及外汇部董事，保诚资产管理（新加坡）有限公司的亚洲固定收益投资董事和首域投资（香港）有限公司的基金经理等职务。经济学硕士，特许金融分析师，中国香港籍。
国歌 (Guo Ge)	本基金基金经理	2020 年 1 月 3 日	-	6 年	曾先后任职于 Energie Baden-Württemberg, Deutsche Asset & Wealth Management, Deutsche Asset Management (DWS), Union Investment, 历任分析师及投资经理职务。2018 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，从事投资与研究。本科，具有基金从业资格，德国国籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

（3）2021 年 1 月 21 日，本基金管理人发布《关于嘉实新兴市场债券基金经理变更的公告》，国歌女士不再担任本基金基金经理，本基金由关子宏先生单独管理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

输送，保护投资者合法权益。

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 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

从全球市场角度看，新兴市场公司债多元分散债券指数（CEMBI Broad Diversified）全年上涨 7.1%。在新冠疫苗加强经济复苏憧憬的情形下，中东板块与拉美板块表现领先，分别涨 8.3% 与 7.8%。亚洲板块表现相对居中，涨 6.9%。新兴欧洲市场升幅落后，全年涨 6.0%。

新冠疫情在 1 月冲击中国后，在 3 月在全球大流行。疫情因素叠加原油产能过剩及市场恐慌导致美元流动性紧张，令新兴市场信用债市场在 3 月随全球金融市场一起大跌。然而美联储迅速将利率降至接近零的水平，并推出大规模的资产购买计划，缓解了美元流动性，帮助债券市场自

3 月底以来稳步回升。随后美联储进一步调整货币政策框架，转向平均通胀目标制，预示美国将在未来数年将利率维持在历史低位，为美元债市场提供了充足的流动性。尽管新冠疫情在年内不断恶化，并因各国相应采取的封锁措施而拖累经济活动，但全球大规模的货币政策与财政政策刺激措施帮助金融市场先于实体经济复苏。在第四季，新冠疫苗的研发及投入使用更进一步刺激风险情绪，推动市场上升。

疫情全球扩散叠加原油产能过剩及市场恐慌导致美元流动性紧张，令新兴市场双币分级债券基金在 3 月随全球金融市场一起大跌。基于我们对于美联储推出无限量资产购买计划和债券购买计划的乐观态度，我们逐步拉长了基金的久期，开始加大在一些受益于大规模财政刺激和经济复苏的行业和企业的布局，尤其是大宗商品相关行业。在基金总体信用风险方面我们在三四季度进一步增持了高收益债券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新兴市场 A1 基金份额净值为 1.307 元，本报告期基金份额净值增长率为 -4.25%；截至本报告期末嘉实新兴市场 C2 基金份额净值为 1.245 美元，本报告期基金份额净值增长率为 1.80%；业绩比较基准收益率为 2.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2021 年，疫苗与宏观刺激政策有望共同作用，帮助美国经济进一步复苏。10 年期美债收益率有可能在经济及通胀回暖预期的推动下尝试 1.2% 的水平。但从中长期看，美国需要将远端利率保持在相对低位以压低市场借贷成本、刺激经济。

在新的一年里，随着多项国际政治不确定因素在 2020 年末得到解决，预计市场焦点将继续落在新冠疫情的发展上。新冠疫苗有望在 2021 年帮助全球经济进入更全面的复苏阶段。在全球央行维持宽松立场、市场流动性充裕的背景下，疫苗点燃的复苏憧憬将推动资金进一步流向新兴市场。在新兴市场中，疫情控制较好、基本面相对较为坚韧的亚洲债市有望受益。

在亚洲，中国经济复苏进程大幅领先于其他国家，是推动新兴市场及全球经济复苏的重要力量。中资企业的投资价值也相应突显。虽然在 2020 年末中国投资级板块因美国制裁等因素而受压，但美国相关投资禁令或出口管制对相关名字的影响更多集中于情绪层面，而非企业基本面。总体而言，中国投资级板块的基本面将受益于更全面的经济复苏及政府支持。另一方面，不论在投资级还是高收益板块，中国房地产板块因在低息环境中提供相对较高的收益率而受到关注。在政府加强负债监管的背景下，中国房地产企业在拿地方面趋于谨慎，对信用评级形成利好。预计整体板块会受益于评级上调趋势。此外，虽然城投债此前受到境内债市国企发行人违约事件的影响，但在中国财政政策发力稳增长、加大城市基建投资的背景下，城投在经济复苏中扮演重要角色，

未来有望持续获得政策支持。在风险层面，须留意中国因防范债务风险而收紧流动性。然而中国政府已表示将维持宏观政策连续性、稳定性及可持续性，在操作上“不急转弯”。相较而言，一些亚洲国家因债务急剧上升而带来的风险更值得警惕，但相信相关风险在全球流动性充裕的背景下仍然可控。

