

---

# 嘉实稳健开放式证券投资基金 2019 年半年 度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2019 年 08 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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。

## 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 .....	5
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 .....	6
<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 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<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 .....	13
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 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	34
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 .....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
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 .....	39

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 .....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	39
7.12 投资组合报告附注 .....	39
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>40</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	40
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	40
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 .....	40
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>40</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>41</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	41
10.4 基金投资策略的改变 .....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	41
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 .....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	41
10.8 其他重大事件 .....	46
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>46</b>
11.1 备查文件目录 .....	46
11.2 存放地点 .....	46
11.3 查阅方式 .....	46

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳健开放式证券投资基金
基金简称	嘉实稳健混合
基金主代码	070003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,478,274,071.77 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险、确保基金资产良好流动性的前提下，以获取资本增值收益和现金红利分配的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下进行资产配置，通过基本面分析挖掘行业优势企业，获取稳定的长期回报。投资组合比例范围为股票 40%-75%、债券 20%-55%、现金 5%左右。
业绩比较基准	60%*巨潮 200（大盘）指数收益率+40%*中债总指数收益率
风险收益特征	本基金属于中低风险证券投资基金，长期系统性风险控制目标为基金份额净值相对于基金业绩基准的 $\beta$ 值保持在 0.5 至 0.8 之间。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010)65215588	(010)66594942
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 53 层 09-11 单元	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100005	100818
法定代表人	经雷	刘连舸

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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
--	---------

## 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	北京市建国门北大街 8 号华润大厦 8 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(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	57,437,246.86
本期利润	588,298,328.85
加权平均基金份额本期利润	0.2311
本期加权平均净值利润率	20.00%
本期基金份额净值增长率	22.51%
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	1,851,232,271.49
期末可供分配基金份额利润	0.7470
期末基金资产净值	3,076,024,391.12
期末基金份额净值	1.241
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	376.18%

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）所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	6.07%	1.00%	3.66%	0.69%	2.41%	0.31%
过去三个月	2.73%	1.24%	-0.13%	0.91%	2.86%	0.33%

过去六个月	22.51%	1.19%	17.10%	0.92%	5.41%	0.27%
过去一年	10.70%	1.21%	9.48%	0.91%	1.22%	0.30%
过去三年	16.75%	0.91%	20.11%	0.66%	-3.36%	0.25%
自基金合同生效起至今	376.18%	1.24%	279.45%	1.59%	96.73%	-0.35%

注:本基金业绩比较基准为: 60%\*巨潮 200(大盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

巨潮大盘指数的总市值相对于 A 股市场覆盖率约为 52%，具有良好的市场代表性，用以反映 A 股市场大盘市值股票的运行情况，适合作为本基金股票投资业绩比较基准。中国债券总财富指数是全样本债券指数，包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券（如交易所和银行间国债、银行间金融债等）。中国债券总财富指数是以债券全价计算的指数值，考虑了付息日利息再投资因素，在样本券付息时利息再投资计入指数之中。中国债券总财富指数能表征中国债券市场趋势，是债券组合投资管理业绩评估的有效工具。

