

嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 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

报告送出日期：2019 年 4 月 20 日

重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2019 年 4 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

嘉实新兴市场债券型证券投资基金是由嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金转型而成。根据《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金的两年运作期届满日为 2015 年 11 月 26 日，原嘉实新兴市场 A、嘉实新兴市场 B 分级运作终止，嘉实新兴市场 A 转换为嘉实新兴市场 C2，嘉实新兴市场 B 转换为嘉实新兴市场 A1，并更名为“嘉实新兴市场债券型证券投资基金”。本基金转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，基金合同、托管协议以及招募说明书等法律文件名称将一并变更，投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、投资管理程序等将保持不变。

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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 144,948,159.00 份 |
| 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 | 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。 |

| | | |
|-----------------|---|-----------------|
| 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。 | |
| 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 | |
| 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 | 119,999,583.67 份 | 24,948,575.33 份 |
| 境外资产托管人 | 英文名称: The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited | |
| | 中文名称: 香港上海汇丰银行有限公司 | |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币

元

| 主要财务指标 | 报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日) | 报告期(2019年1月1日 - 2019年3月31日) |
|-----------------|-----------------------------|-----------------------------|
| | 嘉实新兴市场 A1 | 嘉实新兴市场 C2 |
| 1. 本期已实现收益 | 1,693,159.62 | 3,098,343.49 |
| 2. 本期利润 | 3,747,810.59 | 7,933,247.42 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0527 | 0.3121 |
| 4. 期末基金资产净值 | 150,311,191.07 | 196,151,024.58 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.253 | 1.168 |

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）本基金已于 2015 年 11 月 26 日对原嘉实新兴市场 A 和嘉实新兴市场 B 份额实施了转换。嘉实新兴市场 A 转换为嘉实新兴市场 C2；嘉实新兴市场 B 转换为嘉实新兴市场 A1；（4）本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，嘉实新兴市场 A1 份额以人民币计价并申购，收取申

购、赎回费。嘉实新兴市场 C2 份额以美元计价并申购，计提销售服务费，不收取申购费；（5）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 本报告期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 | 净值增长率 ① | 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 | 4.33% | 0.25% | 0.62% | 0.01% | 3.71% | 0.24% |

嘉实新兴市场 C2

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 6.18% | 0.13% | 0.62% | 0.01% | 5.56% | 0.12% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



图 1：嘉实新兴市场 A1 份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图（2015 年 11 月 26 日至 2019 年 3 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



图 2：嘉实新兴市场 C2 份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015 年 11 月 26 日至 2019 年 3 月 31 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“第十五部分（二）投资范围和（四）投资限制”的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2013 年 11 月 26 日 | - | 18 年 | 经济学硕士，特许金融分析师，在 2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司，现就任于嘉实基金固定收益部并兼任嘉实国际固定收益投资总监。关先生在亚洲固定收益、美元信用债、全球债券组合和外汇投资方面具有超过 12 年的经验，曾就职于霸菱资产管理（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。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：（1）任职日期是指本基金基金合同生效之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2019 年一季度全球经济增速有所放缓，市场主要关注中美经贸磋商、华为向美国联邦法院提起诉讼、美国政府关门、美国总统特朗普与朝鲜最高领导人金正恩会谈、英国脱欧谈判和英国议会三次否决首相梅的脱欧协议、西班牙政府预算法案被否决使得西班牙面临四年里的第三次大选、MSCI 决定将 A 股大盘股纳入因子提高、大湾区发展规划、美债收益率曲线出现倒挂等事件。