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) 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) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，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) 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基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

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，本基金托管人在对嘉实新兴市场债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，嘉实新兴市场债券型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实新兴市场债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 23483 号
--------	-------------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实新兴市场债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实新兴市场债券型证券投资基金(以下简称“嘉实新兴市场债券基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实新兴市场债券基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实新兴市场债券基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实新兴市场债券基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估嘉实新兴市场债券基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算嘉实新兴市场债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实新兴市场债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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</p>

	<p>为错报是重大的。</p> <p>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：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对嘉实新兴市场债券基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实新兴市场债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 周祎
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2021 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实新兴市场债券型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	34,258,057.38	90,797,022.69

结算备付金		-	7,258,410.03
存出保证金		188,537.83	-
交易性金融资产	7.4.7.2	537,910,453.12	1,595,980,456.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	10,235,227.47
债券投资		537,910,453.12	1,585,745,228.70
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,562,198.88	3,808,581.25
应收利息	7.4.7.5	7,849,414.92	22,680,060.72
应收股利		-	-
应收申购款		805,140.32	7,885,204.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		584,573,802.45	1,728,409,735.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	814,469.80	681,714.33
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,627,183.34	45,371,804.59
应付管理人报酬		497,677.82	1,547,113.78
应付托管费		124,419.45	386,778.43
应付销售服务费		66,582.67	87,139.04
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		74,796.69	253,174.88
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	245,861.92	273,615.42
负债合计		12,450,991.69	48,601,340.47
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	367,292,961.42	997,627,265.89
未分配利润	7.4.7.10	204,829,849.34	682,181,128.84
所有者权益合计		572,122,810.76	1,679,808,394.73
负债和所有者权益总计		584,573,802.45	1,728,409,735.20

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，嘉实新兴市场 A1 基金份额净值 1.307 元，基金份额总额 318,912,991.32 份，嘉实新兴市场 C2 基金份额净值 1.245 美元，基金份额总额 19,130,565.90

份，基金份额总额合计为 338,043,557.22 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实新兴市场债券型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 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
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		-30,300,830.39	117,490,380.48
1. 利息收入		61,358,005.69	67,985,423.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	335,539.56	913,898.62
债券利息收入		61,022,466.13	67,071,524.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-61,672,382.25	28,159,537.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	65,486.77	-
债券投资收益	7.4.7.14	-62,983,289.67	27,099,200.26
资产支持证券投资		-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	1,245,420.65	807,674.62
股利收益	7.4.7.17	-	252,662.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-22,907,688.47	33,729,549.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-7,999,458.93	-13,359,531.04
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	920,693.57	975,401.21
减：二、费用		16,250,265.05	17,688,131.60
1. 管理人报酬		11,902,023.26	12,933,715.02
2. 托管费		2,975,505.86	3,233,428.66
3. 销售服务费		866,619.84	997,315.78
4. 交易费用	7.4.7.20	17,569.01	33,759.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		215,590.48	230,583.20
7. 其他费用	7.4.7.21	272,956.60	259,329.27
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-46,551,095.44	99,802,248.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-46,551,095.44	99,802,248.88

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：嘉实新兴市场债券型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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)	997,627,265.89	682,181,128.84	1,679,808,394.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-46,551,095.44	-46,551,095.44
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)	-630,334,304.47	-430,800,184.06	-1,061,134,488.53
其中：1. 基金申购款	1,075,071,862.71	655,720,697.80	1,730,792,560.51
2. 基金赎回款	-1,705,406,167.18	-1,086,520,881.86	-2,791,927,049.04
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)	367,292,961.42	204,829,849.34	572,122,810.76
项目	上年度可比期间 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	196,798,414.45	60,106,723.51	256,905,137.96

权益(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	99,802,248.88	99,802,248.88
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)	800,828,851.44	522,272,156.45	1,323,101,007.89
其中:1.基金申购款	2,130,672,101.38	1,475,705,942.45	3,606,378,043.83
2.基金赎回款	-1,329,843,249.94	-953,433,786.00	-2,283,277,035.94
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)	997,627,265.89	682,181,128.84	1,679,808,394.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

经雷

罗丽丽

罗丽丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实新兴市场债券型证券投资基金(原名为嘉实新兴市场双币分级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[2013]1154号《关于核准嘉实新兴市场双币分级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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实新兴市场双币分级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。经向中国证监会备案,《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金合同》于2013年11月26日正式生效,基金合同生效日嘉实新兴市场A份额112,685,757.47份和嘉实新兴市场B份额461,115,683.76份。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