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：

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

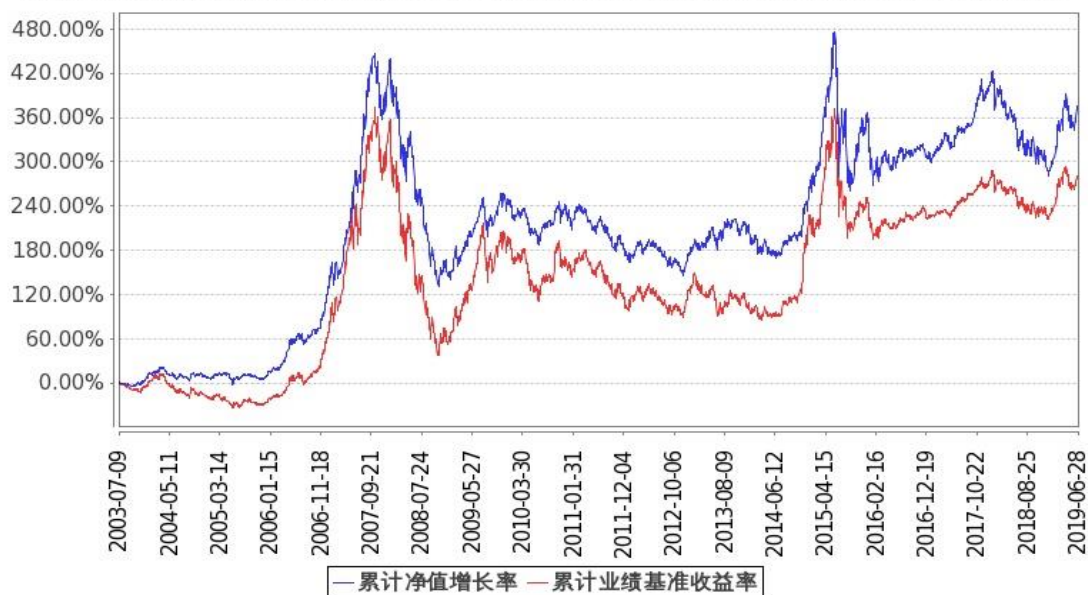
$$\text{Return}(t)=60\%*(\text{巨潮 200(大盘)指数}(t)/\text{巨潮 200(大盘)指数}(t-1)-1)+40%*(\text{中国债券总指数}(t)/\text{中国债券总指数}(t-1)-1)$$

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

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

嘉实稳健混合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：嘉实稳健混合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

(2003 年 7 月 9 日至 2019 年 6 月 30 日)

注：按基金合同规定，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三部分（四（一）1、（2）投资范围和（四）各基金投资组合比例限制）的规定：（1）投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的 80%；（2）持有一家公司的股票，不得超过基金资产净值的 10%；（3）本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%；（4）投资于国债的比例不低于基金资产净值的 20%；（5）本基金的股票资产中至少有 80%属于本基金名称所显示的投资内容；（6）法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

## § 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



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		
张淼	本基金、嘉实先进制造股票基金经理	2015 年 2 月 17 日		14 年	曾就职于东方基金管理有限公司研究部。2007 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，先后担任研究员、研究部副总监和基金经理助理职务。硕士研究生，具有基金从业资格。
归凯	本基金、嘉实增长混合、嘉实泰和混合、嘉实新兴产业股票基金经理	2018 年 7 月 18 日		12 年	曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，任机构投资部投资经理一职。

注：（1）任职日期、离任日期指公司作出决定后公告之日；（2）证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；（3）2019 年 8 月 1 日，本基金管理人发布《关于嘉实稳健混合基金经理变更的公告》，归凯先生不再担任本基金基金经理，由原基金经理张淼女士单独管理本基金。

#### 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、《嘉实理财通系列证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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

年初政府出台信用疏导、降税减费、基建发力等一系列政策，使得市场对经济增长企稳预期增强，叠加贸易战短期有所缓和，指数在一季度大幅上扬。但进入二季度贸易战恶化和重新升级，市场风险偏好下降，受贸易战影响较大的科技、制造板块比如通信、计算机、电子等调整较大，对于家电、食品饮料等立足内需的消费类板块受到市场青睐，不断走强。上半年指数处于先扬后抑走势，整体上沪深 300 指数上行 27 个百分点。

在市场预期发生反复变化的同时，我们也关注到在宏观转弱以及贸易战升级的背景下国内也会相应推出一系列对冲政策，流动性宽松的局面有望延续，因此报告期内组合仓位保持在较高水平上。在配置方向上，我们在坚守大市值龙头企业的持仓同时，也兼顾了防御以及长期投资考虑，减持了前期涨幅较大的农林牧渔、非银金融等板块，增加了消费相关的龙头公司的投资比例。

#### 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 1.241 元；本报告期基金份额净值增长率为 22.51%，业绩比较基准收益率为 17.10%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济增长难有明显起色，但在年内一系列政策对冲的情况下，经济失速下行的风险概率仍然较低。企业盈利自身的周期规律有望指向三季度见底，但定力空前的地产调控

