

嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

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：2019 年 08 月 29 日

§ 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。本半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 2019 年 8 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。

半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止。

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	629,916,715.86 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	605,958,874.13 份	23,957,841.73 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	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。

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

责人	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

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	香港上海汇丰银行有限公司
	英文	The HongkongandShanghai Banking Corporation Limited
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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金半年度报告备置地点	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层嘉实基金管理有限公司

§ 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(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2
本期已实现收益	7,510,533.62	6,079,851.69
本期利润	23,871,847.05	18,310,714.97
加权平均基金份额本期利润	0.1410	0.7358
本期加权平均净值利润率	11.02%	9.36%
本期基金份额净值增长率	10.07%	9.64%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	293,939,723.39	49,492,096.41
期末可供分配基金份额利润	0.4851	2.0658
期末基金资产净值	801,355,419.88	198,606,292.56
期末基金份额净值	1.322	1.206
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	32.20%	20.60%

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）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；（5）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。（6）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
过去一个月	2.16%	0.17%	0.21%	0.01%	1.95%	0.16%
过去三个月	5.51%	0.17%	0.63%	0.01%	4.88%	0.16%
过去六个月	10.07%	0.21%	1.25%	0.01%	8.82%	0.20%

过去一年	15.56%	0.25%	2.53%	0.01%	13.03%	0.24%
过去三年	22.29%	0.22%	7.79%	0.01%	14.50%	0.21%
自基金合同生效起至今	32.20%	0.22%	9.41%	0.01%	22.79%	0.21%

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
过去一个月	2.55%	0.13%	0.21%	0.01%	2.34%	0.12%
过去三个月	3.25%	0.12%	0.63%	0.01%	2.62%	0.11%
过去六个月	9.64%	0.13%	1.25%	0.01%	8.39%	0.12%
过去一年	10.74%	0.13%	2.53%	0.01%	8.21%	0.12%
过去三年	16.18%	0.13%	7.79%	0.01%	8.39%	0.12%
自基金合同生效起至今	20.60%	0.13%	9.41%	0.01%	11.19%	0.12%

注：本基金业绩比较基准为：同期人民币一年期定期存款利率+1%。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

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

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

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

其中 $t=1, 2, 3, \dots$ 。

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

嘉实新兴市场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 6 月 30 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

