

嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证  
券投资基金  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	48
7.11 投资组合报告附注 .....	48
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	50
8.3 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 .....	50
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	51
10.4 基金投资策略的改变 .....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
11.1 备查文件目录 .....	55
11.2 存放地点 .....	55
11.3 查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金
基金简称	嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券
基金主代码	011168
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 20 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	307,282,082.64 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过债券及股票主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	资产配置策略：本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化进行动态调整。债券投资策略：本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，力争获取较高的投资收益。股票投资策略：本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合、精选行业和个股的策略。以公司行业研究员的基本面分析为基础，同时结合基金经理的分析与判断，精选价值被低估的投资品种。本基金其他投资策略包括国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%（人民币计价）+中债新综合财富指数收益率×85%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	张燕
	联系电话	(010)65215588	0755-83199084
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555

传真	(010)65215588	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100005	518040
法定代表人	经雷	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-5,472,950.87
本期利润	-7,260,967.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0238
本期加权平均净值利润率	-2.34%
本期基金份额净值增长率	-2.27%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	2,960,771.31
期末可供分配基金份额利润	0.0096
期末基金资产净值	317,795,651.13
期末基金份额净值	1.0342
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	3.42%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额 本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.54%	0.32%	1.03%	0.17%	1.51%	0.15%
过去三个月	2.95%	0.32%	1.74%	0.21%	1.21%	0.11%
过去六个月	-2.27%	0.41%	0.60%	0.24%	-2.87%	0.17%
过去一年	2.21%	0.39%	1.75%	0.19%	0.46%	0.20%
自基金合同生效起至今	3.42%	0.38%	3.05%	0.19%	0.37%	0.19%

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：

$$\text{Return}(t) = 85\% * (\text{中债新综合财富指数}(t) / \text{中债新综合财富指数}(t-1) - 1) + 10\% * (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 5\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

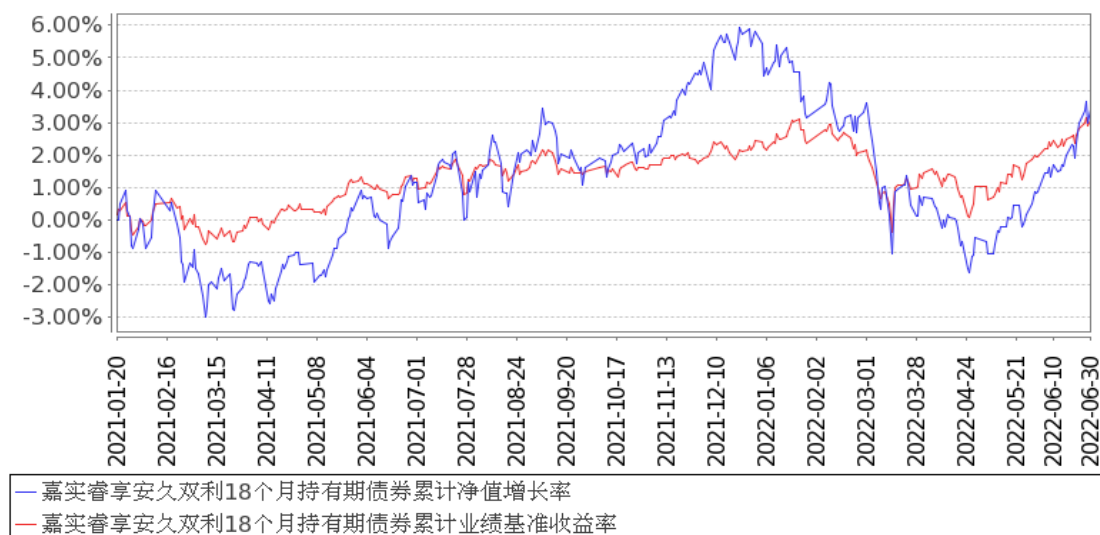
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

#### 嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券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

(2021年01月20日至2022年06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。

### 3.3 其他指标

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和特定资产管理业务等资格。

截止2022年6月30日，基金管理人共管理277只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 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		