政策可能使得盈利企稳后弹性不足。流动性方面，随着社融增速的企稳回升，“去杠杆”变为“稳杠杆”的环境下广义金融机构开始逐步进入扩表周期，宽货币格局得到进一步强化，但中小银行刚兑打破可能使得信用传导上存在波折；全球央行正式开始降息周期，联储大概率跟进下有望进一步打开国内利率下行空间，同时配合政府支持小微企业的普惠金融政策，下半年海外资金随着全球重要指数进一步提高 A 股纳入比例预计仍能贡献显著增量资金，市场活跃度仍然具备。中美贸易问题不确定性没有本质下降，后续谈判仍然充满挑战和变数。

从更长期的角度来看，由于增长方式的变化，中国经济增速很难回升，未来可能长期处于缓慢下行趋势，但我们也要看到结构性机会。我们一直强调中国具有工程师红利，在贸易战背景下，科技创新显得更加重要，未来消费和科技将是我们长期关注的重点领域。在下一轮科技创新周期开启阶段，积极寻找护城河较高、有望持续成长的优质龙头公司。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同（十一（二）收益分配原则）约定，报告期内本基金未实施利润分配，符合法律法规的规定和基金合同的相关约定。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实稳健开放式证券投资基金

（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：嘉实稳健开放式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	253,691,971.43	82,935,590.22
结算备付金		591,495.30	730,938.06
存出保证金		350,497.15	365,578.33
交易性金融资产	6.4.7.2	2,819,971,882.52	2,207,591,112.97
其中：股票投资		2,164,329,056.32	1,610,681,963.17
基金投资		-	-
债券投资		655,642,826.20	596,909,149.80
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	-	349,959,644.94
应收证券清算款		-	28,263,217.54
应收利息	6.4.7.5	9,260,726.93	11,936,465.12
应收股利		-	-
应收申购款		202,165.70	102,559.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		3,084,068,739.03	2,681,885,106.98
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
<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		-	-
应付证券清算款		-	39,482,038.83
应付赎回款		2,816,045.68	861,561.53
应付管理人报酬		3,660,372.41	3,452,764.68
应付托管费		610,062.08	575,460.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	647,610.49	449,533.12
应交税费		3.00	8.55
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	310,254.25	450,405.23
负债合计		8,044,347.91	45,271,772.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,224,792,119.63	1,286,482,008.36
未分配利润	6.4.7.10	1,851,232,271.49	1,350,131,325.88
所有者权益合计		3,076,024,391.12	2,636,613,334.24
负债和所有者权益总计		3,084,068,739.03	2,681,885,106.98

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.241 元，基金份额总额 2,478,274,071.77 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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		617,458,943.74	-425,627,980.03
1. 利息收入		12,019,270.72	16,356,942.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	789,076.51	795,952.65
债券利息收入		11,152,063.83	15,508,858.31
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		78,130.38	52,131.85

收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		74,533,037.38	150,921,731.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	60,407,714.88	138,293,272.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-715,100.00	-425,730.98
资产支持证券投资			
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	14,840,422.50	13,054,189.65
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	530,861,081.99	-592,947,326.45
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	45,553.65	40,671.96
减：二、费用		29,160,614.89	33,660,120.08
1. 管理人报酬		21,850,443.72	25,497,115.74
2. 托管费		3,641,740.62	4,249,519.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,580,981.98	3,781,538.40
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.82	1.33
7. 其他费用	6.4.7.19	87,446.75	131,945.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		588,298,328.85	-459,288,100.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		588,298,328.85	-459,288,100.11

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳健开放式证券投资基金

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)	1,286,482,008.36	1,350,131,325.88	2,636,613,334.24

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	588,298,328.85	588,298,328.85
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）	-61,689,888.73	-87,197,383.24	-148,887,271.97
其中：1. 基金申购款	16,282,006.55	22,157,995.75	38,440,002.30
2. 基金赎回款	-77,971,895.28	-109,355,378.99	-187,327,274.27
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）	1,224,792,119.63	1,851,232,271.49	3,076,024,391.12
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）	1,424,190,429.29	2,331,941,297.88	3,756,131,727.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-459,288,100.11	-459,288,100.11
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）	-117,601,784.52	-185,852,867.25	-303,454,651.77
其中：1. 基金申购款	25,882,087.41	41,088,438.03	66,970,525.44
2. 基金赎回款	-143,483,871.93	-226,941,305.28	-370,425,177.21
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	-	-28,407,417.73	-28,407,417.73



