

嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 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。本中期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 2020 年 8 月 24 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 2020 年 1 月 1 日起至 2020 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	7
2.1 基金基本情况	7
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 境外资产托管人	8
2.5 信息披露方式	8
2.6 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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.....	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
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	17
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
6.4 报表附注.....	21
§ 7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	45
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	45
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	46
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动.....	46
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	46
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	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	47
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	47

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	47
7.11 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	59
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59

12.3 查阅方式..... 59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新兴市场债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实新兴市场债券	
基金主代码	000342	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 11 月 26 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,174,472,961.85 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	1,152,856,514.47 份	21,616,447.38 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
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010)65215588	(010)66105798

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	经雷	陈四清

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	中文	香港上海汇丰银行有限公司
	英文	The Hongkong and Shanghai 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

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
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

2.6 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(2020年01月01日-2020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	-50,479,915.24	-10,200,431.52
本期利润	-44,322,603.85	-13,107,534.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0441	-0.5773

本期加权平均净值利润率	-3.43%	-7.18%
本期基金份额净值增长率	-5.27%	-6.87%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	511,184,937.27	38,079,763.29
期末可供分配基金份额利润	0.4434	1.7616
期末基金资产净值	1,490,907,628.73	174,246,232.26
期末基金份额净值	1.293	1.139
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	29.30%	13.90%

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债券型证券投资基金的 C2 类份额；嘉实新兴市场 B 转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额；(5) 本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金后，嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额以人民币计价并进行申购，收取申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用。嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额以美元计价并进行申购，计提销售服务费，不收取申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用；(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	2.21%	0.30%	0.22%	0.01%	1.99%	0.29%
过去三个月	12.43%	0.36%	0.63%	0.01%	11.80%	0.35%

过去六个月	-5.27%	0.80%	1.25%	0.01%	-6.52%	0.79%
过去一年	-2.19%	0.57%	2.54%	0.01%	-4.73%	0.56%
过去三年	9.67%	0.38%	7.80%	0.01%	1.87%	0.37%
自基金合同生效起至今	29.30%	0.33%	12.19%	0.01%	17.11%	0.32%

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	2.98%	0.34%	0.22%	0.01%	2.76%	0.33%
过去三个月	12.44%	0.32%	0.63%	0.01%	11.81%	0.31%
过去六个月	-6.87%	0.81%	1.25%	0.01%	-8.12%	0.80%
过去一年	-5.56%	0.57%	2.54%	0.01%	-8.10%	0.56%
过去三年	3.26%	0.34%	7.80%	0.01%	-4.54%	0.33%
自基金合同生效起至今	13.90%	0.29%	12.19%	0.01%	1.71%	0.28%

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

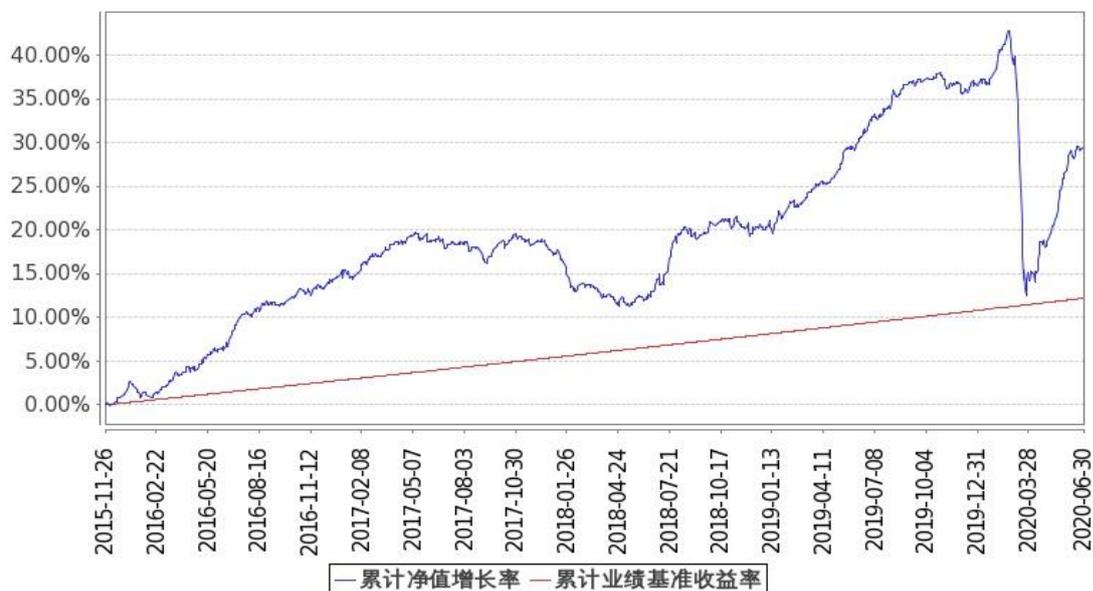


图 1：嘉实新兴市场 A1 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 11 月 26 日至 2020 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