余红	本基金基金经理	2021 年 1 月 20 日	-	10 年	曾任职于上海浦东发展银行股份有限公司北京分行国际业务部及中小企业业务经营中心。2012 年加入中邮创业基金管理股份有限公司，历任固定收益部研究员、基金经理助理、基金经理。2020 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司。具有基金从业资格，大学本科。中国国籍。
吴昊	本基金基金经理	2022 年 1 月 1 日	-	11 年	曾任宏源证券股份有限公司研究员，中邮创业基金管理有限公司基金经理，2020 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司任投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。

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行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实睿享安久双利 18 个月持有期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 4 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 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

权益方面，21 年底我们看到经济下行压力较大情况下政策环境较为正面，疫情随着奥密克戎毒性下降和小分子药推出后有望缓解，加之当时权重指数估值处于历史平均附近，因此我们总体保持了相对较高的仓位。之后市场受到预期之外的俄乌战争、疫情扩散、部分行业政策低于市场预期等影响，基于市场情况我们适当降低了股票持仓。2 季度前期，基于宏观经济和企业盈利有压力、疫情反复、市场面临波折的判断，组合总体保持了相对低的股票仓位。4 月底之后，我们看到政策对经济的强力支持，加以从自下而上角度可以寻找到较多的长期空间较大、动态估值较低的优质公司，组合较大幅度的增加了股票的持仓。

债券方面，21 年底债市收益率仍延续全年 Q3 以来的震荡形态。开年市场对于经济恢复预期好转，但是很快在俄乌冲突和上海疫情发酵下，一月份偏强的金融数据最后对于宽信用扰动偏弱，我们择机调整了部分持仓中收益率偏低的资产。二季度以来，流动性极度宽松，但是随着上海解封和稳增长措施的出台，“宽信用”和“弱修复”之间的博弈成为主线，考虑到中微观经济修复偏慢，消费偏弱，我们判断整体收益率很难突破 3% 的水平。这种环境下，主要操作思路就是用好杠杆，吃足 carry。转债方面，操作思路和权益较为类似。一季度市场受到预期之外的俄乌战争、疫情扩散、部分行业政策低于市场预期等影响，叠加转债自身的高估值，我们较早的开始降低转债的仓位；二季度开始，特别是 4 月底，政策对经济的强力支持，加之不少转债在杀估值之后已经呈现出向下空间有限，期权价值被低估的情况，我们较大幅度的增配了一些性价比高的优质转债。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0342 元；本报告期基金份额净值增长率为-2.27%，业绩比较基准收益率为 0.60%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益方面，今年上半年市场波动较大，但机会往往在波动中产生。地产、疫情、通胀、估值、盈利趋势、高仓位等曾是压制市场、导致上半年市场下跌的一些因素，但是这些因素中的多数当前正在变得积极。国内方面，疫情短期冲击高点已过，防疫政策逐步优化，多地实现解封、实行常态化核酸检测、新一版疫情防控方案出台等，叠加国内稳增长政策持续发力，国内生产需求和消费需求逐渐修复。房地产支持政策频出，有望使得地产基本面加速企稳，5 月以来中央层面政策力度显著加强，下调首套房房贷利率下限、超预期调降 5 年期 LPR 等；多数城市放松地产政策，如开放限购、降低首付比例与房贷利率、推出房票政策等，政策和信贷支持带动地产基本面企稳

回升。海外方面，今年以来，受到地缘冲突的扰动、新冠疫情的冲击以及通胀压力持续攀升等因素的影响，大宗商品价格持续走高，扰动全球资本市场。随着美联储加息进程加快，PCE 见顶回落，对全球经济衰退担心加剧，大宗商品开始回落，通胀担忧阶段性缓解。当前，核心指数估值大多处于历史中低水平，小盘股估值则处于历史底部区域，较多投资者仓位从 2021 年的高仓位变为中等仓位，市场悲观因素已在前期显著释放，伴随稳增长政策落地，货币及财政政策持续发力，基本面逐步恢复，市场有望迎来中长期震荡向上、结构性繁荣的行情。