货币和财政政策方面，经济前景面临的不确定性增加，收紧信号下降。美联储 2019 年首个 FOMC 会议暂不加息，联邦基金利率目标区间为 2.25%-2.5% 不变，发出了暂停加息的最强信号，声明承诺对进一步加息有耐心，不排除重启 QE。美联储预计今年内不加息，9 月末停止缩表。多数联储官员的预期今年加息次数从两次降至零，令市场意外。联储再度下调今明两年 GDP 和通胀预期，拟今年 5 月起将美债缩表规模减半。鲍威尔称，美联储将保持耐心和观望状态。希望维护美国经济强劲增长的前景，目前就业市场强劲，通胀接近 2% 目标，预期 2019 年美国经济增长坚实，但小于 2018 年过于强劲的涨势。美国财政部表示，由于支出增加且收入几乎没有变化，美国政府 2019 财年一季度预算赤字扩大至 3190 亿美元。欧洲央行放鸽，宣布 9 月推出新的 TLTRO 预期年内无加息可能，下调了欧元区的经济增速预期和通胀预期。欧央行行长德拉吉称，短期前景较预期更差且偏向下行，受地缘政治、保护主义和新兴市场脆弱的不确定性打压，准备好在必要时行动。脱欧日期尚无定论之际，英国央行维持政策利率 0.75% 不变，与市场预期一致；并下调了 2019 年和 2020 年经济增长预期。2019 年 GDP 增速预期削减幅度为 2016 年 8 月以来最大，表明 2019 年经济增速或将为 2009 年以来最低。自去年 9 月加息开启了货币政策紧缩以来，挪威央行一致同意加息 25 个基点，将基准利率提升至 1%。行长 Olsen 认为，6 月再加息一次的可能性高于 50%，年底前可能再度加息。澳洲联储维持利率在 1.5%，连续 27 个月不变，但称下行风险已经上升。新西兰预计将维持 OCR 在当前水平至 2020 年，但新西兰联储推迟加息预期，现预计将在 2021 年一季度加息，此前预期为 2020 年三季度。在新任行长的首个货币政策会议上，印度央行意外宣布降息。市场分析称通胀放缓让政策制定者有空间支持政府刺激经济增长。此前印度政府通过扩张性预算，其中包括大选前 130 亿美元的消费者刺激计划。日本央行维持政策利率在 -0.1%，符合预期，但将 2019 财年核心 CPI 预期从 1.4% 下调至 0.9%。黑田东彦还称，央行有多种宽松的选择，如降息、加快购买国债，如需要可能综合使用。中国政府工作报告：李克强表示，今年 GDP 增速预期目标为 6%~6.5%；加大对中小银行定向降准力度，今年国有大型商业银行小微企业贷款要增长 30% 以上；深化增值税改革，将制造业等行业现行 16% 的税率降至 13%；健全地方税体系，稳步推进房地产税立法；全年减轻企业税收和社保缴费负担近 2 万亿元。发达经济体经济复苏势头放缓，下行压力日益凸显。OECD 在最新公布的全球经济展望报告中称，

2019 年全球经济增速预测值下调至 3.3%，较去年 11 月下调 0.2 个百分点，2020 年同样下调 0.1 个百分点。美国四季度 GDP 增速下修至 2.2%，略不及预期。就全年数据来看，美国 2018 年经济增速为 2.9%，为 2015 年以来最高，但略低于特朗普政府设定的 3% 的年度目标。美国 2 月 CPI 环比增长 0.2%，为四个月来首次上涨。美国 2 月 PPI 环比上涨 0.1%，扭转了连续两月的下滑趋势。美 2 月非农大跌，新增就业仅 2 万，创 17 个月新低，时薪同比增速十年最高。欧元区 2 月制造业 PMI 初值跌破荣枯线，为 2013 年 6 月以来首次，制造业新订单降幅创近六年来最大。德国 3 月制造业 PMI 初值为 44.7，创下 79 个月低点。中国 2 月官方制造业 PMI 环比下滑 0.3 个百分点至 49.2，不及预期的 49.4，连续第三个月位于枯荣线下方。中国 2 月财新服务业 PMI 录得 51.1 为 2018 年 11 月以来新低，且低于历史均值。