为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据《关于嘉实新兴市场双币分级债券运作届满更名为嘉实新兴市场债券和基金份额转换的公告》和《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金两年运作期届满后基金份额转换结果的公告》，嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金生效之日起两年期届满后，于 2015 年 11 月 26 日自动转换为“嘉实新兴市场债券型证券投资基金”，嘉实新兴市场 A 份额和嘉实新兴市场 B 份额运作终止，分别转换为嘉实新兴市场 C2 份额和嘉实新兴市场 A1 份额。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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未实现损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认

为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算或者发行价计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可对 A1 类和 C2 类基金份额分别选择现金红利或将现金红利自动转为该类基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金收益分配币种与其对应份额的认购/申购币种相同，人民币份额的现金分红分配币种为人民币，美元等外币份额现金分红币种为其相应币种，不同币种份额红利再投资适用的净值为该币种份额的净值；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的人民币基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于人民币份额面值，对于美元等外币份额，由于汇率因素影响，存在收益分配后美元等外币份额的基金份额净值低于对应的基金份额面值的可能；由于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 A1 类基金份额不收取销售服务费，而 C2 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、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》及其他相关境内外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股票、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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对基金从境内证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、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。

(3) 对基金在境内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。对基金在境内从上市公司取得的股息红利所得,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,暂免征收个人所得税。对基金在境内持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4) 基金在境内卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 目前基金取得的源自境外的差价收入,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收企业所得税。

(6) 目前基金取得的源自境外的其他收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(7) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	34,258,057.38	90,797,022.69
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 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	34,258,057.38	90,797,022.69

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC市场	527,771,979.68	537,910,453.12	10,138,473.44
	合计	527,771,979.68	537,910,453.12	10,138,473.44
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	527,771,979.68	537,910,453.12	10,138,473.44	
项目	上年度末 2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC市场	1,552,952,056.20	1,585,745,228.70	32,793,172.50
	合计	1,552,952,056.20	1,585,745,228.70	32,793,172.50
资产支持证券	-	-	-	
基金	10,114,993.53	10,235,227.47	120,233.94	
其他	-	-	-	
合计	1,563,067,049.73	1,595,980,456.17	32,913,406.44	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	39,777,513.10	-	814,469.80	-
其中：远期外汇 投资	39,777,513.10	-	814,469.80	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	39,777,513.10	-	814,469.80	-

项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	94,565,295.50	-	681,714.33	
其中：远期外汇 投资	94,565,295.50	-	681,714.33	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	94,565,295.50	-	681,714.33	

注：合同/名义金额中的外币金额以财务报表期末时点的汇率折算为人民币列示。

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

无。

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,350.39	11,525.49
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	-	-
应收债券利息	7,848,064.53	22,668,535.23
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	7,849,414.92	22,680,060.72

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

无。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	5,861.92	33,615.42
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	240,000.00	240,000.00
合计	245,861.92	273,615.42

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实新兴市场 A1

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,080,470,808.86	852,286,782.11
本期申购	1,330,879,807.35	1,049,931,930.95
本期赎回（以“-”号填列）	-2,092,437,624.89	-1,650,617,957.50
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	318,912,991.32	251,600,755.56

嘉实新兴市场 C2

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,030,416.35	145,340,483.78
本期申购	4,156,637.41	25,139,931.76
本期赎回（以“-”号填列）	-9,056,487.86	-54,788,209.68
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	19,130,565.90	115,692,205.86

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实新兴市场 A1

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	555,790,435.08	66,694,736.59	622,485,171.67
本期利润	-19,125,716.48	-15,501,460.64	-34,627,177.12
本期基金份额交易产生的变动数	-379,995,683.85	-42,760,506.00	-422,756,189.85
其中：基金申购款	629,228,899.91	18,058,081.07	647,286,980.98
基金赎回款	-1,009,224,583.76	-60,818,587.07	-1,070,043,170.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	156,669,034.75	8,432,769.95	165,101,804.70

嘉实新兴市场 C2

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,490,157.88	6,205,799.29	59,695,957.17
本期利润	-4,517,690.49	-7,406,227.83	-11,923,918.32
本期基金份额交易产生的变动数	-9,964,709.09	1,920,714.88	-8,043,994.21
其中：基金申购款	8,192,136.36	241,580.46	8,433,716.82
基金赎回款	-18,156,845.45	1,679,134.42	-16,477,711.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,007,758.30	720,286.34	39,728,044.64

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
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	321,955.00	902,374.53
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	-	-
其他	13,584.56	11,524.09
合计	335,539.56	913,898.62

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出/赎回基金成交总额	10,180,480.30	-
减：卖出/赎回基金成本总额	10,114,993.53	-
基金投资收益	65,486.77	-

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	-62,983,289.67	27,099,200.26
债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	-62,983,289.67	27,099,200.26