债券方面，下半年随着疫情缓解、稳增长政策落地，经济将步入小复苏象限，微观活力略恢复。叠加美联储加息缩表的外部环境，债市面临的基本面环境略有弱化。货币政策面临更多元目标，结构性政策再唱主角，资金面预计略有收敛。这种环境下，债市绝对收益率水平和相对性价比不占优。下半年债市低波动将延续，十年期国债运行区间仍在 2.65-3.0%之间，纯债部分继续以票息策略为主。转债方面，转债性价比至少好于利率波段和信用下沉，但操作难度高于往年，投资上重择券不重仓。基于转债价值与正股预期的匹配度、保持平衡配置仍是较为稳妥的策略。

#### 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基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.7 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“6.4.11 利润分配情况”。

#### 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合规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,828,773.16	7,920,903.07
结算备付金		299,033.51	1,452,991.94
存出保证金		21,042.03	22,789.08
交易性金融资产	6.4.7.2	356,646,501.46	378,117,672.11
其中：股票投资		48,248,603.68	61,277,028.11
基金投资		-	-
债券投资		308,397,897.78	316,840,644.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		397,760.85	-
应收股利		11,113.60	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	3,856,573.95
资产总计		364,204,224.61	391,370,930.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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		46,006,602.44	68,500,000.00
应付清算款		-	2.58
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		180,079.40	190,628.98
应付托管费		38,588.44	40,849.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18,761.92	19,633.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	164,541.28	296,790.64
负债合计		46,408,573.48	69,047,904.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	307,282,082.64	304,598,251.86
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,513,568.49	17,724,773.51
净资产合计		317,795,651.13	322,323,025.37
负债和净资产总计		364,204,224.61	391,370,930.15

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0342 元，基金份额总额 307,282,082.64 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,254,867.37	5,676,918.73
1. 利息收入		40,559.45	3,657,052.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	27,452.56	55,989.23
债券利息收入		-	3,588,908.40
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		13,106.89	12,155.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,507,410.12	-1,604,142.41
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-7,588,193.93	-2,541,522.66
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,911,046.48	654,485.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	169,737.33	282,895.08
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-1,788,016.70	3,623,976.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	32.21
<b>减：二、营业总支出</b>		2,006,100.20	2,081,022.67
1. 管理人报酬		1,079,295.75	932,874.90
2. 托管费		231,277.66	199,901.77
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		571,042.74	680,853.67
其中：卖出回购金融资产支出		571,042.74	680,853.67
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		15,401.88	9,235.91
8. 其他费用	6.4.7.23	109,082.17	258,156.42

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-7,260,967.57	3,595,896.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-7,260,967.57	3,595,896.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-7,260,967.57	3,595,896.06

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	304,598,251.86	-	17,724,773.51	322,323,025.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	304,598,251.86	-	17,724,773.51	322,323,025.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,683,830.78	-	-7,211,205.02	-4,527,374.24
（一）、综合收益总额	-	-	-7,260,967.57	-7,260,967.57
（二）、本期基金份额交易产	2,683,830.78	-	49,762.55	2,733,593.33

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	2,683,830.78	-	49,762.55	2,733,593.33
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	307,282,082.64	-	10,513,568.49	317,795,651.13
项目	上年度可比期间 2021年1月20日(基金合同生效日)至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	304,598,251.86	-	-	304,598,251.86
加:会计政策变更	-	-	-	-



前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	304,598,251.86	-	-	304,598,251.86
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	3,595,896.06	3,595,896.06
(一)、综合收益总额	-	-	3,595,896.06	3,595,896.06
(二)、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)	-	-	-	-
其中:1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、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)				
(四)、 其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末 净资产(基金 净值)	304,598,251.86	-	3,595,896.06	308,194,147.92

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3517 号《关于准予嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于 2021 年 1 月 12 日至 2021 年 1 月 18 日向社会公开募集，基金合同于 2021 年 1 月 20 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 304,598,251.86 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 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于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