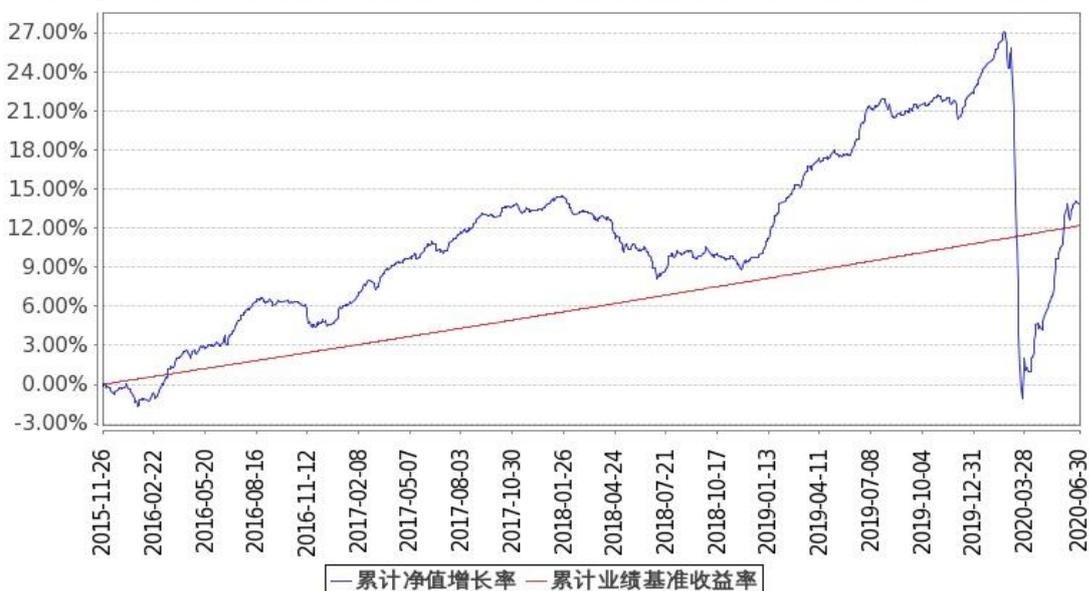


图 2：嘉实新兴市场 C2 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 11 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：1. 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。

2. 2020 年 1 月 3 日, 本基金管理人发布《关于增聘嘉实新兴市场债券基金经理的公告》, 增聘国歌女士担任本基金基金经理职务, 与基金经理关子宏先生共同管理本基金。

§ 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, 在北京、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 2020 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 190 只开放式证券投资基金, 具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票 (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、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开行指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券。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		
国歌 (Guo Ge)	本基金基金经理	2020 年 1 月 3 日		6 年	曾先后任职于 Energie Baden-W ü ttemberg , Deutsche Asset & Wealth Management , Deutsche Asset Management (DWS) , Union Investment, 历任分析师及投资经理职务。2018 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司, 从事投资与研究工作。本科, 具有基金从业资格, 德国国籍。
关子宏	本基金基金经理	2015 年 11 月 26 日		19 年	2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司, 现兼任嘉实国际资产管理公司首席投资官。曾任职于霸菱资产管理 (亚洲) 有限公司担任亚洲债券投资总监, 瑞士信贷资产管理有限公司 (新加坡及北京) 的亚洲固定收益及外汇部董事, 保诚资产管理 (新加坡) 有限公司的亚洲固定收益投资董事和首域投资 (香港) 有限公司的基金经理等职务。经济学硕士, 特许金融分析师, 中国香港籍。

注：（1）基金经理关子宏的任职日期是指本基金基金合同生效之日，基金经理国歌（Guo Ge）的任职日期是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。

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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在基金操作上，基于我们对全球固守市场的判断，我们在 1 月 2 月对于基金的操作平稳保守。在 2 月中开始减持风险，并在市场 2 月底 3 月初出现技术性暴跌的时候尽量在保证基金有足够现金对付赎回的前提下，逐渐减持风险。逐步上调了信用质量，减持了高息债。和高度依赖原油出口的企业和国家。我们在 4 月对于基金的操作保守。主要在观测市场的修复征兆和修复速度。在 5 月 6 月我们开始增持信用风险，将策略从相对保守逐渐缓慢转为激进。并增加了基金现金的应用。逐步下调了平均信用质量，增持了有投资价值的估值过低的高息债。依赖原油出口的企业和国家债券，因为他们在 3 月的跌幅较大，修复潜力较高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新兴市场 A1 基金份额净值为 1.293 元，本报告期基金份额净值增长率为 -5.27%；截至本报告期末嘉实新兴市场 C2 基金份额净值为 1.139 美元，本报告期基金份额净值增长率为 -6.87%；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

嘉实新兴市场双币分级债券基金在 2018 上半年回报为 -6.87%（用美元 C2 Class 计算）。离岸人民币在半年贬值约 1.59%。

在上半年度，摩根大通亚洲债券指数（JACI）回报为 -0.16%。其中捷克（+7.04%），沙特阿拉伯（5.91%），以色列（+4.83%），中国台湾（+4.61%），巴拉圭（+3.84%），中国