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,522,561,314.45	6,398,497,070.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,529,535,459.06	6,315,306,416.61
减：应收利息总额	56,009,145.06	56,091,453.41
买卖债券差价收入	-62,983,289.67	27,099,200.26

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2019年1月1日至2019年12月31日
外汇远期投资收益	392,553.65	915,032.55
国债期货投资收益	852,867.00	-107,357.93

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	-	-
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	252,662.39
合计	-	252,662.39

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	-22,774,933.00	34,404,969.71
股票投资	-	-
债券投资	-22,654,699.06	34,259,059.47
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-120,233.94	145,910.24
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-132,755.47	-675,419.92
权证投资	-	-
远期投资	-132,755.47	-675,419.92
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	-22,907,688.47	33,729,549.79

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
基金赎回费收入	863,211.20	714,545.69
其他	57,482.37	260,855.52
合计	920,693.57	975,401.21

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	17,569.01	33,759.67
银行间市场交易费用	-	-
合计	17,569.01	33,759.67

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	18,395.20	9,569.82
其他	14,561.40	9,759.45
合计	272,956.60	259,329.27

7.4.7.22 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
香港上海汇丰银行有限公司	境外资产托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

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

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	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 成交总额的比例 (%)
香港上海汇丰银行有限公司	1,020,210,375.36	10.39	964,982,729.95	7.13

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 基金交易

无。

7.4.10.1.5 权证交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

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 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,902,023.26	12,933,715.02
其中：支付销售机构的客户维护费	3,445,187.70	4,524,117.84

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 1.00%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×1.00%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,975,505.86	3,233,428.66

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2020年1月1日至2020年12月31日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2	合计
嘉实基金管理有限公司	-	3,077.91	3,077.91
中国工商银行	-	358,862.27	358,862.27
合计	-	361,940.18	361,940.18
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2	合计
嘉实基金管理有限公司	-	3,130.86	3,130.86
中国工商银行	-	387,660.35	387,660.35
合计	-	390,791.21	390,791.21

注：(1) 本基金 C2 类基金份额销售服务费年费率为 0.50%，每日计提，逐日累计至每月月底，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：日 C2 类基金份额销售服务费 = 前一日 C2 类基金份额参考净值 × 前一日 C2 类基金份额数 × 前一日美元兑换人民币的汇率 × 0.50% / 当年天数。(2) 本基金 A1 类基金份额不收取销售服务费。

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

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	嘉实新兴市场 A1		嘉实新兴市场 C2	
报告期初持有的基金份额	-	-	76,532.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	76,532.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.40%	-
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	嘉实新兴市场 A1		嘉实新兴市场 C2	
报告期初持有的基金份额	-	-	76,532.14	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-	76,532.14	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	0.32%	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国工商银行股份有限公司_活期	5,827,982.27	321,955.00	13,711,708.05	902,374.53

香港上海汇丰银行有限公司_活期	28,430,075.11		-77,085,314.64	-
-----------------	---------------	--	----------------	---

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 外汇远期交易

本期(2020年1月1日起至2020年12月31日)，本基金与香港上海汇丰银行有限公司按合同约定汇率进行美元、欧元的外汇远期交易。其中：卖出美元当期交易协议金额合计为11,418,341.94美元，卖出欧元当期交易协议金额合计为6,970,411.17欧元；于2020年12月31日，卖出美元未结算协议余额为2,995,918.66美元，卖出欧元未结算协议余额为2,520,802.92欧元。上年度可比期间(2019年1月1日起至2019年12月31日)，本基金与香港上海汇丰银行有限公司按合同约定汇率进行美元、欧元、人民币的外汇远期交易。其中：卖出美元当期交易协议金额合计为15,477,249.58美元，卖出欧元当期交易协议金额合计为29,869,876.68欧元，卖出人民币当期交易协议金额合计为33,325,256.01人民币；于2019年12月31日，卖出美元未结算协议余额为2,662,850.30美元，卖出欧元未结算协议余额为8,301,490.70欧元，卖出人民币未结算协议余额为11,108,418.67人民币。

7.4.10.8.2 期货交易

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2020年1月1日至2020年12月31日)，本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末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

本基金为债券型基金，主要投资于新兴市场的各类债券，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人

出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，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与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	4,975,804.99	-
AAA 以下	532,934,648.13	1,585,745,228.70
未评级	-	-
合计	537,910,453.12	1,585,745,228.70

注：评级取自第三方评级机构。

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合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 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感