列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	1,306,588,644.77	1,658,392,912.79	2,964,981,557.56

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>王红</u>	<u>张公允</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

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]67 号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，嘉实理财通系列开放式证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)和嘉实债券开放式证券投资基金，基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 1,030,248,511.17 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金于 2007 年 5 月 30 日进行了基金份额拆分操作，当日本基金拆分前基金份额净值为人民币 2.024 元，本基金管理人按照 1:2.023867075 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。拆分后，拆分日基金份额净值调整为人民币 1.000 元，相应地，原来每 1 份基金份额变为 2.023867075 份。本基金于 2007 年 5 月 31 日进行了变更登记。

本基金限于投资具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的大市值上市公司股票、债券以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。其中，投资重点是在流通市值占市场前 50%的上市公司中具有竞争优势的大市值上市公司股票，投资于大市值上市公司的比例不少于基金股票部分的 80%。在正常市场状况下，投资组合中股票投资比例浮动范围：40%-75%，债券投资比例浮动范围：20%-55%，现金留存比例：5%左右。本基金业绩比较基准为：60%\*巨潮 200(大盘)指数收益率+40%\*中债总指数收益率。

### 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(以下统称“企业会计准则”)编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算

算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《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 2 号《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

#### 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 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。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；

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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；

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《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。

#### 6.4.7 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 2019年6月30日
活期存款	253,691,971.43
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个月及以上	-
其他存款	-
合计	253,691,971.43

注：定期存款的存款期限指票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,816,686,079.49	2,164,329,056.32	347,642,976.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	93,000.00	99,826.20
	银行间市场	652,338,818.80	655,543,000.00
	合计	652,431,818.80	655,642,826.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,469,117,898.29	2,819,971,882.52	350,853,984.23

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末(2019年6月30日),本基金未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本期末(2019年6月30日),本基金未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本期末(2019年6月30日),本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	42,662.00
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	239.58
应收债券利息	9,217,682.99
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	0.43
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	141.93
合计	9,260,726.93

### 6.4.7.6 其他资产

本期末(2019年6月30日),本基金无其他资产(其他应收款、待摊费用等)。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	647,085.49
银行间市场应付交易费用	525.00
合计	647,610.49

### 6.4.7.8 其他负债

单位:人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	746.88
预提费用	59,507.37

合计	310,254.25
----	------------

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,603,098,180.16	1,286,482,008.36
本期申购	32,944,365.97	16,282,006.55
本期赎回（以“-”号填列）	-157,768,474.36	-77,971,895.28
本期末	2,478,274,071.77	1,224,792,119.63

注：报告期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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
上年度末	2,033,344,545.70	-683,213,219.82	1,350,131,325.88
本期利润	57,437,246.86	530,861,081.99	588,298,328.85
本期基金份额交易产生的变动数	-98,306,099.59	11,108,716.35	-87,197,383.24
其中：基金申购款	25,865,040.99	-3,707,045.24	22,157,995.75
基金赎回款	-124,171,140.58	14,815,761.59	-109,355,378.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,992,475,692.97	-141,243,421.48	1,851,232,271.49

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	768,746.64
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	17,335.95
其他	2,993.92
合计	789,076.51

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	1,408,926,564.68
减：卖出股票成本总额	1,348,518,849.80
买卖股票差价收入	60,407,714.88

## 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	146,171,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	140,715,100.00
减：应收利息总额	6,171,000.00
买卖债券差价收入	-715,100.00

## 6.4.7.14 衍生工具收益

本期（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金无衍生工具收益。

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	14,840,422.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	14,840,422.50

## 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	530,861,081.99
股票投资	532,066,585.59
债券投资	-1,205,503.60
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	530,861,081.99

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	42,664.14
基金转出费收入	2,889.51
债券认购手续费返还	-

印花税手续费返还	-
其他	-
合计	45,553.65

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	3,579,881.98
银行间市场交易费用	1,100.00
合计	3,580,981.98