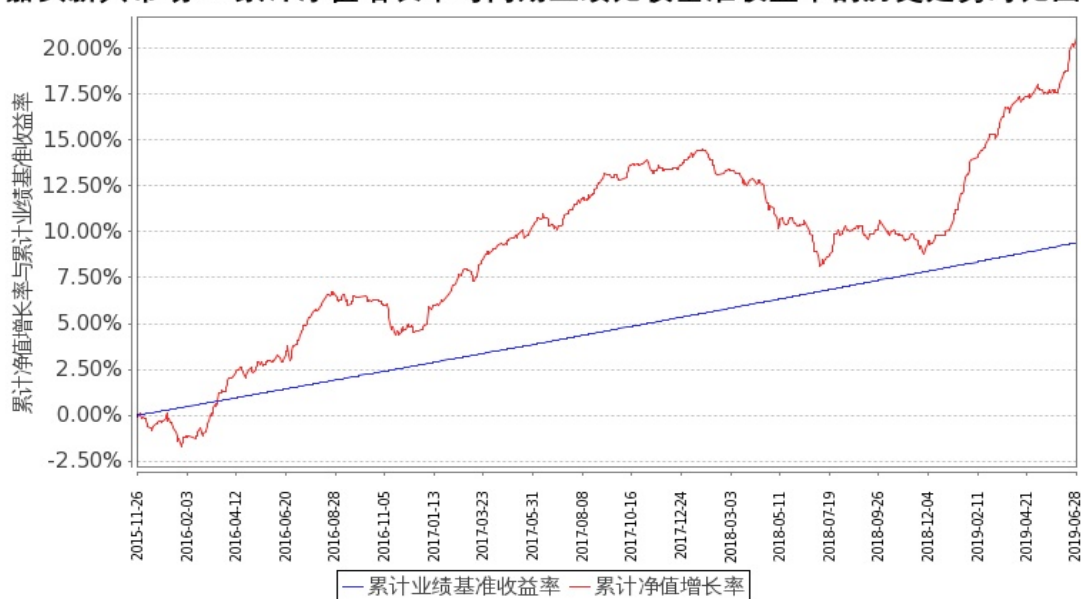


图 2：嘉实新兴市场 C2 份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2015 年 11 月 26 日至 2019 年 6 月 30 日)

注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同“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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止 2019 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 1 只封闭式证券投资基金、154 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票（QDII）混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数（QDII）、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数（LOF）、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实 1 个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债

债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、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。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	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 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，均为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，我们投资策略方面坚持风险加持的策略，做好风控管理，专注去年年底抛售过度，估值过低的债券。一季度，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。二季度在年初大涨过后我们选择在 4 月、5 月趋于稳健的投资方针。宽松的央行政策将尤其于长久期的债券的表现所以我们依然偏爱长久期债券。虽然中美贸易战升级，我们在 5 月初开始减仓信用风险，在 6 月份全球央行的宽松信号加强后，我们选择逐渐再次加持信用风险并增强久期。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。

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 C2 基金份额净值为 1.206 美元，本报告期基金份额净值增长率为 9.64%；截至本报告期末嘉实新兴市场 A1 基金份额净值为 1.322 元，本报告期基金份额净值增长率为 10.07%；业绩比较基准收益率为 1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在全球经济疲软和中美继续谈判的背景下，我们认为全球央行宽松的信号会继续进行，海外固收市场会继续收到宏观环境的支持，预计市场短期内会继续受正面情绪影响。我们认为美联储 7 月底会开始减息，今年到年底会减息两次。我们认为今年下半年的全球新兴市场债市会稳定继续偏利好，利差不断缩窄，债券波动较小。我们认为全球层面上的新兴市场企业的违约率也会保持较低水平。企业基本面会不断改善改善。市场债券的净发行量会继续保持低位，这也会对二级市场的债券价格也起到一定利好作用。我们投资策略方面会保持比上半年相对乐观兼保守的态度，做好风控管理，避免基本较弱的债券。也会看机会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。

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。在第二季度年初大涨过后我们选择在 4 月 5 月趋于稳健的投资方针。宽松的央行政策将尤其于长久期的债券的表现所以我们依然偏爱长久期债券。虽然中美贸易战升级，我们在 5 月初开始减仓信用风险，在 6 月份全球央行的宽松信号加强后，我们选择逐渐再次加持信用风险并增强久期。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。

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香港、新加坡、爱尔兰等基金投资市场的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

根据本基金基金合同（十九(三)基金收益分配原则）约定，本基金报告期内未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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。本报告期内，嘉实新兴市场债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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 2019 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实新兴市场债券型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	142,009,133.96	18,994,171.38
结算备付金		382,378.64	1,372,376.04
存出保证金		809,427.18	-
交易性金融资产	6.4.7.2	879,913,083.65	232,744,050.67
其中：股票投资		-	-
基金投资		9,911,782.42	10,089,317.23
债券投资		870,001,301.23	222,654,733.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	1,782,614.82
应收利息	6.4.7.5	12,064,870.23	3,191,892.03
应收股利		-	-
应收申购款		42,878,170.65	162,835.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,078,057,064.31	258,247,940.65
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	353,304.84	6,294.41
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		62,372,772.69	-
应付赎回款		14,267,003.70	544,871.91
应付管理人报酬		636,773.13	219,431.33
应付托管费		159,193.26	54,857.85
应付销售服务费		80,568.49	82,767.78
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		107,037.29	34,473.31
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	118,698.47	400,106.10
负债合计		78,095,351.87	1,342,802.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	622,899,663.88	196,798,414.45
未分配利润	6.4.7.10	377,062,048.56	60,106,723.51
所有者权益合计		999,961,712.44	256,905,137.96
负债和所有者权益总计		1,078,057,064.31	258,247,940.65