##### (2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处

于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

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

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考

虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,920,903.07 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 895.35 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 7,921,798.42 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,452,991.94 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 719.29 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,453,711.23 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 22,789.08 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 11.22 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 22,800.30 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,856,573.95 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 895.35 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 719.29 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 11.22 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 3,854,948.09 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 378,117,672.11 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 3,854,948.09 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 381,972,620.20 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 68,500,000.00 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 49,562.54 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 68,549,562.54 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 49,562.54 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 49,562.54 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 印花税

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

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

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股

票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

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

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

#### 6.4.6.4 个人所得税



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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	6,828,773.16
等于：本金	6,828,160.54
加：应计利息	612.62
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,828,773.16

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	46,313,454.43	-	48,248,603.68	1,935,149.25	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	238,142,504.15	2,997,297.42	246,044,880.24	4,905,078.67
	银行间市场	60,725,411.92	932,017.54	62,353,017.54	695,588.08
	合计	298,867,916.07	3,929,314.96	308,397,897.78	5,600,666.75
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	345,181,370.50	3,929,314.96	356,646,501.46	7,535,816.00	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	22,760.83
其中：交易所市场	22,760.83
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	141,780.45
合计	164,541.28

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	304,598,251.86	304,598,251.86
本期申购	2,683,830.78	2,683,830.78
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	307,282,082.64	307,282,082.64

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,400,940.81	9,323,832.70	17,724,773.51
本期利润	-5,472,950.87	-1,788,016.70	-7,260,967.57
本期基金份额交易产生的变动数	32,781.37	16,981.18	49,762.55
其中：基金申购款	32,781.37	16,981.18	49,762.55
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,960,771.31	7,552,797.18	10,513,568.49

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	18,328.57
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	8,857.58
其他	266.41
合计	27,452.56

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-7,588,193.93
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-

股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-7,588,193.93

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	52,688,275.28
减：卖出股票成本总额	60,138,653.79
减：交易费用	137,815.42
买卖股票差价收入	-7,588,193.93

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,721,676.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-810,629.67
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	3,911,046.48

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,458,871.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	66,108,403.76
减：应计利息总额	158,469.08
减：交易费用	2,628.54
买卖债券差价收入	-810,629.67

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	169,737.33
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	169,737.33

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-1,788,016.70
股票投资	-178,722.41
债券投资	-1,609,294.29
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,788,016.70

#### 6.4.7.21 其他收入

无。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,407.42
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
深港通证券组合费	294.30
合计	109,082.17

#### 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（“嘉实基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

#### 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 20 日（基金合 同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,079,295.75	932,874.90
其中：支付销售机构的客户维护费	273,607.83	47,972.55

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 0.70%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×0.70%/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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	231,277.66	199,901.77

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 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

无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 6.4.10.5.2 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2021 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

招商银行股份有限公司 活期	6,828,773.16	18,328.57	13,381,203.59	40,789.58
------------------	--------------	-----------	---------------	-----------

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022年6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 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 46,006,602.44 元，于 2022 年 7 月 4 日前先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

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

本基金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 risk 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，将风险控制可在可承受的范围内。

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	247,472,287.41	254,902,293.12
AAA 以下	34,812,344.61	36,480,850.88
未评级	-	-
合计	282,284,632.02	291,383,144.00

注：评级取自第三方评级机构。

#### 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

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,828,773.16	-	-	-	6,828,773.16
结算备付金	299,033.51	-	-	-	299,033.51
存出保证金	21,042.03	-	-	-	21,042.03
交易性金融资产	15,364,347.95	274,473,640.60	18,559,909.23	48,248,603.68	356,646,501.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	397,760.85	397,760.85
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	11,113.60	11,113.60
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	22,513,196.65	274,473,640.60	18,559,909.23	48,657,478.13	364,204,224.61
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	46,006,602.44	-	-	-	46,006,602.44
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	180,079.40	180,079.40
应付托管费	-	-	-	38,588.44	38,588.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	18,761.92	18,761.92
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,541.28	164,541.28
负债总计	46,006,602.44	-	-	401,971.04	46,408,573.48
利率敏感度缺口	-23,493,405.79	274,473,640.60	18,559,909.23	48,255,507.09	317,795,651.13