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	19,835.79
银行划款手续费	9,339.38
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	87,446.75

#### 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

截至资产负债表日，本基金无重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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交易。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	21,850,443.72	25,497,115.74
其中：支付销售机构的客户维护费	2,400,455.01	2,788,578.58

注：本基金的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### 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
	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	3,641,740.62	4,249,519.31

注：本基金的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前五个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 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

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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

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。

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

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。

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中国银行股份有限公司_活期	253,691,971.43	768,746.64	165,858,045.51	767,822.58

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

##### 6.4.11 利润分配情况

本期（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金未实施利润分配。

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

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股流通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 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

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。

##### 6.4.12.3.2 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。

#### 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。

本基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，本基金管理人董事会对本基金管理人建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和本基金管理人合法权益。

为了有效控制本基金管理人运作和基金管理中存在的风险，本基金管理人设立风险控制委员会，由本基金管理人总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估本基金管理人经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金管理人设立督察长制度，积极对本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况进行监察、稽核，定期和不定期向董事会报告本基金管理人内部控制执行情况。

监察稽核部具体负责本基金管理人各项制度、业务的合法合规性及本基金管理人内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。本基金管理人管理层重视和支持监察稽核工作，并保证监察稽核部的独立性和权威性，配备了充足合格的监察稽核人员，明确监察稽核部门及其各岗位的职责和工作流程、组织纪律。

业务部门负责人为所在部门的风险控制第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金管理人建立了以董事会为领导的、由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

### 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

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019年6月30日）及上年度末（2018年12月31日），本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	99,826.20	89,149.80
未评级	-	-
合计	99,826.20	89,149.80

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由债券发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末（2019 年 6 月 30 日）及上年度末（2018 年 12 月 31 日），本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 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 2019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	253,691,971.43	-	-	-	253,691,971.43
结算备付金	591,495.30	-	-	-	591,495.30
存出保证金	350,497.15	-	-	-	350,497.15
交易性金融资产	350,613,000.00	305,029,826.20	-	-2,164,329,056.32	2,819,971,882.52
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	9,260,726.93	9,260,726.93
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,548.11	-	-	200,617.59	202,165.70
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	605,248,511.99	305,029,826.20	-	-2,173,790,400.84	3,084,068,739.03
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,816,045.68	2,816,045.68
应付管理人报酬	-	-	-	3,660,372.41	3,660,372.41
应付托管费	-	-	-	610,062.08	610,062.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-

应付交易费用	-	-	-	647,610.49	647,610.49
应付税费	-	-	-	3.00	3.00
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	310,254.25	310,254.25
负债总计	-	-	-	8,044,347.91	8,044,347.91
利率敏感度缺口	605,248,511.99	305,029,826.20	-	-2,165,746,052.93	3,076,024,391.12
上年度末 2018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	82,935,590.22	-	-	-	82,935,590.22
结算备付金	730,938.06	-	-	-	730,938.06
存出保证金	365,578.33	-	-	-	365,578.33
交易性金融资产	291,100,000.00	305,809,149.80	-	-1,610,681,963.17	2,207,591,112.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	349,959,644.94	-	-	-	349,959,644.94
应收证券清算款	-	-	-	28,263,217.54	28,263,217.54
应收利息	-	-	-	11,936,465.12	11,936,465.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	5,302.06	-	-	97,257.74	102,559.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	725,097,053.61	305,809,149.80	-	-1,650,978,903.57	2,681,885,106.98
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	39,482,038.83	39,482,038.83
应付赎回款	-	-	-	861,561.53	861,561.53
应付管理人报酬	-	-	-	3,452,764.68	3,452,764.68
应付托管费	-	-	-	575,460.80	575,460.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	449,533.12	449,533.12
应付税费	-	-	-	8.55	8.55
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	450,405.23	450,405.23
负债总计	-	-	-	45,271,772.74	45,271,772.74
利率敏感度缺口	725,097,053.61	305,809,149.80	-	-1,605,707,130.83	2,636,613,334.24

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
分析	市场利率下降 25 个基点	2,117,673.14	2,430,697.29
	市场利率上升 25 个基点	-2,102,612.27	-2,410,872.37