注： 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，嘉实新兴市场 A1 基金份额净值 1.322 元，基金份额总额 605,958,874.13 份；嘉实新兴市场 C2 基金份额净值 1.206 美元，基金份额总额 23,957,841.73 份。基金份额总额合计为 629,916,715.86 份。

6.2 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：2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		45,341,947.88	-9,753,890.88
1. 利息收入		10,992,503.85	7,325,815.20
其中：存款利息收入	6.4.7.11	151,411.98	46,492.95
债券利息收入		10,841,091.87	7,279,322.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,766,125.21	-16,496,739.58
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-2,906,708.88
基金投资收益	6.4.7.13	-	-207,543.35
债券投资收益	6.4.7.14	7,158,335.12	-15,362,165.43
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	355,127.70	1,882,749.34
股利收益	6.4.7.16	252,662.39	96,928.74
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	28,592,176.71	-685,365.80

4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.21	-2,268,215.72	92,549.98
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	259,357.83	9,849.32
减：二、费用		3,159,385.86	2,830,739.70
1. 管理人报酬		2,016,054.52	1,605,553.64
2. 托管费		504,013.55	401,388.41
3. 销售服务费		485,062.83	559,632.70
4. 交易费用	6.4.7.19	5,627.09	19,278.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		35,509.87	28,607.66
7. 其他费用	6.4.7.20	113,118.00	216,279.20
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		42,182,562.02	-12,584,630.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		42,182,562.02	-12,584,630.58

6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	196,798,414.45	60,106,723.51	256,905,137.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	42,182,562.02	42,182,562.02
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）	426,101,249.43	274,772,763.03	700,874,012.46
其中：1. 基金申购款	504,052,158.71	318,190,606.35	822,242,765.06
2. 基金赎回	-77,950,909.28	-43,417,843.32	-121,368,752.60

回款			
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）	622,899,663.88	377,062,048.56	999,961,712.44
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	294,269,927.60	92,212,179.65	386,482,107.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-12,584,630.58	-12,584,630.58
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）	-41,174,658.22	-58,856,082.44	-100,030,740.66
其中：1. 基金申购款	61,584,712.22	-41,079,931.24	20,504,780.98
2. 基金赎回款	-102,759,370.44	-17,776,151.20	-120,535,521.64
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）	253,095,269.38	20,771,466.63	273,866,736.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

王红

张公允

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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 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。

6.4.3 关联方关系

6.4.3.1 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。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司	境外资产托管人
德意志银行股份有限公司	与基金管理人股东处于同一控股集团

6.4.4 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。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.4.1.1 股票交易

本期（2019年1月1日至2019年6月30日）及上年度可比期间（2018年1月1日至2018年6月30日），本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.4.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30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	237,130,502.01	7.72	116,898,161.74	13.20
德意志银行股份有限公司	130,812,774.26	4.26	21,345,921.92	2.41

6.4.4.1.3 债券回购交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.4.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
德意志银行股份有限公司	5,820,119.42	100.00

注：本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.4.1.5 权证交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.4.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例（%）
德意志银行股份有限公司	2,910.04	17.11	-	-

注：（1）上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

（2）本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,016,054.52	1,605,553.64
其中：支付销售机构的客户维护费	769,539.18	626,570.14

注：支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 1 月 1 日 至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	504,013.55	401,388.41

注：支付基金托管人中国工商银行的基金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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.4.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2	合计
嘉实基金管理有限公司	-	1,489.41	1,489.41
中国工商银行	-	186,508.28	186,508.28
合计	-	187,997.69	187,997.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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	-	1,358.66	1,358.66
中国工商银行	-	207,238.41	207,238.41
合计	-	208,597.07	208,597.07