2019 年一季度全球主要发达国家股市上涨。美国 10 年期国债收益率下降，一季度末收益率为 2.406%，相比 2019 年末下跌 27.9 个基点。人民币升值，在岸人民币兑美元 6.7121，离岸人民币 6.7232。

一月，10 年期国债从 1 月 1 号的 2.63% 收益和月末收益持平。市场对加息依然觉得会有 1 至 2 次的加息机会，利率当月波动较大~20 基点。

二月，10 年期国债从 2 月份收益也从 2.68% 上涨了 3 个基点至 2.71%。由于全球增长和通胀预期的下滑抑制了市场多头并刺激了对政府债务的需求，因此 2019 年大部分时间内 10 年期国债收益率已锁定在 2.6% 至 2.8% 之间。美国与中国的贸易谈判正在进行中美贸易谈判，这对全球两大经济体来说是非常重要的，这些谈判使得世界上两个最大的经济体通过关税和其他措施相互竞争。美国和中国正试图在 3 月初的最后期限之前解决他们在贸易方面的分歧。然而，总统特朗普表示这不是一个“神奇的约会”之后，人们猜测可能会扩大这一目标。

三月，10 年期国债收益下滑了 34 个基点至 2.40%。由于更多投资者对美联储将在 2019 年被迫降息的信心增强，3 个月期美国国债收益率较 10 年期收益率高出 5 个基点，收益率下降。继上周美联储下调美国经济前景后，国内和国际固定收益率一直承压。德国 10 年期国债收益率和日本 10 年期国债收益率均在周三下跌；德国自 2016 年以来首次出现 10 年期国债收益率为负收益率。

在基金操作上，基于我们对全球固守市场的判断，我们认为年初的市场宏观环境将有利于新兴市场从去年的抛售低谷中恢复并反弹。宽松的央行政策将尤其于长久期的债券的表现。所以我们在 1 月初开始持仓信用风险，并加长了久期。在 2 月份，我们在市场开始小幅震荡之前，进行了套利并减持了部分信用风险。在 3 月份，我们继续积极的参与一级市场的债券发行申购，根据各国大选和政治情况进行了部分国家的调整。减少了整个基金的久期。

嘉实新兴市场双币分级债券基金在 2019 年第 1 季度升值了 6.09%（用美元 C2 Class 计算）。

领先于摩根大通全球新兴市场企业债券指数的表现 (+0.98%)。离岸人民币在第 1 季度升值约 2.14%。

第 1 季度，摩根大通新兴市场债券指数 (cembi) 增长 5.11%。其中印尼 (+8.57%)，阿根廷 (+6.93%)，非洲 (+6.45%)，中国 (+6.14%)，印度 (+5.90%)，巴西 (+5.75%)，拉丁美洲 (+5.93%)，香港 (+5.42%) 等跑赢指数；韩国 (+3.29%)，中东 (+4.76%)，马来西亚 (+4.76%)，俄罗斯 (+4.55%) 等跑输指数。

基金在第 1 季度的表现 (+6.09%) (用美元 C2 Class 计算)，业绩在第一个季度跑赢基准的原因主要是对于宏观经济和全球固守环境，特别是新兴市场的判断。我们加持了去年被抛售过度的债券，如中国的企业债，印尼，非洲，土耳其的债券。在一些国家宏观经济有所改善和政治风险减少的时候加持了这些国家的债券，比如墨西哥，巴西。在油价恢复高位的第一季度，我们也逐渐增持了原油出口国的债券，比如中东国家。我们估计 2019 年第二季度市场会趋于平稳，伴随着短期震荡。然而我们会做好风控管理，避免基本面非常弱的债券。我们会继续参与一些定价吸引公司基本面强的新债，特别是一些已经在资本市场信誉良好的公司。