性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金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 2020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	34,258,057.38	-	-	-	34,258,057.38
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	188,537.83	-	-	-	188,537.83
交易性金融资产	5,236,153.95	109,751,342.19	422,922,956.98	-	537,910,453.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,562,198.88	3,562,198.88
应收利息	-	-	-	7,849,414.92	7,849,414.92
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	805,140.32	805,140.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	39,682,749.16	109,751,342.19	422,922,956.98	12,216,754.12	584,573,802.45
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	814,469.80	814,469.80
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,627,183.34	10,627,183.34
应付管理人报酬	-	-	-	497,677.82	497,677.82
应付托管费	-	-	-	124,419.45	124,419.45
应付销售服务费	-	-	-	66,582.67	66,582.67
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	74,796.69	74,796.69
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	245,861.92	245,861.92
负债总计	-	-	-	12,450,991.69	12,450,991.69
利率敏感度缺口	39,682,749.16	109,751,342.19	422,922,956.98	-234,237.57	572,122,810.76

上年度末 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	90,797,022.69	-	-	-	90,797,022.69
结算备付金	7,258,410.03	-	-	-	7,258,410.03
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	313,337,842.87	1,272,407,385.83	10,235,227.47	1,595,980,456.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,808,581.25	3,808,581.25
应收利息	-	-	-	22,680,060.72	22,680,060.72
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	53,723.00	-	-	7,831,481.34	7,885,204.34
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	98,109,155.72	313,337,842.87	1,272,407,385.83	44,555,350.78	1,728,409,735.20
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	681,714.33	681,714.33
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	45,371,804.59	45,371,804.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,547,113.78	1,547,113.78
应付托管费	-	-	-	386,778.43	386,778.43
应付销售服务费	-	-	-	87,139.04	87,139.04
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	253,174.88	253,174.88
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	273,615.42	273,615.42
负债总计	-	-	-	48,601,340.47	48,601,340.47
利率敏感度缺口	98,109,155.72	313,337,842.87	1,272,407,385.83	-4,045,989.69	1,679,808,394.73

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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-8,261,858.05	-24,281,141.48
	市场利率下降 25 个基点	8,263,725.78	24,286,127.76

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产和负债进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	29,454,068.06	46.58	1,828.67	29,455,943.31
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	188,537.83	-	-	188,537.83
交易性金融资产	523,750,595.86	-	14,159,857.26	537,910,453.12
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	7,387,521.93	-	460,547.56	7,848,069.49
应收申购款	14,354.78	-	-	14,354.78
应收证券清算款	3,562,198.88	-	-	3,562,198.88
其它资产	-	-	-	-
资产合计	564,357,277.34	46.58	14,622,233.49	578,979,557.41
以外币计价的负债				

应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	814,469.80	-	-	814,469.80
应付赎回款	1,280,559.84	-	-	1,280,559.84
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	2,095,029.64	-	-	2,095,029.64
资产负债表外汇风险敞口净额	562,262,247.70	46.58	14,622,233.49	576,884,527.77
项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币 元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	77,930,819.62	49.57	5,838.76	77,936,707.95
结算备付金	7,258,410.03	-	-	7,258,410.03
交易性金融资产	1,556,144,149.27	-	39,836,306.90	1,595,980,456.17
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	21,923,468.60	-	745,238.10	22,668,706.70
应收申购款	152,918.30	-	-	152,918.30
应收证券清算款	3,808,581.25	-	-	3,808,581.25
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,667,218,347.07	49.57	40,587,383.76	1,707,805,780.40
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	435,622.53	-	-	435,622.53
应付赎回款	239,283.24	-	-	239,283.24

应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	674,905.77	-	-	674,905.77
资产负债表外汇风险敞口净额	1,666,543,441.30	49.57	40,587,383.76	1,707,130,874.63

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	28,844,226.39	85,356,543.73
	所有外币相对人民币贬值 5%	-28,844,226.39	-85,356,543.73

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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 2020年12月31日		上年度末 2019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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	10,235,227.47	0.61

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	-	-	10,235,227.47	0.61

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性权益类投资（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.61%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 537,910,453.12 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 10,235,227.47 元，第二层次 1,585,745,228.70 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动为交易性金融资产—债券投资公允价值的变动。于 2020 年 1 月 1 日及

2020 年 12 月 31 日，本基金无第三层次交易性金融资产余额。于 2020 年度，本基金无第三层次交易性金融资产变动(于 2019 年 1 月 1 日,本基金持有的第三层次资产的账面价值为 3,464,773.62 元, 2019 年度转入第三层次金额为零元, 转出第三层次金额为 4,026,380.39 元, 当期计入损益的利得金额为 561,606.77 元。于 2019 年 12 月 31 日, 本基金无第三层次交易性金融资产余额。计入损益的利得计入利润表中的公允价值变动收益项目)。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中: 普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	537,910,453.12	92.02
	其中: 债券	537,910,453.12	92.02
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中: 远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	34,258,057.38	5.86
8	其他各项资产	12,405,291.95	2.12