(+3.80%)，卡特尔(+3.66%)等跑赢指数；牙买加(-16.81%)，加纳(-15.58%)，多米尼加共和国(-15.26%)，拉脱维亚(-8.93%)等跑输指数。

第一季度，受新冠疫情与原油价格战影响，全球资本市场出现恐慌情绪，各种大类资产均出现技术性抛售。全球新兴市场美元信用债价格一度跌幅已接近 2008 年金融危机水平。当前市场走势并非由于违约风险飙升，而是主要受到技术原因驱动。2008 年金融危机以来，美元信用债从暴跌到反弹所需时间逐渐缩短。第二季度，4 月受益于美联储政策的升级、流动性的持续缓解及投资者对疫情拐点和经济重启的预期，全球美元债市场整体反弹。4 月 9 日美联储将 QE 范围扩大至高收益的 fallen angel，风险偏好进一步得到提振，市场继续反弹：4 月 9 日，美联储宣布了总规模高达 2.3 万亿美元的一篮子信贷支持的政策举措，更加针对中小企业的信用冲击，主要包括：信用债和相关 ETF 购买规模增加并扩大至高收益的从投资级被降为垃圾债评级的债券。4 月美联储 QE 政策再度升级，反弹行情继续，但期间受油价大跌等因素影响有所反复。在疫情得到初步控制背景下，欧美各国逐步放松限制。相应地，5 月以来，欧美经济正在逐步从此前的冰封状态温和回升。从高频数据看，欧美居民外出活动（消费，工作，公共交通）缓步修复。经济活动数据看，部分地区如德国餐馆就餐人数回升较快，美国 5 月前两周百货商场零售额、钢铁生产增速止跌，周度首次申请失业人数也逐步回落，显示劳动力市场压力有所缓解。另外，上周公布的 G4（美国，欧元区，日本，英国）国家 5 月 Markit PMI 初值数据显示，各国服务业 PMI 显著反弹，虽然依然在 50 以下；制造业也有不同程度的回升。

2020 年下半年，我们对于全球新兴市场债券市场还是呈谨慎乐观的态度。新兴市场的债券的估值（特别是在利差的水平）较三月技术性暴跌之前还有相当的恢复空间。在全球超宽松的宏观货币政策下，我们认识全球债券市场的需求继续稳固。债市会在潜在的政治不确定性（比如美国大选）导致的适当波动中进行逐渐恢复。

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

(1) 报告期内本基金未实施利润分配；

(2) 根据嘉实新兴市场 A1 本报告 3.1.1 “本期利润”为-44,322,603.85 元；嘉实新兴市场 C2 本报告 3.1.1 “本期利润”为-13,107,534.24 元，以及本基金基金合同（十九(三)基金收益分配原则）相关条款的约定，因此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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	175,983,703.68	90,797,022.69
结算备付金		-	7,258,410.03
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,567,239,554.75	1,595,980,456.17
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	10,235,227.47
债券投资		1,567,239,554.75	1,585,745,228.70
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		-	3,808,581.25
应收利息	6.4.7.5	23,046,556.28	22,680,060.72
应收股利		-	-
应收申购款		7,552,331.98	7,885,204.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,773,822,146.69	1,728,409,735.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	197,415.10	681,714.33
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		45,617,858.48	-
应付赎回款		60,674,111.97	45,371,804.59
应付管理人报酬		1,378,217.40	1,547,113.78
应付托管费		344,554.36	386,778.43
应付销售服务费		71,377.15	87,139.04
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		221,356.61	253,174.88
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	163,394.63	273,615.42
负债合计		108,668,285.70	48,601,340.47
所有者权益：			

实收基金	6.4.7.9	1,040,151,405.46	997,627,265.89
未分配利润	6.4.7.10	625,002,455.53	682,181,128.84
所有者权益合计		1,665,153,860.99	1,679,808,394.73
负债和所有者权益总计		1,773,822,146.69	1,728,409,735.20

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，嘉实新兴市场 A1 基金份额净值 1.293 元，基金份额总额 1,152,856,514.47 份；嘉实新兴市场 C2 基金份额净值 1.139 美元，基金份额总额 21,616,447.38 份。基金份额总额合计为 1,174,472,961.85 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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		-47,481,809.72	45,341,947.88
1. 利息收入		37,722,630.82	10,992,503.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	274,053.22	151,411.98
债券利息收入		37,448,577.60	10,841,091.87
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-88,465,557.84	7,766,125.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	65,486.77	-
债券投资收益	6.4.7.14	-89,401,874.40	7,158,335.12
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	870,829.79	355,127.70
股利收益	6.4.7.16	-	252,662.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,250,208.67	28,592,176.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-555,100.34	-2,268,215.72
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	566,008.97	259,357.83
减：二、费用		9,948,328.37	3,159,385.86
1. 管理人报酬		7,380,381.52	2,016,054.52
2. 托管费		1,845,095.41	504,013.55
3. 销售服务费		456,419.43	485,062.83
4. 交易费用	6.4.7.19	-	5,627.09
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		132,606.12	35,509.87
7. 其他费用	6.4.7.20	133,825.89	113,118.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-57,430,138.09	42,182,562.02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-57,430,138.09	42,182,562.02

