

# 嘉实汇鑫中短债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。本中期报告已经由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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
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 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表 .....	16
6.2 利润表 .....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	18
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>35</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	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 .....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	36
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 .....	36
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 .....	37
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 .....	37

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 .....	37
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	37
7.12 投资组合报告附注 .....	37
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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 .....	38
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>39</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	43
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>43</b>
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 .....	43
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>43</b>
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	44
12.3 查阅方式 .....	44

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实汇鑫中短债债券	
基金主代码	007529	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 9 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	60,015,257.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实汇鑫中短债债券 A	嘉实汇鑫中短债债券 C
下属分级基金的交易代码	007529	007530
报告期末下属分级基金的份 额总额	60,009,795.20 份	5,462.64 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，重点投资中短债主题证券，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在严格控制风险的前提下，通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，挖掘价值被低估的标的券种，力争实现超越业绩基准的投资收益。
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率*80%+一年期定期存款利率（税后）*20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

### 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
	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
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 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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)	
	嘉实汇鑫中短债债券 A	嘉实汇鑫中短债债券 C
本期已实现收益	917,453.51	59.32
本期利润	697,241.94	50.89
加权平均基金份额本期利润	0.0060	0.0029
本期加权平均净值利润率	0.59%	0.29%
本期基金份额净值增长率	0.61%	0.41%
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	683,307.63	45.43
期末可供分配基金份额利润	0.0114	0.0083
期末基金资产净值	60,693,102.83	5,508.07
期末基金份额净值	1.0114	1.0083

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	1.14%	0.83%

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) 嘉实汇鑫中短债债券 A 收取认（申）购费用和赎回费，嘉实汇鑫中短债债券 C 不收取认（申）购费用但收取赎回费、计提销售服务费；(3) 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；(4) 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

嘉实汇鑫中短债债券 A

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	0.03%	0.02%	-0.48%	0.08%	0.51%	-0.06%
过去三个月	0.17%	0.02%	0.00%	0.09%	0.17%	-0.07%
过去六个月	0.61%	0.01%	1.53%	0.07%	-0.92%	-0.06%
自基金合同生效起至今	1.14%	0.02%	2.52%	0.06%	-1.38%	-0.04%

嘉实汇鑫中短债债券 C

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	-0.01%	0.02%	-0.48%	0.08%	0.47%	-0.06%
过去三个月	0.07%	0.02%	0.00%	0.09%	0.07%	-0.07%
过去六个月	0.41%	0.01%	1.53%	0.07%	-1.12%	-0.06%
自基金合同生效起至今	0.83%	0.01%	2.52%	0.06%	-1.69%	-0.05%

注：本基金业绩比较基准为：中债总财富（1-3 年）指数收益率×80%+ 一年期定期存款利率（税后）×20%

中债总财富（1-3 年）指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中债总财富细分指数之一。该指数同时覆盖了上海证券交易所、深圳证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的待偿期限在 1-3 年（含 1 年）的国债、央行票据、政策性金融债，能较好地反映中短期债券市场的整体收益情况。

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：

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

$\text{Return}(t)=80\% \times (\text{中债总财富}(1-3 \text{ 年}) \text{ 指数}(t) / \text{中债总财富}(1-3 \text{ 年}) \text{ 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times \text{一年期定期存款利率}(\text{税后})$