9	合计	584,573,802.45	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

无。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

无。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

无。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

无。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

无。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

无。

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

债券信用等级	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
AAA	4,975,804.99	0.87
A	15,604,559.35	2.73
A-	15,691,112.14	2.74
BBB+	37,782,335.36	6.60
BBB	38,518,696.65	6.73
BBB-	99,875,339.31	17.46
BB+	43,153,134.10	7.54
BB	54,037,199.09	9.45
BB-	90,241,539.36	15.77
B+	32,701,095.79	5.72
B	72,632,371.30	12.70
B-	5,508,059.58	0.96
CCC+	14,076,023.23	2.46
CCC	3,664,755.76	0.64
CCC-	9,448,427.11	1.65

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、惠誉、穆迪等）提供的债券信用评级信息，上述机构未提供评级信息的债券采用内部评级。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	USY7140WAF50	IDASAL 5.45 05/15/30	7,177,390	8,657,583.14	1.51
2	USQ8053LAB01	SCGAU 5 1/8 09/24/80	7,829,880	8,269,214.57	1.45
3	XS2227351900	CHINSC 7 05/02/25	7,177,390	7,536,331.27	1.32
4	XS1054250318	SECO 5 1/2 04/08/44	5,480,916	7,317,845.00	1.28
5	XS2198427085	SHIMAO 4.6 07/13/30	6,524,900	7,069,859.65	1.24

注：1. 本表所使用的证券代码为彭博代码；2. 数量列示债券面值，以外币计价的债券面值按照期末中国人民银行公布的人民币兑外币汇率中间价折算为人民币。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	远期投资	外汇远期（美元对欧元）	569,463.84	0.10
2	远期投资	外汇远期（欧元对美元）	-1,383,933.64	-0.24

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

8.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

8.11.3 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	188,537.83
2	应收证券清算款	3,562,198.88
3	应收股利	-
4	应收利息	7,849,414.92
5	应收申购款	805,140.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,405,291.95

8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

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	133,706	2,385.18	13,170,766.99	4.13	305,742,224.33	95.87

新兴市场 A1						
嘉实新兴市场 C2	1,178	16,239.87	76,532.14	0.40	19,054,033.76	99.60
合计	134,860	2,506.63	13,247,299.13	3.92	324,796,258.09	96.08

注：(1) 嘉实新兴市场 A1: 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新兴市场 A1 份额占嘉实新兴市场 A1 总份额比例、个人投资者持有嘉实新兴市场 A1 份额占嘉实新兴市场 A1 总份额比例；

(2) 嘉实新兴市场 C2: 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新兴市场 C2 份额占嘉实新兴市场 C2 总份额比例、个人投资者持有嘉实新兴市场 C2 份额占嘉实新兴市场 C2 总份额比例。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实新兴市场 A1	73,203.14	0.02
	嘉实新兴市场 C2	16,395.66	0.09
	合计	89,598.80	0.03

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实新兴市场 A1	0
	嘉实新兴市场 C2	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实新兴市场 A1	0
	嘉实新兴市场 C2	0

	合计		0
--	----	--	---

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2
基金合同生效日 (2015 年 11 月 26 日) 基金份额总额	584,694,687.00	58,385,086.01
本报告期期初基金份 额总额	1,080,470,808.86	24,030,416.35
本报告期基金总申购 份额	1,330,879,807.35	4,156,637.41
减：本报告期基金总 赎回份额	2,092,437,624.89	9,056,487.86
本报告期基金拆分变 动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份 额总额	318,912,991.32	19,130,565.90

§ 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

2020 年 1 月 3 日本基金管理人发布《关于增聘嘉实新兴市场债券基金经理的公告》，聘请国歌 (Guo Ge) 女士担任本基金经理，与关子宏先生共同管理本基金。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 120,000.00 元，该审计机构已连续 6 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

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	
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup	-	-	-	-	-	

Global Markets Asia Limited						
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	
巴克莱 Barclays	-	-	-	-	-	
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	
渣打(伦敦)银行	-	-	-	-	-	

Standard Chartered Bank London						
澳新银行集团 Australia and New Zealand Banking Group	-	-	-	-	-	
法国巴黎兴业银 行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	
德意志银行股份 有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	
野村国际（香港） 有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
瑞士信贷（香港） 有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
Liquidity Finance LLP	-	-	-	-	-	
俄罗斯天然气工	-	-	-	-	-	

业银行 GAZPROMBANK						
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	-	-	-	-	-	-
荷兰商业银行 ING Bank N.V.	-	-	-	-	-	-
BANCO SANTANDER, S. A	-	-	-	-	-	-
日兴证券 SMBC Nikko Capital Markets Limited	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有 限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券(香 港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong)Limited	-	-	-	-	-	-
香港独立债券及 贷款交易公司 SC Lowy Financial(HK) Ltd	-	-	-	-	-	-
BCP Securities, LLC	-	-	-	-	-	-