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：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020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)	997,627,265.89	682,181,128.84	1,679,808,394.73
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-57,430,138.09	-57,430,138.09
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)	42,524,139.57	251,464.78	42,775,604.35
其中：1. 基金申购款	986,689,451.08	599,685,473.14	1,586,374,924.22
2. 基金赎回款	-944,165,311.51	-599,434,008.36	-1,543,599,319.87
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)	1,040,151,405.46	625,002,455.53	1,665,153,860.99
项目	上年度可比期间 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. 基金赎回款	-77,950,909.28	-43,417,843.32	-121,368,752.60
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

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

罗丽丽

罗丽丽

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实新兴市场债券型证券投资基金(原名为嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1154号《关于核准嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集美元 112,683,963.54 元和人民币 460,866,469.02 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第 706 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基

金合同》于 2013 年 11 月 26 日正式生效，基金合同生效日嘉实新兴市场 A 份额 112,685,757.47 份和嘉实新兴市场 B 份额 461,115,683.76 份，其中认购资金利息折合嘉实新兴市场 A 份额 1,793.93 份和嘉实新兴市场 B 份额 249,214.74 份。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为香港上海汇丰银行有限公司。

根据《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金基金合同》和《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，自基金合同生效之日起 2 年内，本基金的基金份额划分为嘉实新兴市场 A 份额和嘉实新兴市场 B 份额。嘉实新兴市场 A 份额(也称为美元份额)以美元计价并进行认购、申购、赎回，基金合同生效之日起 2 年内每满 6 个月之日为开放日，在嘉实新兴市场 A 份额的每个开放日，基金管理人将对嘉实新兴市场 A 份额进行基金份额折算，将份额净值调整为 1.000 美元，基金份额持有人持有的嘉实新兴市场 A 份额数按折算比例相应增减，并且本基金以嘉实新兴市场 B 份额的余额为基准，以经汇率折算后的嘉实新兴市场 A 份额与嘉实新兴市场 B 份额之比不超过 6:4 为原则，对嘉实新兴市场 A 份额的有效申购申请进行确认。嘉实新兴市场 B 份额(也称为人民币份额)以人民币计价并进行认购、申购、赎回，自基金合同生效之日起 2 年内封闭运作。本基金分级运作期内，嘉实新兴市场 A 基金份额收取销售服务费，年费率为 0.5%，嘉实新兴市场 B 基金份额不收取销售服务费。本基金分级运作届满日，本基金转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金，本基金的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的不同类别份额，其中本基金嘉实新兴市场 A 份额将转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额，嘉实新兴市场 B 份额将转为嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额。嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 C2 类份额(美元份额)以美元计价并进行申购，从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，对于持有期限不少于 30 日的本类别基金份额的赎回亦不收取赎回费，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费。嘉实新兴市场债券型证券投资基金的 A1 类份额(人民币份额)以人民币计价并进行申购，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用。

根据《关于嘉实新兴市场双币分级债券运作届满更名为嘉实新兴市场债券和基金份额转换的公告》和《嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金两年运作期届满后基金份额转换结果的公告》，嘉实新兴市场双币分级债券型证券投资基金生效之日起两年期届满后，于 2015 年 11 月 26 日自动转换为“嘉实新兴市场债券型证券投资基金”，嘉实新兴市场 A 份额和嘉实新兴市场 B 份额运作终止，分别转换为嘉实新兴市场 C2 份额和嘉实新兴市场 A1 份额，份额转换比例分别为 1.014:1 和 1.268:1。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》

和《嘉实新兴市场债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括政府债券、政府支持债券、公司债券(包括公司发行的金融债券)、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券、房地产信托凭证(REITs)、公募基金(包括 ETF)、货币市场工具、结构性投资产品、利率互换、信用违约互换、债券期货、货币远期或期货合约、外汇互换等用于组合避险或有效管理的金融衍生工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为：本基金投资组合中债券类资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于新兴市场债券的比例不低于非现金基金资产的 80%。现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的比例。“新兴市场债券”指新兴市场国家或地区的政府发行债券、总部登记注册在新兴市场国家或地区主要业务收入/资产在新兴市场国家或地区的机构、企业等发行的债券，主要包括离岸人民币债券及中国、香港美元债券部分亚洲及其他新兴市场国家或地区政府、金融机构及公司发行的以美元或本币计价的固定收益证券。“新兴市场国家或地区”所指的主要包括：中国、韩国、台湾、香港、新加坡、印度、土耳其、泰国、马来西亚、印度尼西亚、以色列、菲律宾、中东地区、南非、埃及、摩洛哥、俄罗斯、捷克、波兰、匈牙利、巴西、墨西哥、智利、哥伦比亚、秘鲁等国家或地区。本基金主要投资于与中国证监会签署备忘录的新兴市场国家或地区的证券。本基金的业绩比较基准为：同期人民币一年期定期存款利率+1%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关境内外财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金在境内取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金在境内从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金在境内持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