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	2,164,329,056.32	70.36	1,610,681,963.17	61.09
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	2,164,329,056.32	70.36	1,610,681,963.17	61.09

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据过去一个年度的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	196,396,587.23	172,431,883.48
	业绩比较基准下降 5%	-196,396,587.23	-172,431,883.48

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 2,164,371,905.98 元，属于第二层次的余额为人民币 655,599,976.54 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次的余额为人民币 1,610,720,967.17 元，第二层次的余额为人民币 596,870,145.80 元，无属于第三层次的余额）。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为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。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期末未发生变动（上年度：无）。

## 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

## 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,164,329,056.32	70.18
	其中：股票	2,164,329,056.32	70.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	655,642,826.20	21.26
	其中：债券	655,642,826.20	21.26
	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	254,283,466.73	8.25
8	其他各项资产	9,813,389.78	0.32
9	合计	3,084,068,739.03	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	60,507,372.25	1.97
C	制造业	936,889,669.66	30.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,696.73	0.00
F	批发和零售业	223,911,631.53	7.28
G	交通运输、仓储和邮政业	56,633.58	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	134,399,174.64	4.37
J	金融业	547,261,608.78	17.79
K	房地产业	87,519,249.60	2.85
L	租赁和商务服务业	119,846,208.45	3.90

M	科学研究和技术服务业	53,817,933.60	1.75
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	94,770.90	0.00
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,164,329,056.32	70.36

### 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	601318	中国平安	1,911,700	169,395,737.00	5.51
2	600036	招商银行	4,119,445	148,217,631.10	4.82
3	000651	格力电器	2,433,000	133,815,000.00	4.35
4	600887	伊利股份	3,604,509	120,426,645.69	3.92
5	601888	中国国旅	1,331,853	118,068,768.45	3.84
6	000063	中兴通讯	3,500,000	113,855,000.00	3.70
7	600519	贵州茅台	110,831	109,057,704.00	3.55
8	601933	永辉超市	9,960,500	101,696,705.00	3.31
9	601336	新华保险	1,826,982	100,538,819.46	3.27
10	000963	华东医药	3,682,652	95,601,645.92	3.11
11	000002	万科A	3,147,000	87,518,070.00	2.85
12	600600	青岛啤酒	1,723,777	86,068,185.61	2.80
13	600741	华域汽车	3,211,028	69,358,204.80	2.25
14	601899	紫金矿业	15,953,300	60,143,941.00	1.96
15	600406	国电南瑞	2,985,534	55,650,353.76	1.81
16	300012	华测检测	4,983,142	53,817,933.60	1.75
17	002415	海康威视	1,949,243	53,760,121.94	1.75
18	000401	冀东水泥	3,008,500	52,979,685.00	1.72
19	601601	中国太保	1,269,436	46,347,108.36	1.51
20	600030	中信证券	1,875,300	44,650,893.00	1.45
21	601211	国泰君安	2,072,200	38,024,870.00	1.24
22	603027	千禾味业	1,487,220	35,499,941.40	1.15
23	000858	五粮液	286,200	33,757,290.00	1.10
24	600276	恒瑞医药	499,577	32,972,082.00	1.07
25	600436	片仔癀	276,884	31,897,036.80	1.04
26	300369	绿盟科技	2,264,000	29,001,840.00	0.94
27	601766	中国中车	3,505,100	28,356,259.00	0.92
28	000028	国药一致	636,183	26,611,534.89	0.87