华泰金融控股(香港)有限公司	-	-	-	-	-	
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	-	-	-	-	-	
第一阿布扎比银行 First Abu Dhabi Bank PJSC, Hong Kong	-	-	-	-	-	
农业信贷银行 Credit Agricole Corporate and investment bank	-	-	-	-	-	
三菱 UFJ 证券国际有限公司 Mitsubishi UFJ Securities International Plc	-	-	-	-	-	
中银香港 Bank of China Hong Kong	-	-	-	-	-	
Linear Investment Limited	-	-	-	-	-	

瑞士信贷证券(美国)有限责任公司 Credit Suisse Securities (USA) LLC	-	-	-	-	-	-
阿联酋资本 ARQAAM CAPITAL	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
工银国际证券有限公司 ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
俄罗斯联邦储蓄银行 Sberbank CIB (UK) Limited	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
瑞信证券美国 Credit Suisse Securities (USA) LLC	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香	-	-	-	-	-	-

港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited						
凯万亚洲有限公 司 Oppenheimer Investments Asia Ltd	-	-	-	-	-	
CSI GLOBAL MARKETS LIMITED	-	-	-	-	-	
巴西布拉德斯科 银行 BRADESCO	-	-	-	-	-	
中国银行香港分 行 Bank of China Limited HK Branch	-	-	-	-	-	
中信证券国际有 限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	
招商证券（香港） 有限公司 China Merchants	-	-	-	-	-	

Securities (HK) Co., Ltd.						
苏格兰皇家银行 Royal Bank of Scotland Plc (RBS)	-	-	-	-	-	
尚乘资产管理有 限公司 AMTD Asset Management Limited	-	-	-	-	-	
凯基证券（香港） 有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
金贝塔证券有限 公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	
交通银行股份有 限公司香港分行 Bank of Communications Co., Ltd. HK Branch	-	-	-	-	-	
建银国际证券有	-	-	-	-	-	

有限公司 CCB International Securities Limited						
加拿大皇家银行 Royal Bank of Canada	-	-	-	-	-	
广发证券（香港） 经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	
工银国际控股有 限公司 ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	
法国外贸银行 NATIXIS	-	-	-	-	-	
法国巴黎证券(亚 洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	
俄罗斯外贸银行 资本公司 VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	
东方汇理 CREDIT AGRICOLE CORPORATE AND	-	-	-	-	-	

INVESTMENT BANK						
德国商业银行 Commerzbank AG	-	-	-	-	-	-
渤海证券 Bohai Securities Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-
澳大利亚国民银 行 National Bank of Australia	-	-	-	-	-	-
J.P. 摩根资本顾 问有限公司 Morgan Capital Advisors LLP	-	-	-	-	-	-
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO., LTD	-	-	-	-	-	-
中信银行（国际） 有限公司 China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	-

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；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

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。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期 基金 成交总 额的比例
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	1,145,908,247.97	11.67%	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	1,077,880,617.12	10.98%	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	1,020,210,375.36	10.39%	-	-	-	-	-	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	853,805,371.30	8.70%	-	-	-	-	-	-
巴克莱 Barclays	743,077,147.26	7.57%	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	597,303,944.77	6.08%	-	-	-	-	-	-
高盛(亚洲)有限	537,039,079.85	5.47%	-	-	-	-	-	-

责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C								
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	448,697,951.93	4.57%	-	-	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲 有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	372,055,284.87	3.79%	-	-	-	-	-	-
渣打(伦敦)银行 Standard Chartered Bank London	362,692,550.64	3.69%	-	-	-	-	-	-
澳新银行集团 Australia and New Zealand Banking Group	344,958,372.99	3.51%	-	-	-	-	-	-
法国巴黎兴业银 行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	287,302,713.91	2.93%	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份 有限公司 Deutsche Bank	276,173,970.66	2.81%	-	-	-	-	10,182,444.90	100.00%
野村国际(香港) 有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	275,996,297.38	2.81%	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷(香港) 有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	247,173,108.69	2.52%	-	-	-	-	-	-
Liquidity Finance LLP	164,373,092.32	1.67%	-	-	-	-	-	-
俄罗斯天然气工 业银行 GAZPROMBANK	113,509,045.12	1.16%	-	-	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo	106,606,331.88	1.09%	-	-	-	-	-	-