上年度末 2021 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	7,920,903.07	-	-	-	7,920,903.07
结算备付金	1,452,991.94	-	-	-	1,452,991.94
存出保证金	22,789.08	-	-	-	22,789.08
交易性金融资产	16,362,251.64	287,739,533.84	12,738,858.52	61,277,028.11	378,117,672.11
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	-	-	-	3,856,573.95	3,856,573.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,758,935.73	287,739,533.84	12,738,858.52	65,133,602.06	391,370,930.15
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	68,500,000.00	-	-	-	68,500,000.00
应付证券清算款	-	-	-	2.58	2.58
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	190,628.98	190,628.98
应付托管费	-	-	-	40,849.09	40,849.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	50,036.32	50,036.32
应付税费	-	-	-	19,633.49	19,633.49
应付利息	-	-	-	49,562.54	49,562.54
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	197,191.78	197,191.78
负债总计	68,500,000.00	-	-	547,904.78	69,047,904.78
利率敏感度缺口	-42,741,064.27	287,739,533.84	12,738,858.52	64,585,697.28	322,323,025.37

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月	

			31 日 )
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,488,036.92	-1,840,483.40
	市场利率下降 25 个基点	1,502,363.48	1,858,555.33

#### 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汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	8,622,222.27	-	8,622,222.27
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	8,622,222.27	-	8,622,222.27
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-

衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	8,622,222.27	-	8,622,222.27
	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
项目	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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	12,122,264.95	-	12,122,264.95
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	12,122,264.95	-	12,122,264.95
以外币计价的负债				



应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
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	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	12,122,264.95	-	12,122,264.95

#### 6.4.13.4.2.2 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	431,111.11	606,113.25
	所有外币相对人民币贬值 5%	-431,111.11	-606,113.25

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	48,248,603.68	15.18	61,277,028.11	19.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	48,248,603.68	15.18	61,277,028.11	19.01

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	24,342,572.51	30,153,677.20
	业绩比较基准下降5%	-24,342,572.51	-30,153,677.20

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 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。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	98,123,269.40	122,912,172.11
第二层次	258,523,232.06	255,205,500.00
第三层次	-	-
合计	356,646,501.46	378,117,672.11

### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

## § 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	权益投资	48,248,603.68	13.25
	其中：股票	48,248,603.68	13.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	308,397,897.78	84.68
	其中：债券	308,397,897.78	84.68
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	7,127,806.67	1.96
8	其他各项资产	429,916.48	0.12
9	合计	364,204,224.61	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 8,622,222.27 元，占基金资产净值的比例为 2.71%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,361,574.61	9.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	515,212.00	0.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,324,395.00	1.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,425,199.80	1.39
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	39,626,381.41	12.47

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	680,389.16	0.21
非必需消费品	1,195,760.87	0.38
必需消费品	2,301,316.29	0.72
能源	841,506.96	0.26
金融	-	-
医疗保健	3,603,248.99	1.13
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	8,622,222.27	2.71

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688017	绿的谐波	23,862	2,839,578.00	0.89
2	2269 HK	药明生物	38,200	2,345,580.92	0.74
3	291 HK	华润啤酒	46,000	2,301,316.29	0.72
4	603566	普莱柯	79,100	2,114,343.00	0.67
5	603259	药明康德	19,200	1,996,608.00	0.63
6	600702	舍得酒业	9,400	1,917,506.00	0.60
7	002484	江海股份	80,800	1,885,872.00	0.59
8	300354	东华测试	56,800	1,826,120.00	0.57
9	300750	宁德时代	3,400	1,815,600.00	0.57
10	300083	创世纪	155,300	1,785,950.00	0.56
11	300416	苏试试验	66,210	1,627,441.80	0.51
12	603008	喜临门	44,300	1,625,810.00	0.51
13	600809	山西汾酒	5,000	1,624,000.00	0.51
14	600570	恒生电子	32,500	1,415,050.00	0.45
15	6078 HK	海吉亚医疗	28,200	1,257,668.07	0.40
16	3690 HK	美团-W	7,200	1,195,760.87	0.38
17	300041	回天新材	66,400	1,153,368.00	0.36
18	688665	四方光电	7,538	1,115,624.00	0.35
19	600426	华鲁恒升	37,400	1,092,080.00	0.34
20	300454	深信服	9,300	965,154.00	0.30
21	601799	星宇股份	5,500	940,500.00	0.30