29	002174	游族网络	1,320,500	22,290,040.00	0.72
30	600585	海螺水泥	500,000	20,750,000.00	0.67
31	300454	深信服	160,600	14,058,924.00	0.46
32	002475	立讯精密	556,918	13,805,997.22	0.45
33	603444	吉比特	63,622	13,358,075.12	0.43
34	002027	分众传媒	336,000	1,777,440.00	0.06
35	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.01
36	601869	长飞光纤	3,345	125,437.50	0.00
37	603882	金域医学	2,763	94,770.90	0.00
38	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
39	603713	密尔克卫	1,626	56,633.58	0.00
40	603106	恒银金融	3,983	51,858.66	0.00
41	601878	浙商证券	5,524	51,373.20	0.00
42	603501	韦尔股份	829	45,520.39	0.00
43	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
44	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
45	002900	哈三联	2,974	35,569.04	0.00
46	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
47	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
48	603055	台华新材	3,721	28,391.23	0.00
49	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
50	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.00
51	603980	吉华集团	2,414	21,870.84	0.00
52	300657	弘信电子	868	19,790.40	0.00
53	300660	江苏雷利	1,191	17,769.72	0.00
54	603657	春光科技	175	4,432.75	0.00
55	600511	国药股份	76	1,745.72	0.00
56	601606	长城军工	90	1,343.70	0.00
57	601068	中铝国际	170	1,173.00	0.00
58	603590	康辰药业	28	1,088.92	0.00
59	601838	成都银行	100	883.00	0.00
60	600340	华夏幸福	20	651.40	0.00
61	000069	华侨城 A	76	528.20	0.00
62	600820	隧道股份	83	523.73	0.00
63	000712	锦龙股份	33	423.72	0.00
64	002544	杰赛科技	26	338.00	0.00
65	600737	中粮糖业	33	286.44	0.00
66	603192	汇得科技	7	189.63	0.00
67	000952	广济药业	6	59.70	0.00

## 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	000651	格力电器	108,760,612.69	4.13
2	601336	新华保险	76,709,654.55	2.91
3	600600	青岛啤酒	76,182,629.82	2.89
4	600741	华域汽车	74,965,621.22	2.84
5	600030	中信证券	72,011,827.61	2.73
6	600519	贵州茅台	71,773,609.60	2.72
7	601211	国泰君安	70,498,565.18	2.67
8	601688	华泰证券	66,009,786.30	2.50
9	000401	冀东水泥	64,128,756.42	2.43
10	600406	国电南瑞	62,307,767.16	2.36
11	600703	三安光电	60,463,880.90	2.29
12	601155	新城控股	45,760,686.47	1.74
13	600588	用友网络	40,548,096.87	1.54
14	002439	启明星辰	39,956,280.41	1.52
15	002415	海康威视	39,359,316.28	1.49
16	300369	绿盟科技	32,319,303.39	1.23
17	002174	游族网络	30,233,638.80	1.15
18	002180	纳思达	30,151,278.17	1.14
19	600276	恒瑞医药	29,870,339.24	1.13
20	000858	五粮液	29,575,919.00	1.12

## 7.4.2 累计卖出金额前 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	601088	中国神华	84,648,690.11	3.21
2	601336	新华保险	79,064,746.20	3.00
3	001979	招商蛇口	74,973,168.91	2.84
4	300012	华测检测	70,376,655.38	2.67
5	601688	华泰证券	70,371,819.40	2.67
6	600872	中炬高新	69,636,808.47	2.64
7	600036	招商银行	63,887,757.57	2.42
8	601111	中国国航	56,616,946.30	2.15
9	601155	新城控股	54,089,035.23	2.05
10	600703	三安光电	53,941,566.11	2.05
11	601398	工商银行	52,819,137.00	2.00
12	600588	用友网络	52,507,743.98	1.99
13	600029	南方航空	50,856,452.07	1.93
14	002157	正邦科技	45,307,469.19	1.72

15	300059	东方财富	42,926,212.00	1.63
16	002439	启明星辰	41,573,705.68	1.58
17	600030	中信证券	39,440,874.40	1.50
18	601939	建设银行	35,394,489.09	1.34
19	601211	国泰君安	34,244,721.00	1.30
20	000001	平安银行	33,906,505.24	1.29

#### 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	1,370,099,357.36
卖出股票收入（成交）总额	1,408,926,564.68

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	202,360,000.00	6.58
2	央行票据	-	-
3	金融债券	453,183,000.00	14.73
	其中：政策性金融债	453,183,000.00	14.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	99,826.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	655,642,826.20	21.31

#### 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	120009	12 付息国债 09	2,000,000	202,360,000.00	6.58
2	180209	18 国开 09	1,500,000	150,045,000.00	4.88
3	110208	11 国开 08	1,000,000	102,570,000.00	3.33
4	190201	19 国开 01	900,000	89,964,000.00	2.92
5	190301	19 进出 01	600,000	59,904,000.00	1.95