花税。

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

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

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

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 2020年6月30日
活期存款	175,983,703.68
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	175,983,703.68

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 2020年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	-	-	-	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	-	-	
	OTC市场	1,531,560,238.87	1,567,239,554.75	35,679,315.88
	合计	1,531,560,238.87	1,567,239,554.75	35,679,315.88
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,531,560,238.87	1,567,239,554.75	35,679,315.88	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	50,254,110.98	-	197,415.10	-
其中：外汇远期投资	50,254,110.98	-	197,415.10	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	50,254,110.98	-	197,415.10	-

注：合同/名义金额中的外币金额以财务报表期末时点的汇率折算为人民币列示。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	6,347.74
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	23,040,208.54
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	23,046,556.28

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	44,049.95
应付证券出借违约金	-
预提费用	119,344.68
合计	163,394.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实新兴市场 A1

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,080,470,808.86	852,286,782.11
本期申购	1,224,650,728.50	966,131,388.66
本期赎回(以“-”号填列)	-1,152,265,022.89	-908,970,883.12
本期末	1,152,856,514.47	909,447,287.65

嘉实新兴市场 C2

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	24,030,416.35	145,340,483.78
本期申购	3,398,524.51	20,558,062.42
本期赎回(以“-”号填列)	-5,812,493.48	-35,194,428.39
本期末	21,616,447.38	130,704,117.81

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实新兴市场 A1			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	555,790,435.08	66,694,736.59	622,485,171.67
本期利润	-50,479,915.24	6,157,311.39	-44,322,603.85
本期基金份额交易产生的变动数	5,874,417.43	-2,576,644.17	3,297,773.26
其中：基金申购款	579,828,902.14	12,957,119.41	592,786,021.55
基金赎回款	-573,954,484.71	-15,533,763.58	-589,488,248.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	511,184,937.27	70,275,403.81	581,460,341.08
嘉实新兴市场 C2			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	53,490,157.88	6,205,799.29	59,695,957.17
本期利润	-10,200,431.52	-2,907,102.72	-13,107,534.24
本期基金份额交易产生的变动数	-5,209,963.07	2,163,654.59	-3,046,308.48
其中：基金申购款	6,741,782.64	157,668.95	6,899,451.59
基金赎回款	-11,951,745.71	2,005,985.64	-9,945,760.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,079,763.29	5,462,351.16	43,542,114.45

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	260,562.48
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	13,490.74
合计	274,053.22

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	10,182,444.90
减：卖出/赎回基金成本总额	10,114,993.53
减：基金投资收益应缴纳增值税额	1,964.60
基金投资收益	65,486.77

6.4.7.14 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,722,003,024.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,778,140,163.71
减：应收利息总额	33,264,735.05
买卖债券差价收入	-89,401,874.40

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020年1月1日至2020年6月30日
外汇远期投资收益	870,829.79

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	2,765,909.44
股票投资	-
债券投资	2,886,143.38
资产支持证券投资	-
基金投资	-120,233.94
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	484,299.23
权证投资	-
远期	484,299.23
期货	-
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	3,250,208.67

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	557,247.22
其他	8,761.75
合计	566,008.97

6.4.7.19 交易费用

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	59,672.34
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	8,504.98
其他	5,976.23
合计	133,825.89

6.4.7.21 汇兑收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
汇兑收益	-555,100.34
合计	-555,100.34

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	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

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	709,859,897.84	9.68	237,130,502.01	7.72

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	7,380,381.52	2,016,054.52
其中：支付销售机构的客户维护费	2,070,096.44	769,539.18

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%/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
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,845,095.41	504,013.55

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2020年1月1日至2020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	-	1,527.03	1,527.03
中国工商银行	-	185,312.46	185,312.46
合计	-	186,839.49	186,839.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年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

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，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C2 类基金份额日销售服务费 = 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。

6.4.10.3 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至2020年 06月30日	本期 2020年01月01日至2020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	-	0.35%
项目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 06月30日	上年度可比期间 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	-	0.32%

占基金总份额比例		
----------	--	--

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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	36,107,301.23	260,562.48	35,187,116.76	150,387.75
香港上海汇丰银行有限公司_活期	139,876,402.45	-	106,822,017.20	-

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。

6.4.10.7 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

6.4.10.8.1 外汇远期交易

本期 2020年1月1日至2020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	8,422,423.28	2,094,890.84
	卖出欧元	欧元	4,449,608.25	4,449,608.25
上年度可比期间 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

6.4.10.8.2 期货交易

本期（2020年1月1日至2020年6月30日）及上年度可比期间（2019年1月1日至2019年6月30日），本基金未与关联方进行期货交易。

6.4.11 利润分配情况

本期（2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2020 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