22	002415	海康威视	24,500	886,900.00	0.28
23	603501	韦尔股份	5,000	865,150.00	0.27
24	688166	博瑞医药	35,635	860,585.25	0.27
25	1171 HK	兖矿能源	40,000	841,506.96	0.26
26	688311	盟升电子	13,489	815,275.16	0.26
27	000568	泸州老窖	3,300	813,582.00	0.26
28	600439	瑞贝卡	294,800	807,752.00	0.25
29	300347	泰格医药	7,000	801,150.00	0.25
30	600559	老白干酒	25,100	720,119.00	0.23
31	002439	启明星辰	34,500	687,585.00	0.22
32	3888 HK	金山软件	26,000	680,389.16	0.21
33	300395	菲利华	14,700	661,500.00	0.21
34	300369	绿盟科技	62,200	654,344.00	0.21
35	300351	永贵电器	36,400	607,880.00	0.19
36	300379	东方通	34,200	602,262.00	0.19
37	000657	中钨高新	39,600	594,000.00	0.19
38	603517	绝味食品	9,500	549,290.00	0.17
39	002120	韵达股份	30,200	515,212.00	0.16
40	688116	天奈科技	2,615	443,190.20	0.14

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300354	东华测试	3,177,118.00	0.99
2	688017	绿的谐波	2,913,554.63	0.90
3	600570	恒生电子	2,670,654.00	0.83
4	291 HK	华润啤酒	2,407,725.18	0.75
5	2269 HK	药明生物	2,402,740.83	0.75
6	603566	普莱柯	2,201,081.00	0.68
7	300083	创世纪	2,195,301.00	0.68
8	002484	江海股份	2,181,395.98	0.68
9	600426	华鲁恒升	1,886,596.00	0.59
10	603259	药明康德	1,879,302.00	0.58
11	300369	绿盟科技	1,579,153.00	0.49
12	300750	宁德时代	1,560,499.00	0.48
13	600702	舍得酒业	1,547,353.00	0.48
14	300416	苏试试验	1,498,428.80	0.46
15	300347	泰格医药	1,257,536.00	0.39
16	3690 HK	美团-W	1,122,529.79	0.35
17	300454	深信服	929,140.00	0.29
18	300041	回天新材	924,818.00	0.29

19	688665	四方光电	910,541.73	0.28
20	601799	星宇股份	797,695.00	0.25

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688075	安旭生物	4,741,308.57	1.47
2	002128	电投能源	3,187,742.00	0.99
3	002415	海康威视	2,779,146.00	0.86
4	836 HK	华润电力	2,741,692.82	0.85
5	601985	中国核电	2,587,357.00	0.80
6	300750	宁德时代	2,460,891.94	0.76
7	603369	今世缘	2,263,061.00	0.70
8	300041	回天新材	2,227,456.00	0.69
9	1521 HK	方达控股	2,211,064.92	0.69
10	2380 HK	中国电力	1,713,723.58	0.53
11	603008	喜临门	1,571,336.00	0.49
12	600426	华鲁恒升	1,514,466.00	0.47
13	300369	绿盟科技	1,458,201.00	0.45
14	688559	海目星	1,363,947.16	0.42
15	002444	巨星科技	1,258,607.00	0.39
16	300083	创世纪	1,240,500.00	0.38
17	600702	舍得酒业	1,202,684.00	0.37
18	600887	伊利股份	1,128,363.00	0.35
19	688516	奥特维	1,087,712.12	0.34
20	600439	瑞贝卡	997,704.00	0.31