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。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。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2
期初持有的基金份额	-	76,532.14
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	76,532.14
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.32%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日	2018 年 01 月 01 日至 2018 年 06 月 30 日
	嘉实新兴市场 A1	嘉实新兴市场 C2
期初持有的基金份额	-	76,532.14
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	76,532.14
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.22%

注：本报告期内（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），基金管理人未运用自有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），其他关联方未持有本基金。

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	35,187,116.76	150,387.75	22,056,091.10	46,481.42
香港上海汇丰银行有限公司_活期	106,822,017.20	-	18,422,620.13	-

注：本基金的活期银行存款分别由基金托管人和境外资产托管人保管，按适用利率或约定利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日），本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 外汇远期交易

本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日				
关联方名称	项目	卖出币种	当期交易协议金额	期末未结算协议余额
香港上海汇丰银行有限公司	卖出美元	美元	6,254,024.85	2,611,143.44
	卖出欧元	欧元	10,426,049.18	7,233,411.31
	卖出人民币	人民币	22,216,837.34	11,108,418.67
上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日				
关联方名称	项目	卖出币种	当期交易协议金额	期末未结算协议余额
香港上海汇丰银行有限公司	卖出美元	美元	7,569,536.04	4,771,166.47
	卖出欧元	欧元	5,655,509.86	2,629,143.19
	卖出人民币	人民币	33,646,800.00	3,768,780.00

6.4.10.7.2 期货交易

本期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）及上年度可比期间（2018 年 1 月 1 日至

2018 年 6 月 30 日)，本基金未与关联方进行期货交易。

6.4.5 期末(2019 年 06 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本期末(2019 年 6 月 30 日)，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2019 年 6 月 30 日)，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本期末(2019 年 6 月 30 日)，本基金无银行间市场债券正回购余额。

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2019 年 6 月 30 日)，本基金无交易所市场债券正回购余额。

§ 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	-	-
	其中：普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	9,911,782.42	0.92
3	固定收益投资	870,001,301.23	80.70
	其中：债券	870,001,301.23	80.70
	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	142,391,512.60	13.21
8	其他各项资产	55,752,468.06	5.17

9	合计	1,078,057,064.31	100.00
---	----	------------------	--------

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

报告期末，本基金未持有权益投资。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

报告期末，本基金未持有权益投资。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

报告期末，本基金未持有权益投资。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 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

报告期内（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金未进行权益投资交易。

7.5.2 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

报告期内（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金未进行权益投资交易。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

报告期内（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日），本基金未进行权益投资交易。

7.6 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 (%)
A+	8,747,258.29	0.87
A-	43,326,848.05	4.33
AA-	7,027,373.34	0.70
BBB+	12,222,295.39	1.22
BBB	57,388,558.78	5.74
BBB-	97,983,656.81	9.80
BB+	77,174,594.44	7.72
BB	92,641,551.58	9.26
BB-	86,491,123.20	8.65
B+	71,494,111.15	7.15
B	217,482,733.87	21.75
B-	93,853,464.46	9.39
CCC+	4,167,731.87	0.42

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。

7.7 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（张）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	XS2008293529	ECOBANK TRANSNATIONAL	19,249,160.00	21,234,903.35	2.12
2	XS2010323009	SIB TIER 1 SUKUK CO	19,249,160.00	19,239,150.44	1.92
3	USL4441RAA43	GOL FINANCE	17,874,220.00	17,530,320.01	1.75
4	US50050HAL06	KOOKMIN BANK	16,155,545.00	16,271,218.70	1.63
5	USP3R26HAA81	CYDSA SAB DE CV	15,811,810.00	15,856,557.42	1.59

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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 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)	87,888.50	0.01
2	远期投资	外汇远期 (人民币对美元)	46,679.87	0.00
3	远期投资	外汇远期 (欧元对美元)	17,187.78	0.00
4	远期投资	外汇远期 (欧元对美元)	8,335.57	0.00
5	远期投资	外汇远期 (美元对欧元)	-475.25	0.00