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

无。

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

本基金为债券型基金，主要投资于新兴市场的各类债券，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在审慎的投资管理和风险控制下，力争总回报最大化，以谋求长期保值增值。本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。董事会下设风险控制与内审委员会，负责检查公司内部管理制度的合法合规性及内控制度的执行情况，充分发挥独立董事监督职能，保护投资者利益和公司合法权益。

为了有效控制基金运作和管理中存在的风险，本基金的基金管理人设立风险控制委员会，由公司总经理、督察长以及部门总监组成，负责全面评估公司经营管理过程中的各项风险，并提出防范化解措施。

本基金的基金管理人设立督察长制度，积极对公司各项制度、业务的合法合规性及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公司内部控制执行情况。监察稽核部具体负责公司各项制度、业务的合法合规性及公司内部控制制度的执行情况的监察稽核工作。

公司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 workflows、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。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在境内和境外托管人，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,567,239,554.75	1,585,745,228.70
未评级	-	-
合计	1,567,239,554.75	1,585,745,228.70

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

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在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金持有非流动性资产市值不得超过基金资产净值的 10%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场或柜台市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场或柜台市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	175,983,703.68	-	-	-	175,983,703.68
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	334,777,181.12	1,232,462,373.63	-	1,567,239,554.75
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	-	-	-	23,046,556.28	23,046,556.28
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,552,331.98	7,552,331.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	175,983,703.68	334,777,181.12	1,232,462,373.63	30,598,888.26	1,773,822,146.69
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	197,415.10	197,415.10
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	45,617,858.48	45,617,858.48
应付赎回款	-	-	-	60,674,111.97	60,674,111.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,378,217.40	1,378,217.40
应付托管费	-	-	-	344,554.36	344,554.36
应付销售服务费	-	-	-	71,377.15	71,377.15
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	221,356.61	221,356.61
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	163,394.63	163,394.63
负债总计	-	-	-	108,668,285.70	108,668,285.70
利率敏感度缺口	175,983,703.68	334,777,181.12	1,232,462,373.63	-78,069,397.44	1,665,153,860.99
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	90,797,022.69	-	-	-	90,797,022.69
结算备付金	7,258,410.03	-	-	-	7,258,410.03
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	313,337,842.87	1,272,407,385.83	10,235,227.47	1,595,980,456.17
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,808,581.25	3,808,581.25
应收利息	-	-	-	22,680,060.72	22,680,060.72
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	53,723.00	-	-	7,831,481.34	7,885,204.34
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	98,109,155.72	313,337,842.87	1,272,407,385.83	44,555,350.78	1,728,409,735.20
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	681,714.33	681,714.33
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	45,371,804.59	45,371,804.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,547,113.78	1,547,113.78
应付托管费	-	-	-	386,778.43	386,778.43
应付销售服务费	-	-	-	87,139.04	87,139.04
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	253,174.88	253,174.88
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	273,615.42	273,615.42
负债总计	-	-	-	48,601,340.47	48,601,340.47
利率敏感度缺口	98,109,155.72	313,337,842.87	1,272,407,385.83	-4,045,989.69	1,679,808,394.73

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

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-26,950,298.72	-24,281,141.48
	市场利率下降 25 个基点	26,957,687.84	24,286,127.76

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 2020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	142,019,207.36	50.55	5,774.80	142,025,032.71
结算备付金	-	-	-	-
交易性金融资产	1,542,231,705.25	-	25,007,849.50	1,567,239,554.75
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	22,553,448.90	-	486,882.26	23,040,331.16
应收申购款	14,725.36	-	-	14,725.36
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,706,819,086.87	50.55	25,500,506.56	1,732,319,643.98

以外币计价的负债				
应付证券清算款	45,617,858.48	-	-	45,617,858.48
衍生金融负债	197,415.10	-	-	197,415.10
应付赎回款	713,602.77	-	-	713,602.77
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	46,528,876.35	-	-	46,528,876.35
资产负债表外汇风险敞口净额	1,660,290,210.52	50.55	25,500,506.56	1,685,790,767.63
项目	上年度末 2019年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	77,930,819.62	49.57	5,838.76	77,936,707.95
结算备付金	7,258,410.03	-	-	7,258,410.03
交易性金融资产	1,556,144,149.27	-	39,836,306.90	1,595,980,456.17
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	21,923,468.60	-	745,238.10	22,668,706.70
应收申购款	152,918.30	-	-	152,918.30
应收证券清算款	3,808,581.25	-	-	3,808,581.25
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,667,218,347.07	49.57	40,587,383.76	1,707,805,780.40
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	435,622.53	-	-	435,622.53

应付赎回款	239,283.24	-	-	239,283.24
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	674,905.77	-	-	674,905.77
资产负债表外汇风险敞口净额	1,666,543,441.30	49.57	40,587,383.76	1,707,130,874.63

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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值5%	84,289,538.38	85,356,543.73
	所有外币相对人民币贬值5%	-84,289,538.38	-85,356,543.73