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

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

嘉实汇鑫中短债债券 A 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

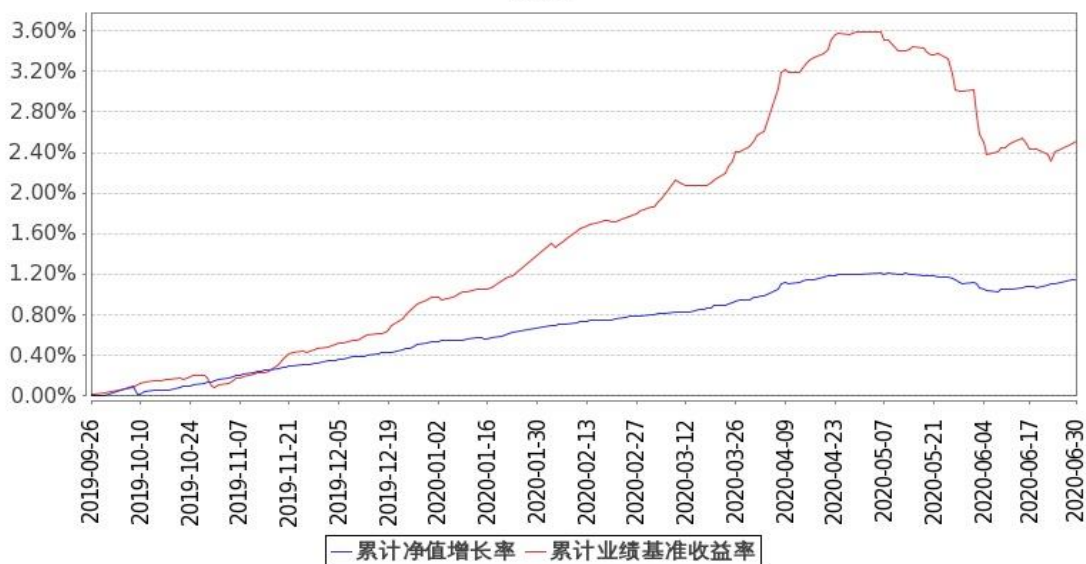


图 1：嘉实汇鑫中短债债券 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 9 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日)



### 嘉实汇鑫中短债债券 C 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

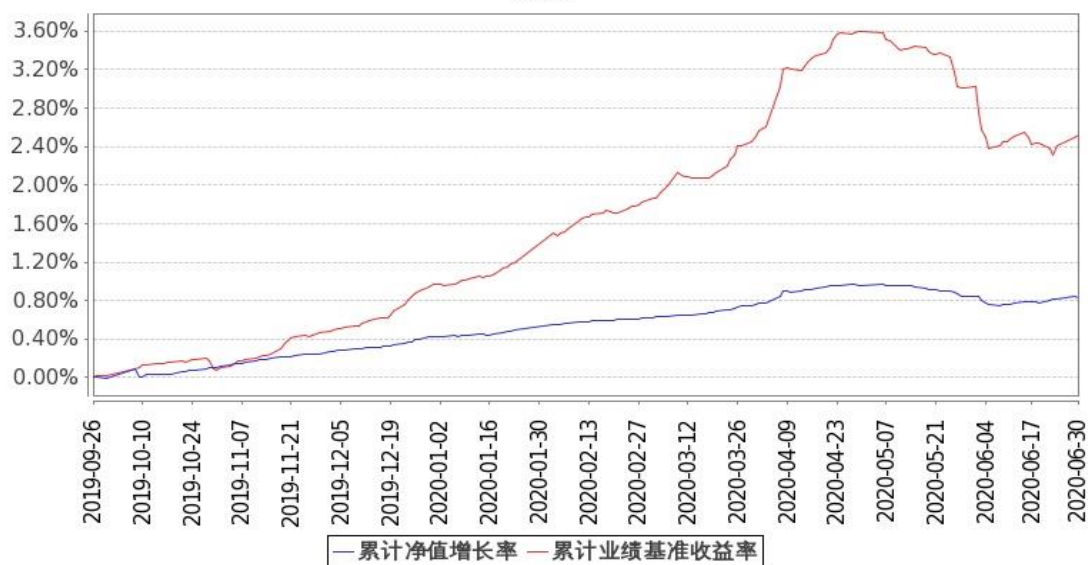


图 2：嘉实汇鑫中短债债券 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 9 月 26 日至 2020 年 6 月 30 日)

注：本基金基金合同生效日 2019 年 9 月 26 日至报告期末未满 1 年。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 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同（十二（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		
李瞳	本基金、嘉实超短债债券、嘉实活钱包货币、嘉实现金添利货币、嘉实中短债债券基金经理	2019年9月26日		10年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014年12月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士研究生，具有基金从业资格。
李金灿	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、理财宝 7 天债券、嘉实宝、嘉实薪金宝货币、嘉实定期宝 6 个月理财债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实中短债债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实融享货币基金经理	2019年9月26日		10年	曾任 Futex Trading Ltd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012年8月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于固定收益业务体系短端 alpha 策略组。硕士研究生，CFA、具有基金从业资格。