7.10 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

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Xtrackers II Harvest China Government Bond UCITS ETF	ETF 基金	交易型开放式	DWS Investment SA	9,911,782.42	0.99

注:报告期末,本基金仅持有上述 1 只基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1

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。

7.11.2

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。

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	809,427.18
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	12,064,870.23
5	应收申购款	42,878,170.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,752,468.06

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金未持有权益投资。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
嘉实新兴市场 A1	104,125	5,819.53	28,953,356.70	4.78	577,005,517.43	95.22
嘉实新兴市场 C2	1,428	16,777.20	76,532.14	0.32	23,881,309.59	99.68
合计	105,553	5,967.78	29,029,888.84	4.61	600,886,827.02	95.39

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。

8.2 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	178,490.30	0.03
	嘉实新兴市场 C2	24,538.31	0.10
	合计	203,028.61	0.03

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	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

§9 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	52,065,810.99	25,747,601.57
本报告期基金总申购份额	631,988,071.89	914,577.13
减: 本报告期基金总赎回份额	78,095,008.75	2,704,336.97
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期期末基金份额总	605,958,874.13	23,957,841.73

额		
---	--	--

§ 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

2019 年 2 月 2 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，自 2019 年 2 月 2 日起邵健先生不再担任公司副总经理，专注于专户产品的投资管理工作。

2019 年 6 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李松林先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

2019 年 6 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告》，公司法定代表人变更为经雷先生。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	
巴克莱 Barclays	-	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	
渣打（伦敦）银行 Standard Chartered Bank London	-	-	-	-	-	
Linear Investment Limited Linear Investment Limited	-	-	-	-	-	新增
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	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Liquidity Finance LLP PLiquidity Finance LLP	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	-
中银香港 Bank of China Hong Kong	-	-	-	-	-	-

俄罗斯天然气工业银行 GAZPROMBANK	-	-	-	-	-	新增
BANCO SANTANDER, S. AB ANCO SANTANDER, S. A	-	-	-	-	-	
国泰君安证券（香港） 有限公司 Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
中国国际金融香港证券 有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securitie s Limited	-	-	-	-	-	
三菱 UFJ 证券国际有限 公司 Mitsubishi UFJ Secu rities Internationa l Plc	-	-	-	-	-	
星展唯高达香港有限公 司 DBS Vickers (Hong Ko ng) Limited	-	-	-	-	-	
摩根士丹利亚洲有限公 司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	
香港独立债券及贷款交 易公司	-	-	-	-	-	

SC Lowy Financial(HK)) Ltd						
中信银行(国际)有限公司 China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
荷兰商业银行 ING Bank N.V.	-	-	-	-	-	-
CSI GLOBAL MARKETS LIMITED CSI GLOBAL MARKETS LIMITED	-	-	-	-	-	-
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
澳新银行集团 Australia and New Zealand Banking Group	-	-	-	-	-	-
农业信贷银行 Credit Agricole Corporate and investment bank	-	-	-	-	-	-
俄罗斯外贸银行资本公司 VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	-

凯基证券（香港）有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
德国商业银行 Commerzbank AG	-	-	-	-	-	-
工银国际控股有限公司 ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-
华泰金融控股（香港）有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券（香港）经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	-	-	-	-	-	-
东方汇理 CREDIT AGRICOLE CORPORATE AND INVESTMENT BANK	-	-	-	-	-	-
法国巴黎证券（亚洲）	-	-	-	-	-	-