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	10,235,227.47	0.61
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	-	-	10,235,227.47	0.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性权益类投资（于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.61%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,567,239,554.75 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 10,235,227.47 元，第二层次 1,585,745,228.70 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
3	固定收益投资	1,567,239,554.75	88.35
	其中：债券	1,567,239,554.75	88.35
	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	175,983,703.68	9.92
8	其他各项资产	30,598,888.26	1.73
9	合计	1,773,822,146.69	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

无。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

无。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

无。

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

无。

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

无。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

无。

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 (%)
AA	6,278,893.50	0.38
AA-	7,028,640.87	0.42
A+	4,104,410.92	0.25
A	52,844,085.29	3.17
A-	71,408,491.07	4.29
BBB+	67,253,770.39	4.04
BBB	164,923,434.08	9.90
BBB-	236,966,774.97	14.23
BB+	120,335,436.62	7.23
BB	153,712,602.64	9.23
BB-	210,943,799.66	12.67
B+	135,328,935.87	8.13
B	160,724,062.63	9.65
B-	90,516,660.51	5.44
CCC+	31,430,417.23	1.89
CCC	31,235,001.77	1.88
CCC-	22,204,136.73	1.33

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

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	XS1297557412	GHANA 10 3/4 10/14/30	24,778,250	29,857,295.69	1.79
2	XS2083302419	ANGOL 8 11/26/29	28,318,000	23,504,223.18	1.41
3	XS2158697255	DPWU 6 PERP	18,406,700	18,230,916.02	1.09
4	USN57445AA17	MINCAP 4 5/8 08/10/30	17,698,750	18,074,140.49	1.09
5	XS1819680528	ANGOL 9 3/8 05/08/48	21,238,500	17,414,720.46	1.05

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所有资产支持证券投资明细

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)	282,428.09	0.02
2	远期投资	外汇远期 (美元对欧元)	244,545.26	0.01
3	远期投资	外汇远期 (欧元对美元)	25,654.27	0.00
4	远期投资	外汇远期 (欧元对美元)	-29,317.34	-0.00
5	远期投资	外汇远期 (欧元对美元)	-169,200.05	-0.01

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

无。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,046,556.28
5	应收申购款	7,552,331.98

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,598,888.26

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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

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	188,842	6,104.87	471,206,175.91	40.87	681,650,338.56	59.13
嘉实新兴市场 C2	1,298	16,653.66	76,532.14	0.35	21,539,915.24	99.65
合计	190,109	6,177.89	471,282,708.05	40.13	703,190,253.80	59.87

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	416,099.40	0.04
	嘉实新兴市场 C2	16,395.66	0.08

	合计	432,495.06	0.04
--	----	------------	------

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	1,080,470,808.86	24,030,416.35
本报告期基金总申购份额	1,224,650,728.50	3,398,524.51
减：本报告期基金总赎回份额	1,152,265,022.89	5,812,493.48
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额	1,152,856,514.47	21,616,447.38

§ 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

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

2020 年 4 月 8 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	-	-	-	-	-	
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	
渣打(伦敦)银行 Standard Chartered Bank London	-	-	-	-	-	
澳新银行集团 Australia and New Zealand Banking Group	-	-	-	-	-	
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	
Linear Investment Limited	-	-	-	-	-	
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and In vestment Banking	-	-	-	-	-	
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	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
Liquidity Finance LLP	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
BANCO SANTANDER, S. A	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong)Limited	-	-	-	-	-	-
三菱 UFJ 证券国际有限公司 Mitsubishi UFJ Securities International Plc	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-
中银香港 Bank of China Hong Kong	-	-	-	-	-	-
日兴证券 SMBC Nikko Capital Markets Limited	-	-	-	-	-	-
俄罗斯天然气工业银行 GAZPROMBANK	-	-	-	-	-	-
凯万亚洲有限公司 Oppenheimer Investments Asia Ltd	-	-	-	-	-	-
荷兰商业银行 ING Bank N.V.	-	-	-	-	-	-
香港独立债券及贷款交易公司 SC Lowy Financial(HK) Ltd	-	-	-	-	-	-

星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	-	-	-	-	-	
中信银行(国际)有限公司 China CITIC Bank International Limited	-	-	-	-	-	
华泰金融控股(香港)有限公司	-	-	-	-	-	
CSI GLOBAL MARKETS LIMITED	-	-	-	-	-	
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	-	-	-	-	-	
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	
巴西布拉德斯科银行 BRADESCO	-	-	-	-	-	
工银国际证券有限公司 ICBC INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	
阿联酋资本 ARQAM CAPITAL	-	-	-	-	-	
第一阿布扎比银行 First Abu Dhabi Bank PJSC, Hong Kong	-	-	-	-	-	
BCP Securities, LLC	-	-	-	-	-	
中国银行香港分行 Bank of China Limited HK Branch	-	-	-	-	-	
瑞信证券美国 Credit Suisse Securities (USA) LLC	-	-	-	-	-	
农业信贷银行 Credit Agricole Corporate and investment bank	-	-	-	-	-	