注：（1）基金经理的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

实汇鑫中短债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

2020 年上半年，受疫情影响叠加经济封锁措施，多国经济严重下滑，全球经济增长受阻，各国执行刺激政策，经济整体呈现企稳复苏迹象。2020 年上半年，摩根大通全球综合 PMI 由上半年最低 26.2% 上升至 47.7%，摩根大通全球制造业 PMI 由上半年最低 39.6% 上升至 47.8%，摩根大通全球服务业 PMI 由上半年最低 23.7% 上升至 48%，OECD 综合领先指标由最低 94.56 上升至 97.30。具体来看，2020 年上半年，美国经济逐渐修复并复苏，美联储执行多重政策工具，ISM 制造业 PMI 由上半年最低 41.5% 上升至 52.6%；欧洲经济依然低迷，制造业 PMI 由上半年最低 33.4% 上升至 47.4%；日本经济形势严峻，制造业 PMI 由上半年最低 38.4% 上升至 40.1%；新兴经济市场经济持续承压，如印度制造业 PMI 由上半年最低 27.4% 上升至 47.2%，南非制造业 PMI 由上半年最低 32.5% 上升至 42.5%。

2020 年上半年，“疫情”冲击下，国内经济下行压力巨大，随着“疫情”多政策出台落地、“疫情”常态化和复工复产逐渐恢复，国内经济形势呈现修复向好趋势，部分月度指标有所上升或回落幅度收窄。上半年 GDP 同比增速为-1.6%，分季度看，一季度同比增长-6.8%，二季度增长 3.2%。具体来看，工业增加值由低走高，一季度均值为-10.43%，二季度均值为 4.37%；“克强指数”由一季度均值 2.03% 升至二季度均值 7.09%；中国制造业采购经理指数（PMI）均值重回荣枯线以上，

由一季度均值 45.9% 升至二季度均值 50.77%。以投资、消费和出口为代表的“三驾马车”增速亦自低位回升，固定资产投资同比增速整体由一季度均值-13.53% 升至二季度均值-6.57%，其中房地产开发投资由一季度均值-8% 升至二季度均值-0.57%，基础设施建设投资由一季度均值-14.41% 升至二季度均值-4.05%，民间固定资产投资由一季度均值-15.07% 升至二季度均值-10.07%；社会消费品零售总额同比增速由一季度均值-12.10% 升至二季度均值-4.03%；受抗疫物质出口和发达经济体经济企稳复苏，出口金额同比增速由一季度均值-7.90% 升至二季度均值 0.23%。另外，上半年，全国居民消费价格总水平同比增速回落，CPI 当月同比由年初 5.4% 回落至 2.5%；上半年 PPI 同比增速由上半年最低-3.70% 升至 3%。从金融数据来看，货币供应量整体依然处于高位，上半年 M2 同比增速均值为 10.10%，明显高于去年均值 8.38%；社会融资规模持续走高，上半年新增规模均值为 3.47 万亿元，明显高于去年均值 2.13 万亿元；新增人民币贷款亦明显上升，上半年新增均值为 2.01 万亿元，大幅高于去年均值 1.40 万亿元。上半年人民币汇率整体呈现先贬后升走势，CNY 上半年累计贬值 1.55%，CNH 上半年累计贬值 1.57%，上半年央行外汇资产新增为-575 亿元，去年同期新增为-101 亿元，跨境资金流出规模有所增大。

央行货币政策前松后敛，创设多种创新货币政策工具，政策节奏呈现前快后慢，上半年央行通过降准和定向降准，以及公开市场操作、再贷款、再贴现、国库现金定存、MLF 和 PSL 等政策工具适时补充和调节市场流动性，上半年公开市场操作（含国库现金定存）累计净回笼资金 3183 亿元。银行间市场资金利率震荡回落，2020 年上半年末隔夜和 7 天回购加权利率较去年末分别-1BP 和-2BP；银行间市场国债收益率曲线呈现下移，2020 年上半年末国债收益率曲线 1 年、3 年、5 年、7 年和 10 年期收益率较去年末分别-19BP、-34BP、-34BP、-22BP 和-13BP，10 年期与 1 年期国债期限利差为 64BP，较去年末缩窄 14BP。

2020 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券、同业存单和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制债券整体仓位。整体看，2020 年上半年本基金成功应对了市场波动，投资业绩平稳提高，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实汇鑫中短债债券 A 基金份额净值为 1.0114 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.61%；截至本报告期末嘉实汇鑫中短债债券 C 基金份额净值为 1.0083 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.41%；业绩比较基准收益率为 1.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国际货币基金组织（IMF）6月24日发布《世界经济展望报告》更新内容，预计2020年全球经济将萎缩4.9%，较4月份报告下调1.9个百分点。IMF在报告中说，新冠疫情及防控措施对全球经济的负面冲击超出预期，对低收入家庭的影响尤其严重。同时，全球经济复苏进程也较预期更为缓慢。基于下半年继续保持社交距离、经济创伤加剧、企业增加卫生安全措施以及金融环境保持现状等基准假设，IMF预计全球经济今年将萎缩4.9%，但有望在2021年增长5.4%。具体来看，报告预计今年发达经济体经济将萎缩8%，新兴市场和发展中经济体将萎缩3%，分别较4月份下调1.9个百分点和2个百分点。其中，美国经济将萎缩8%，欧元区经济将萎缩10.2%，日本经济将萎缩5.8%，均低于4月份预测。