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	47,288,951.77
卖出股票收入（成交）总额	52,688,275.28

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,364,347.95	4.83
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,748,917.81	3.38
	其中：政策性金融债	10,748,917.81	3.38
4	企业债券	180,805,866.57	56.89
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	51,604,099.73	16.24
7	可转债（可交换债）	49,874,665.72	15.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	308,397,897.78	97.04

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127863	18 苏交 04	200,000	20,975,479.45	6.60
2	155016	18 电投 11	200,000	20,919,469.59	6.58
3	102002066	20 汇金 MTN010A	200,000	20,732,219.18	6.52
4	152590	20 京投 03	200,000	20,716,932.60	6.52
5	136856	16 光控 04	200,000	20,692,465.75	6.51

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

无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	21,042.03
2	应收清算款	397,760.85
3	应收股利	11,113.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	429,916.48

#### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110068	龙净转债	4,952,002.42	1.56
2	127049	希望转 2	3,256,211.17	1.02
3	110053	苏银转债	2,860,993.98	0.90
4	128081	海亮转债	2,537,185.88	0.80
5	128139	祥鑫转债	2,305,565.19	0.73
6	128121	宏川转债	1,674,146.62	0.53
7	128137	洁美转债	1,671,929.11	0.53
8	128141	旺能转债	1,641,295.81	0.52
9	110047	山鹰转债	1,582,406.98	0.50
10	123107	温氏转债	1,396,169.91	0.44
11	123085	万顺转 2	1,242,623.28	0.39
12	113048	晶科转债	1,203,834.71	0.38
13	113052	兴业转债	1,075,396.87	0.34
14	111000	起帆转债	1,059,162.19	0.33
15	128135	洽洽转债	970,270.53	0.31
16	128119	龙大转债	917,371.19	0.29
17	127027	靖远转债	645,872.71	0.20
18	113609	永安转债	644,405.22	0.20
19	127033	中装转 2	630,582.92	0.20
20	123087	明电转债	624,399.09	0.20
21	123063	大禹转债	507,875.90	0.16
22	127040	国泰转债	455,102.72	0.14
23	113629	泉峰转债	442,841.01	0.14
24	128132	交建转债	348,593.86	0.11

#### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 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

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 (%)
2,068	148,589.01	62,492,320.00	20.34	244,789,762.64	79.66

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	18,754,748.18	6.10

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	>=100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2021 年 1 月 20 日) 基金份额总额	304,598,251.86
本报告期期初基金份额总额	304,598,251.86
本报告期基金总申购份额	2,683,830.78
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	307,282,082.64

## § 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

2022 年 1 月 1 日本基金管理人发布《关于新增嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券基金经理的公告》，增聘吴昊先生担任本基金基金经理，与余红女士共同管理本基金。

2022 年 5 月 12 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》，龚

康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，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，会计师事务所为安永华明会计师事务所（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，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	2	40,318,155.05	40.33	25,451.96	39.66	-
长江证券股份有限公司	2	37,681,924.10	37.69	23,788.17	37.07	-
中信证券股份有限公司	2	15,477,205.96	15.48	10,834.21	16.88	-
民生证券股份有限公司	2	6,488,325.94	6.49	4,096.12	6.38	-
国盛证券有限责任公司	2	11,616.00	0.01	7.33	0.01	-

公司						
安信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
南京证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：首创证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，华鑫证券有限责任公司新增交易单元 1 个，民生证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投证券股份有限公司	40,026,552.22	33.21	464,300,000.00	57.94	-	-
长江证券股份有限公司	53,634,640.51	44.50	236,700,000.00	29.54	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	23,938,131.37	19.86	83,300,000.00	10.40	-	-
国盛证券有限责任公司	2,941,246.59	2.44	17,000,000.00	2.12	-	-

公司						
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
南京证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中银国际 证券股份 有限公司						

## 10.8 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	关于新增嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券基金经理的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 1 日
2	关于嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金开放日常申购、转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 4 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 21 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 12 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金注册的批复文件;
- (2) 《嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 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

### 11.3 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

2022 年 8 月 29 日