#### 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

报告期末，本基金未持有资产支持证券。

## 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

报告期末，本基金未持有贵金属投资。

## 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

报告期末，本基金未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与股指期货交易。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 声明本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

(1) 2018 年 7 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布深圳保监局二〇一八年行政处罚信息主动公开事项（十三）深保监罚〔2018〕23 号，2018 年 7 月 5 日因招商银行股份有限公司违反《中华人民共和国保险法》第一百三十一条第（一）项规定，根据该法第一百六十五条予以处罚，罚款 30 万元。

2018 年 9 月 29 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监保罚决字〔2018〕1 号），因新华人寿存在欺骗投保人、编制提供虚假资料、未按照规定使用经批准或者备案的保险费率等违法行为，违反了《中华人民共和国保险法》第一百一十六条、第八十六条、第一百三十五条的规定，对新华人寿累计处以 110 万罚款。

本基金投资于“招商银行（600036）”、“新华保险（601336）”的决策程序说明：基于对招商银行、新华保险基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“招商银行”、“新华保险”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无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。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 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	350,497.15
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	9,260,726.93
5	应收申购款	202,165.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,813,389.78

#### 7.12.4 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	123001	蓝标转债	99,826.20	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末，本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

### § 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 (%)
165,870	14,941.06	7,381,011.82	0.30	2,470,893,059.95	99.70

#### 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	2,221.54	0.00

#### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2003 年 7 月 9 日) 基金份额总额	1,030,248,511.17
本报告期期初基金份额总额	2,603,098,180.16
本报告期基金总申购份额	32,944,365.97
减：本报告期基金总赎回份额	157,768,474.36
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	2,478,274,071.77
-------------	------------------

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 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

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券股份有限公司	6	472,490,431.39	17.01%	330,745.98	17.19%	新增 1 个
光大证券股份有限公司	2	317,352,823.03	11.43%	222,146.97	11.54%	新增 1 个
东兴证券股份有限公司	1	279,621,291.04	10.07%	195,734.90	10.17%	-
方正证券股份有限公司	5	258,315,182.79	9.30%	180,822.01	9.40%	-
西南证券股份有限公司	2	237,753,413.65	8.56%	150,096.70	7.80%	-
新时代证券股份有限公司	2	210,476,831.17	7.58%	144,331.33	7.50%	-
华创证券有限责任公司	2	205,487,227.84	7.40%	143,841.06	7.47%	-
华泰证券股份有限公司	4	196,969,504.36	7.09%	137,878.66	7.16%	-
国元证券股份有限公司	1	160,666,222.18	5.79%	112,466.36	5.84%	-
海通证券股份有限公司	2	147,010,824.47	5.29%	102,908.83	5.35%	-
中国银河证券股份有限公司	2	96,784,504.16	3.49%	67,750.55	3.52%	-
招商证券股份有限公司	2	82,117,782.07	2.96%	57,483.61	2.99%	-

安信证券股 份有限公司	3	54,804,863.73	1.97%	38,363.40	1.99%	-
瑞银证券有 限责任公司	1	47,473,341.61	1.71%	33,231.34	1.73%	-
申万宏源证 券有限公司	3	9,728,288.57	0.35%	6,809.80	0.35%	-
渤海证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有 限公司	1	-	-	-	-	新增
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
华西证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
广州证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限	4	-	-	-	-	-

公司						
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
中国中投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-

长江证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
天源证券经 纪有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
西部证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	新增

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

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

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商

签订协议，并通知基金托管人。

## 10.8 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	关于增加大连网金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、管理人网站	2019年1月4日
2	关于增加奕丰基金为嘉实旗下基金代销机构并开展定投、转换业务及参加费率优惠的公告	上海证券报、管理人网站	2019年1月28日
3	关于嘉实基金管理有限公司旗下基金参与嘉实财富定投业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019年3月8日
4	关于增加青岛农商行为嘉实旗下基金代销机构并开展定投及转换业务的公告	上海证券报、管理人网站	2019年3月26日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；
- (2) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金和嘉实债券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) 报告期内嘉实稳健开放式证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 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

### 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

2019 年 08 月 29 日