国内经济随着前期多重政策叠加执行，基本面处于环比改善的通道，房地产销售已恢复到去年同期水平，基建投资预计在二季度财政明显发力的影响下三季度会在增速上得以体现，制造业投资和消费虽然复苏迟缓，但环比改善也具有较强的确定性。进入到四季度，经济继续改善的动能将明显受到财政空间遏制，即本轮经济的环比复苏存在上限，同时受疫情防控常态化的影响以及就业压力对收入增速和消费意愿的滞后影响，消费和制造业投资增速年内都将保持低位，四季度经济环比改善将明显弱化。

2020年上半年共有71只债券违约，涉及金额875.37亿元，同比去年上升45.98%，新增违约主体11家，主要涉及民营企业以及少部分地方、中央国有企业，违约的债券类别主要是超短期融资券、中期票据、公司债和企业债等。违约原因主要是由于新冠疫情的影响，部分公司的生产经营活动受到了冲击，当前的资金流动性紧张，信用风险仍在持续暴露。

今年以来，货币政策节奏变化较明显，央行一季度货币政策应对疫情，整体宽松；央行货币政策二季度随着疫情稳定和复工复产逐步推进，整体“适度”。央行行长易纲6月18日在第12届陆家嘴论坛上表示，疫情应对期间的金融支持政策是阶段性的，要注意激励约束相融，关注政策后遗症，保持总量适度，并提前考虑相关工具的适时退出。央行下半年货币政策基调延续稳健，但政策工具或以“直达性”工具为主，继续降低实体融资利率。

本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，以确保组合安全性和流动性为首要任务，兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，平衡配置同业存款和债券投资，谨慎控制组合的信用配置，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

#### 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（十六（三）基金收益分配原则）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，本基金托管人在对嘉实汇鑫中短债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，嘉实汇鑫中短债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汇鑫中短债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，嘉实汇鑫中短债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汇鑫中短债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：嘉实汇鑫中短债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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,313,772.99	1,333,154.12
结算备付金		-	214,285.71
存出保证金		-	9,810.04
交易性金融资产	6.4.7.2	50,087,000.00	70,045,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		50,087,000.00	70,045,000.00
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	8,000,212.00	47,000,190.50
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,438,097.79	2,136,868.00
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		60,839,082.78	120,739,308.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		26,088.30	-
应付管理人报酬		23,870.70	30,706.51
应付托管费		7,956.89	10,235.52
应付销售服务费		9.30	1.86
应付交易费用	6.4.7.7	2,983.57	5,240.55
应交税费		-	-
应付利息		-	-



应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,563.12	40,000.00
负债合计		140,471.88	86,184.44
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	60,015,257.84	120,018,984.75
未分配利润	6.4.7.10	683,353.06	634,139.18
所有者权益合计		60,698,610.90	120,653,123.93
负债和所有者权益总计		60,839,082.78	120,739,308.37

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，嘉实汇鑫中短债债券 A 基金份额净值 1.0114 元，基金份额总额 60,009,795.20 份；嘉实汇鑫中短债债券 C 基金份额净值 1.0083 元，基金份额总额 5,462.64 份。基金份额总额合计为 60,015,257.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实汇鑫中短债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
一、收入		1,037,085.37
1. 利息收入		1,635,815.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,093.30
债券利息收入		1,291,170.97
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		338,551.10
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-378,510.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-378,510.00
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	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-220,220.00
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	-
减：二、费用		339,792.54
1. 管理人报酬		174,754.63
2. 托管费		58,251.58

3. 销售服务费		34.23
4. 交易费用	6.4.7.18	2,050.00
5. 利息支出		5,754.98
其中：卖出回购金融资产支出		5,754.98
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	6.4.7.19	98,947.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		697,292.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		697,292.83