有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited						
尚乘资产管理有限公司 AMTD Asset Management Limited	-	-	-	-	-	
交通银行股份有限公司 香港分行 Bank of Communications Co., Ltd. HK Branch	-	-	-	-	-	
J.P. 摩根资本顾问有限公司 Morgan Capital Advisors LLP	-	-	-	-	-	
澳大利亚国民银行 National Bank of Australia	-	-	-	-	-	
加拿大皇家银行 Royal Bank of Canada	-	-	-	-	-	
苏格兰皇家银行 Royal Bank of Scotland Plc (RBS)	-	-	-	-	-	
法国外贸银行 NATIXIS	-	-	-	-	-	
渤海证券 Bohai Securities Co. Ltd.	-	-	-	-	-	
招商证券（香港）有限公司 China Merchants Securities	-	-	-	-	-	

rities (HK) Co., Ltd.						
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO., LTD CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO., LTD	-	-	-	-	-	

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

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范, 在近一年内无重大违规行为;
- (2) 公司财务状况良好;
- (3) 有良好的内控制度, 在业内有良好的声誉;
- (4) 有较强的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;
- (5) 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确地信息资讯服务。基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议, 并通知基金托管人。

10.7.2 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		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
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	353,694,590.15	11.51%	-	-	-	-
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	326,425,490.07	10.62%	-	-	-	-

巴克莱 Barclays	257,088,555.95	8.37%	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	237,130,502.01	7.72%	-	-	-	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	222,661,711.39	7.25%	-	-	-	-
渣打(伦敦)银行 Standard Chartered Bank London	197,036,945.10	6.41%	-	-	-	-
Linear Investment Limited Linear Investment Limited	156,915,734.01	5.11%	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	143,703,201.30	4.68%	-	-	-	-
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	142,258,350.12	4.63%	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	130,990,777.16	4.26%	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	130,812,774.26	4.26%	-	-	-	-
Liquidity Finance LLP Liquidity Finance LLP	88,884,560.34	2.89%	-	-	-	-
野村国际(香港)有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	86,601,528.89	2.82%	-	-	-	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	79,347,167.38	2.58%	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	73,004,143.99	2.38%	-	-	-	-

中银香港 Bank of China Hong Kong	64,433,793.23	2.10%	-	-	-	-
俄罗斯天然气工业银 行 GAZPROMBANK	56,645,606.11	1.84%	-	-	-	-
BANCO SANTANDER, S. ABANCO SANTANDER, S. A	56,621,726.54	1.84%	-	-	-	-
国泰君安证券（香港） 有限公司 Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	48,518,083.27	1.58%	-	-	-	-
中国国际金融香港证 券有限公司 China International Capital Corporati on Hong Kong Securi ties Limited	38,580,459.07	1.26%	-	-	-	-
三菱 UFJ 证券国际有 限公司 Mitsubishi UFJ Sec urities Internatio nal Plc	35,575,462.87	1.16%	-	-	-	-
星展唯高达香港有限 公司 DBS Vickers (Hong K ong) Limited	27,034,847.45	0.88%	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲有限 公司 Morgan Stanley Asia Limited	22,362,677.81	0.73%	-	-	-	-
香港独立债券及贷款 交易公司 SC Lowy Financial(H K) Ltd	20,506,524.05	0.67%	-	-	-	-
中信银行（国际）有 限公司 China CITIC Bank In ternational Limited	20,026,538.50	0.65%	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公 司 Mizuho Securities A sia Limited	15,120,907.64	0.49%	-	-	-	-

荷兰商业银行 ING Bank N.V.	14,088,963.02	0.46%	-	-	-	-
CSI GLOBAL MARKETS LIMITEDCSI GLOBAL M ARKETS LIMITED	8,425,951.15	0.27%	-	-	-	-
海通国际证券有限公 司 Haitong Internation al Securities Comp any Ltd.	8,214,402.24	0.27%	-	-	-	-
中银国际证券有限公 司 BOCI Securities Lim ited	5,058,957.66	0.16%	-	-	-	-
澳新银行集团 Australia and New Zealand Banking Gro up	2,693,878.39	0.09%	-	-	-	-
农业信贷银行 Credit Agricole Cor porate and investmen t bank	2,129,540.88	0.07%	-	-	-	-

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 08 月 29 日