截至本报告期末嘉实新兴市场 A1 基金份额净值为 1.253 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.33%；截至本报告期末嘉实新兴市场 C2 基金份额净值为 1.168 美元，本报告期基金份额净值增长率为 6.18%；同期业绩比较基准收益率为 0.62%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额 (人民币元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|---------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：普通股 | - | - |
| | 优先股 | - | - |
| | 存托凭证 | - | - |
| | 房地产信托凭证 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 10,245,126.17 | 2.93 |
| 3 | 固定收益投资 | 268,723,762.37 | 76.80 |
| | 其中：债券 | 268,723,762.37 | 76.80 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | 95,378.90 | 0.03 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：远期 | 95,378.90 | 0.03 |
| | 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 | 48,422,429.96 | 13.84 |
| 8 | 其他资产 | 22,416,844.23 | 6.41 |
| 9 | 合计 | 349,903,541.63 | 100.00 |

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

| 债券信用等级 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| A+ | 4,269,840.28 | 1.23 |
| A | 4,759,150.27 | 1.37 |
| A- | 18,759,396.33 | 5.41 |
| AA- | 6,401,955.93 | 1.85 |
| BBB+ | 4,058,664.26 | 1.17 |
| BBB | 9,628,785.64 | 2.78 |
| BBB- | 41,996,617.30 | 12.12 |
| BB+ | 15,486,807.61 | 4.47 |
| BB | 20,104,614.23 | 5.80 |
| BB- | 33,663,339.71 | 9.72 |
| B+ | 19,195,720.40 | 5.54 |
| B | 54,612,906.94 | 15.76 |
| B- | 31,941,040.70 | 9.22 |
| CCC+ | 3,844,922.77 | 1.11 |

注：本基金持有的债券主要采用国际权威评级机构（标普、穆迪）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。

5.6 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（份） | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| 1 | XS1973241125 | YANGO JUSTICE INTL | 6,060,150.00 | 6,079,421.28 | 1.75 |
| 2 | USP6811TAA36 | MINSUR SA | 5,386,800.00 | 5,810,525.69 | 1.68 |
| 3 | XS1917569243 | SENAAT SUKUK LIMITED | 5,386,800.00 | 5,711,570.17 | 1.65 |
| 4 | USP2253TJE03 | CEMEX SAB DE CV | 4,713,450.00 | 4,842,457.13 | 1.40 |
| 5 | XS1937801212 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD | 4,713,450.00 | 4,803,005.55 | 1.39 |

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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.8 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金融衍生品投资明细

| 序号 | 衍生品类别 | 衍生品名称 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-------|--------------|------------|--------------|
| 1 | 远期投资 | 外汇远期（欧元对美元） | 249,924.09 | 0.07 |
| 2 | 远期投资 | 外汇远期（欧元对美元） | 105,850.62 | 0.03 |
| 3 | 远期投资 | 外汇远期（欧元对美元） | 28,280.70 | 0.01 |
| 4 | 远期投资 | 外汇远期（美元对欧元） | -51,561.37 | -0.01 |
| 5 | 远期投资 | 外汇远期（人民币对美元） | -83,122.55 | -0.02 |

5.9 报告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

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值（人民币元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--|--------|--------|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | Xtrackers II Harvest China Government Bond UCITS ETF | ETP 基金 | 交易型开放式 | DWS Investment SA | 10,245,126.17 | 2.96 |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只基金。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1

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

5.10.2

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（人民币元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 10,668,847.29 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,516,939.09 |
| 5 | 应收申购款 | 8,192,340.22 |
| 6 | 其他应收款 | 38,717.63 |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 22,416,844.23 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有股票及存托凭证。

§ 6 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 |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 52,065,810.99 | 25,747,601.57 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 77,202,449.23 | 429,928.13 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 9,268,676.55 | 1,228,954.37 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 119,999,583.67 | 24,948,575.33 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | 嘉实新兴市场 A1 | 嘉实新兴市场 C2 |
|---------------------------|-----------|-----------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | - | 76,532.14 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | - | 76,532.14 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | - | 0.31 |

注：报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 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。

8.2 存放地点

北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

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

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发电子邮件，E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2019 年 4 月 20 日