注：本基金合同生效日为 2019 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实汇鑫中短债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）	120,018,984.75	634,139.18	120,653,123.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	697,292.83	697,292.83
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）	-60,003,726.91	-648,078.95	-60,651,805.86
其中：1. 基金申购款	24,637.02	174.05	24,811.07
2. 基金赎回款	-60,028,363.93	-648,253.00	-60,676,616.93
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）	60,015,257.84	683,353.06	60,698,610.90

注：本基金合同生效日为 2019 年 9 月 26 日，无上年度可比期间数据。

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

基金管理人负责人

罗丽丽

主管会计工作负责人

罗丽丽

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会

（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]420号《关于准予嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于2019年9月17日至2019年9月25日向社会公开募集，基金合同于2019年9月26日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为256,008,295.21份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2019）验字第60468756\_A04号验资报告予以验证。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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。各类基金份额类别分别设置代码，合并投资运作，分别计算和公告各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。在投资人认购/申购基金份额时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。

本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等债券，以及资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、国债期货、现金等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资于股票、权证等资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，其中投资于中短债主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；国债期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金所指的中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、中小企业私募债等金融工具。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中债总财富（1-3年）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率（税后）\*20%。

#### 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

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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 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〈年度报告和中期报告〉》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及参考意见。

#### 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 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

无。

#### 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	1,313,772.99
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	1,313,772.99

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	50,349,050.00	50,087,000.00	-262,050.00
	合计	50,349,050.00	50,087,000.00	-262,050.00
资产支持证券	-	-	-	

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	50,349,050.00	50,087,000.00	-262,050.00

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	8,000,212.00	-
合计	8,000,212.00	-

##### 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	118.81
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	1,436,505.30
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,473.68
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	1,438,097.79

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	2,983.57
合计	2,983.57

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	79,563.12
合计	79,563.12

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 嘉实汇鑫中短债债券 A

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	120,013,487.74	120,013,487.74
本期申购	1,800.34	1,800.34
本期赎回（以“-”号填列）	-60,005,492.88	-60,005,492.88
本期末	60,009,795.20	60,009,795.20

##### 嘉实汇鑫中短债债券 C

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	5,497.01	5,497.01
本期申购	22,836.68	22,836.68
本期赎回（以“-”号填列）	-22,871.05	-22,871.05
本期末	5,462.64	5,462.64

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

##### 嘉实汇鑫中短债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	670,520.45	-36,404.61	634,115.84
本期利润	917,453.51	-220,211.57	697,241.94
本期基金份额交易产生的变动数	-876,760.38	228,710.23	-648,050.15
其中：基金申购款	10.81	-0.08	10.73
基金赎回款	-876,771.19	228,710.31	-648,060.88



本期已分配利润	-	-	-
本期末	711,213.58	-27,905.95	683,307.63
嘉实汇鑫中短债债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24.98	-1.64	23.34
本期利润	59.32	-8.43	50.89
本期基金份额交易产生的变动数	-36.37	7.57	-28.80
其中：基金申购款	164.71	-1.39	163.32
基金赎回款	-201.08	8.96	-192.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47.93	-2.50	45.43

#### 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	6,009.50
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	28.96
其他	54.84
合计	6,093.30

#### 6.4.7.12 股票投资收益

无。

#### 6.4.7.13 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	195,193,893.94
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	190,525,240.00
减：应收利息总额	5,047,163.94
买卖债券差价收入	-378,510.00

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

无。

#### 6.4.7.16 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	-220,220.00
股票投资	-
债券投资	-220,220.00
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	-220,220.00

#### 6.4.7.17 其他收入

无。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日 至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	2,050.00
合计	2,050.00

#### 6.4.7.19 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	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,884.00
债券托管账户维护费	15,000.00
其他	500.00
合计	98,947.12

#### 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

**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**

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
当期发生的基金应支付的管理费	174,754.63
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 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 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,251.58

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 0.10% 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×0.10%/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		
	嘉实汇鑫中短债债券 A	嘉实汇鑫中短债债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	34.23	34.23
合计	-	34.23	34.23

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，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：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。（2）本基金 A 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

无。

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

无。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	1,313,772.99	6,009.50

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按适用利率计息。

**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。

**6.4.11 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 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**

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

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 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 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 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	1,313,772.99	-	-	-	1,313,772.99
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	50,087,000.00	-	-	-	50,087,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	8,000,212.00	-	-	-	8,000,212.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,438,097.79	1,438,097.79
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	59,400,984.99	-	-	1,438,097.79	60,839,082.78
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	-	-	-	26,088.30	26,088.30
应付管理人报酬	-	-	-	23,870.70	23,870.70
应付托管费	-	-	-	7,956.89	7,956.89
应付销售服务费	-	-	-	9.30	9.30