Securities LLC									
荷兰商业银行 ING Bank N.V.	90,082,272.17	0.92%	-	-	-	-	-	-	-
BANCO SANTANDER, S.A	83,998,981.85	0.86%	-	-	-	-	-	-	-
日兴证券 SMBC Nikko Capital Markets Limited	79,343,231.75	0.81%	-	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有 限公司 Mizuho Securities Asia Limited	63,935,442.73	0.65%	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券(香 港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong)Limited	56,264,472.47	0.57%	-	-	-	-	-	-	-
香港独立债券及 贷款交易公司 SC Lowy Financial(HK) Ltd	52,658,771.95	0.54%	-	-	-	-	-	-	-
BCP Securities, LLC	48,133,478.64	0.49%	-	-	-	-	-	-	-
华泰金融控股(香 港)有限公司	45,649,704.29	0.46%	-	-	-	-	-	-	-
海通国际证券有 限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	42,682,859.38	0.43%	-	-	-	-	-	-	-
第一阿布扎比银 行 First Abu Dhabi Bank PJSC, Hong Kong	38,390,840.46	0.39%	-	-	-	-	-	-	-
农业信贷银行 Credit Agricole Corprate and investment bank	33,013,038.08	0.34%	-	-	-	-	-	-	-

三菱 UFJ 证券国际有限公司 Mitsubishi UFJ Securities International Plc	32,047,762.62	0.33%	-	-	-	-	-	-
中银香港 Bank of China Hong Kong	30,810,546.62	0.31%	-	-	-	-	-	-
Linear Investment Limited	30,110,005.81	0.31%	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷证券(美国)有限责任公司 Credit Suisse Securities (USA) LLC	28,237,892.91	0.29%	-	-	-	-	-	-
阿联酋资本 ARQAAM CAPITAL	27,317,516.32	0.28%	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	18,690,758.67	0.19%	-	-	-	-	-	-
工银国际证券有限公司 ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	15,248,334.02	0.16%	-	-	-	-	-	-
俄罗斯联邦储蓄银行 Sberbank CIB (UK) Limited	12,139,188.04	0.12%	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	7,814,734.94	0.08%	-	-	-	-	-	-
瑞信证券美国 Credit Suisse Securities (USA) LLC	3,688,445.05	0.04%	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International	3,546,769.43	0.04%	-	-	-	-	-	-

Capital Corporation Hong Kong Securities Limited								
凯万亚洲有限公司 Oppenheimer Investments Asia Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CSI GLOBAL MARKETS LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
巴西布拉德斯科银行 BRADESCO	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银行香港分行 Bank of China Limited HK Branch	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
苏格兰皇家银行 Royal Bank of Scotland Plc (RBS)	-	-	-	-	-	-	-	-
尚乘资产管理有限公司 AMTD Asset Management Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
凯基证券（香港）有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
交通银行股份有限公司香港分行 Bank of Communications Co., Ltd. HK Branch	-	-	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
加拿大皇家银行 Royal Bank of Canada	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
工银国际控股有限公司 ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
法国外贸银行 NATIXIS	-	-	-	-	-	-	-	-
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
俄罗斯外贸银行 资本公司 VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-	-	-
东方汇理 CREDIT AGRICOLE CORPORATE AND INVESTMENT	-	-	-	-	-	-	-	-

BANK								
德国商业银行 Commerzbank AG	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券 Bohai Securities Co. Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
澳大利亚国民银行 National Bank of Australia	-	-	-	-	-	-	-	-
J. P. 摩根资本顾问有限公司 Morgan Capital Advisors LLP	-	-	-	-	-	-	-	-
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO., LTD	-	-	-	-	-	-	-	-
中信银行（国际） 有限公司 China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于增聘嘉实新兴市场债券基金经理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月03日
2	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月14日
3	嘉实基金管理有限公司关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月02日
4	关于嘉实新兴市场 2020 年 4 月 10 日至 4 月 13 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月08日
5	关于嘉实新兴市场 2020 年 4 月 30 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月28日
6	关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金	证券时报、基金管理人	2020年06月29日

	金 2020 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定投业务公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
7	关于嘉实新兴市场债券 2020 年 10 月 13 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 14 日
8	关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年 10 月 26 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 22 日
9	关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年 12 月 24 日、12 月 25 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 22 日
10	关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年 12 月 31 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 12 月 29 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020/03/16 至 2020/03/25, 2020/08/05 至 2020/08/12, 2020/08/19 至 2020/08/19	-	179,675,702.73	179,675,702.73	-	-
	2	2020/08/31 至 2020/08/31	-	133,095,151.29	133,095,151.29	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

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

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会《关于核准嘉实新兴市场债券型证券投资基金募集的批复》;
- (2) 《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实新兴市场债券型证券投资基金招募说明书》;
- (4) 《嘉实新兴市场债券型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) 报告期内嘉实新兴市场债券型证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 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

13.3 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

2021 年 3 月 30 日