中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
苏格兰皇家银行 Royal Bank of Scotland Plc(RBS)	-	-	-	-	-	-
尚乘资产管理有限公司 AMTD Asset Management Limited	-	-	-	-	-	-
凯基证券(香港)有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
交通银行股份有限公司香港分行 Bank of Communications Co., Ltd. HK Branch	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
加拿大皇家银行 Royal Bank of Canada	-	-	-	-	-	-
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-
工银国际控股有限公司 ICBC International Holdings Limited	-	-	-	-	-	-

ited						
法国外贸银行 NATIXIS	-	-	-	-	-	
法国巴黎证券（亚洲）有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	
俄罗斯外贸银行资本公司 VTB CAPITAL PLC	-	-	-	-	-	
东方汇理 CREDIT AGRICOLE CORPORATE AND INVESTMENT BANK	-	-	-	-	-	
德国商业银行 Commerzbank AG	-	-	-	-	-	
渤海证券 Bohai Securities Co. Ltd.	-	-	-	-	-	
澳大利亚国民银行 National Bank of Australia	-	-	-	-	-	
J.P. 摩根资本顾问有限公司 Morgan Capital Advisors LLP	-	-	-	-	-	
CHINA MERCHANTS SECURITIES (HK) CO., LTD	-	-	-	-	-	
俄罗斯联邦储蓄银行 Sberbank CIB (UK) Limited	-	-	-	-	-	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。

10.7.2 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
摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	921,792,455.73	12.57%	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	722,012,436.06	9.85%	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	709,859,897.84	9.68%	-	-	-	-
巴克莱 Barclays	566,664,563.51	7.73%	-	-	-	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	557,315,849.61	7.60%	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	439,729,570.59	6.00%	-	-	-	-
高盛（亚洲）有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	427,648,251.21	5.83%	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	392,076,982.41	5.35%	-	-	-	-
澳新银行集团 Australia and New Zealand Banking Group	329,011,176.07	4.49%	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	275,519,252.67	3.76%	-	-	-	-
渣打（伦敦）银行 Standard Chartered Bank London	271,616,630.45	3.70%	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	219,733,284.89	3.00%	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司	214,229,555.21	2.92%	-	-	-	-

Deutsche Bank						
野村国际（香港）有限公司 Nomura International (Hong Kong) Limited	182,154,960.75	2.48%	-	-	-	-
瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	179,646,903.20	2.45%	-	-	-	-
Liquidity Finance LLP	164,373,092.32	2.24%	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	95,122,973.73	1.30%	-	-	-	-
俄罗斯天然气工业银行 GAZPROMBANK	87,559,476.91	1.19%	-	-	-	-
荷兰商业银行 ING Bank N.V.	80,719,260.89	1.10%	-	-	-	-
BANCO SANTANDER, S.A	64,805,129.98	0.88%	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	52,124,514.48	0.71%	-	-	-	-
日兴证券 SMBC Nikko Capital Markets Limited	44,898,206.67	0.61%	-	-	-	-
国泰君安证券（香港）有限公司 Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	41,596,988.96	0.57%	-	-	-	-
BCP Securities, LLC	39,693,753.85	0.54%	-	-	-	-
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	35,777,697.85	0.49%	-	-	-	-
Linear Investment Limited	30,110,005.81	0.41%	-	-	-	-
香港独立债券及贷款交易公司 SC Lowy Financial (HK) Ltd	28,912,227.80	0.39%	-	-	-	-
三菱 UFJ 证券国际有限公司 Mitsubishi UFJ Securities International Plc	26,599,682.62	0.36%	-	-	-	-
瑞信证券美国 Credit Suisse Securities (USA) LLC	23,001,522.34	0.31%	-	-	-	-
第一阿布扎比银行 First Abu Dhabi Bank PJSC, Hong Kong	18,892,089.70	0.26%	-	-	-	-

华泰金融控股（香港）有限公司	18,535,167.95	0.25%	-	-	-	-
农业信贷银行 Credit Agricole Corporate and investment bank	17,936,139.22	0.24%	-	-	-	-
阿联酋资本 ARQAM CAPITAL	16,214,233.27	0.22%	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	15,401,658.67	0.21%	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	7,814,734.94	0.11%	-	-	-	-
中国银行香港分行 Bank of China Limited HK Branch	7,102,241.17	0.10%	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	3,546,769.43	0.05%	-	-	-	-
俄罗斯联邦储蓄银行 Sberbank CIB (UK) Limited	3,507,031.55	0.05%	-	-	-	-

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	关于增聘嘉实新兴市场债券基金经理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月03日
2	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月14日
3	嘉实基金管理有限公司关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月02日
4	关于嘉实新兴市场 2020 年 4 月 10 日至 4 月 13 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月08日
5	关于嘉实新兴市场 2020 年 4 月 30 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年04月28日
6	关于嘉实新兴市场债券型证券投资基金 2020 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定投业务公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年06月29日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020/03/16 至 2020/03/25	-	179,675,702.73	-	179,675,702.73	15.30
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

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

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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

12.3 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

2020年08月29日