应付交易费用	-	-	-	2,983.57	2,983.57
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	79,563.12	79,563.12
负债总计	-	-	-	140,471.88	140,471.88
利率敏感度缺口	59,400,984.99	-	-	-1,297,625.91	60,698,610.90
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	1,333,154.12	-	-	-	1,333,154.12
结算备付金	214,285.71	-	-	-	214,285.71
存出保证金	9,810.04	-	-	-	9,810.04
交易性金融资产	70,045,000.00	-	-	-	70,045,000.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	47,000,190.50	-	-	-	47,000,190.50
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	2,136,868.00	2,136,868.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	118,602,440.37	-	-	-2,136,868.00	120,739,308.37
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	30,706.51	30,706.51
应付托管费	-	-	-	10,235.52	10,235.52
应付销售服务费	-	-	-	1.86	1.86
应付交易费用	-	-	-	5,240.55	5,240.55
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	86,184.44	86,184.44
利率敏感度缺口	118,602,440.37	-	-	-2,050,683.56	120,653,123.93

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（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	-14,141.84	-6,296.11
	市场利率下降 25 个基点	14,151.22	6,297.26

#### 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。

本基金主要投资于固定收益类品种，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本基金资产净值无重大影响。

#### 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无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为人民币 50,087,000.00 元，无属于第三层次的余额（上年度末：无属于第一层次的余额，第二层次人民币 70,045,000.00 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未发生转换（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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	50,087,000.00	82.33
	其中：债券	50,087,000.00	82.33
	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	8,000,212.00	13.15
	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	1,313,772.99	2.16
8	其他各项资产	1,438,097.79	2.36

9	合计	60,839,082.78	100.00
---	----	---------------	--------

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

无。

## 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

无。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

无。

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

无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 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	9,975,000.00	16.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,112,000.00	66.08
	其中：政策性金融债	40,112,000.00	66.08
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	50,087,000.00	82.52

## 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	170310	17 进出 10	300,000	30,066,000.00	49.53
2	170209	17 国开 09	100,000	10,046,000.00	16.55
3	209918	20 贴现国债 18	100,000	9,975,000.00	16.43

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 支债券。

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

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
无。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明  
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

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。

### 7.12.2

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,438,097.79
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,438,097.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

## 7.12.5 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 (%)
嘉实汇鑫中短债债券 A	197	304,618.25	59,999,000.00	99.98	10,795.20	0.02
嘉实汇鑫中短债债券 C	2	2,731.32	-	-	5,462.64	100.00
合计	199	301,584.21	59,999,000.00	99.97	16,257.84	0.03

注：(1) 嘉实汇鑫中短债债券 A：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汇鑫中短债债券 A 份额占嘉实汇鑫中短债债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实汇鑫中短债债券 A 份额占嘉实汇鑫中短债债券 A 总份额比例；

(2) 嘉实汇鑫中短债债券 C：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汇鑫中短债债券 C 份额占嘉实汇鑫中短债债券 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实汇鑫中短债债券 C 份额占嘉实汇鑫中短债债券 C 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	嘉实汇鑫中短债债券 A	159.00	0.00
	嘉实汇鑫中短债债券 C	-	-
	合计	159.00	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	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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实汇鑫中短债债券 A	0
	嘉实汇鑫中短债债券 C	0

	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实汇鑫中短债债券 A	0
	嘉实汇鑫中短债债券 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实汇鑫中短债债券 A	嘉实汇鑫中短债债券 C
基金合同生效日（2019 年 9 月 26 日）基金份额总额	256,005,194.18	3,101.03
本报告期期初基金份额总额	120,013,487.74	5,497.01
本报告期基金总申购份额	1,800.34	22,836.68
减：本报告期基金总赎回份额	60,005,492.88	22,871.05
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	60,009,795.20	5,462.64

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

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**

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	
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-



光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
西藏东方财 富证券股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范, 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	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

## § 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	2020/01/01 至 2020/06/30	59,999,000.00	-	-	59,999,000.00	99.97
	2	2020/01/01 至 2020/06/17	59,999,000.00	-	59,999,000.00	-	-
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) 中国证监会准予嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金注册的批复文件。

(2) 《嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金基金合同》;

- (3) 《嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实汇鑫中短债债券型证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实汇鑫中短债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 E-mail: [service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2020 年 08 月 29 日