# 嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金 2019年半年度报告摘要

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
送出日期:2019年08月29日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至2019年6月30日止。

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金 |
| 基金简称 | 嘉实稳鑫纯债债券 |
| 基金主代码 | 002991 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016年7月15日 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,510,772,186.62份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金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,以获取较高的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 按税后计算的中国人民银行公布的一年期银行定期存款收益率+1.2% |
| 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 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 胡勇钦 | 李修滨 |
| | 联系电话 | (010)65215588 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | service@jsfund.cn | lixiubin@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 400-600-8800 | 95558 |
| 传真 | | (010)65215588 | 010-85230024 |

2.4 信息披露方式

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年01月01日-2019年06月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 32,055,984.41 |
| 本期利润 | 31,667,439.95 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0210 |
| 本期加权平均净值利润率 | 2.06% |
| 本期基金份额净值增长率 | 2.09% |
| 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 | 38,496,999.29 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0255 |
| 期末基金资产净值 | 1,549,269,185.91 |
| 期末基金份额净值 | 1.0255 |
| 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 | 7.48% |

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。

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 | 0.47% | 0.02% | 0.22% | 0.01% | 0.25% | 0.01% |
| 过去三个月 | 0.75% | 0.03% | 0.68% | 0.01% | 0.07% | 0.02% |
| 过去六个月 | 2.09% | 0.04% | 1.35% | 0.01% | 0.74% | 0.03% |
| 过去一年 | 5.28% | 0.04% | 2.74% | 0.01% | 2.54% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.48% | 0.07% | 8.32% | 0.01% | -0.84% | 0.06% |

注:本基金业绩比较基准为:按税后计算的中国人民银行公布的一年期银行定期存款收益率+1.2%

上述“一年期银行定期存款收益率”是指中国人民银行公布并执行的金融机构一年期人民币存款基准利率。

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:

Benchmark(0)=1000

Return (t)=100% ×(按税后计算的中国人民银行公布的一年期银行定期存款收益率+1.2%)/365

Benchmark(t)=(1+Return (t))×Benchmark (t-1)

其中t=1,2,3,…。

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

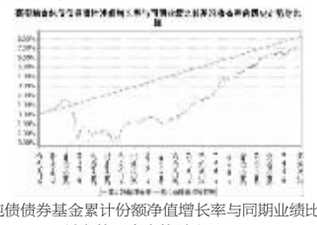

图:嘉实稳鑫纯债债券基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2016年7月15日至2019年6月30日)

注:按基金合同和招募说明书的约定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项投资比例符合基金合同(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,在深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2019年6月30日,基金管理人共管理1只封闭式证券投资基金、154只开放式证券投资基金,具体包括嘉实元和、嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票(QDII)混合、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数(QDII)、嘉实主题新动力混合、嘉实多利分级债券、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实理财宝7天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝A/B、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合(LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和混合、嘉实新添华定期混合、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实合润双债两年期定期债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老2040混合(FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债1-3政金债指数、嘉实养老2050混合(FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理(助理)期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 崔思维 | 本基金、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳泽纯债债券、嘉实稳荣债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实中债1-3政金债指数基金经理 | 2017年7月6日 | - | 7年 | 2011年7月加入嘉实基金管理有限公司,曾任产品管理部产品经理,现任职于固定收益业务体系全回报策略组。 |
| 曲扬 | 本基金、嘉实债券、嘉实稳固收益债券、嘉实纯债债券、嘉实中证中期企业债指数(LOF)、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、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳祥纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新思路混合、嘉实安益混合、嘉实稳泽纯债债券、嘉实策略优选混合、嘉实新添瑞混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳照纯债债券、嘉实稳怡债券、嘉实新添辉定期混合基金经理 | 2016年7月15日 | - | 14年 | 曾任中信基金任债券研究员和债券交易员、光大银行债券自营投资业务副主管,2010年6月加入嘉实基金管理有限公司任基金经理助理,现任职于固定收益业务体系全回报策略组。硕士研究生,具有基金从业资格,中国国籍。 |

注:(1)基金经理曲扬的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理崔思维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遵规守信情况的说明

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、《嘉实稳鑫纯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

上半年宏观流动性总体有所改善,杠杆率回升,基本面预期改善。一季度广义流动性宽松,实体经济预期边际改善。地产方面,一二线城市地产销量回升,活跃度明显改善;消费虽仍在下滑,但减税降费可能使消费早于GDP触底;随着地方债提前发行,基建仍在延续2018年4季度的向上修复。通胀方面,2月下旬开始生猪价格大幅反弹,春节提前使得工业品价格整体较去年水平抬升,国际油价有所反弹,通胀中枢较去年年末预期有所抬升。中美方面,谈判也偏向积极,市场风险偏好回升。

但由于一季度的流动性宽松很大程度上推高了短期的通胀,并再度点燃了地产开发商拿地以及居民购房的热情,在房住不炒的大背景下,二季度整体流动性边际有所回收。5月初中美谈判突然逆转,形势出现恶化,美国对中国2000亿出口产品关税从10%提升至25%,并宣布将对另外3000亿举行听证。5月下旬央行宣布包商银行被接管,金融机构信用光环打破,导致整个6月银行间资金面出现大幅分化,中小机构、非银、产品户、低等级信用债融资能力显著恶化。尽管整体半年末银行间流动性保持宽松,但部分中低等级及民企信用债出现分化情况。

总体来看,上半年政策保持相对节制的逆周期调控,经济增长下行压力有所加大,但是政策在改革和增长之间寻找新的平衡点,一方面通过相对积极的政策提振制造业、民营企业和小微企业信心,另一方面守住底线,坚持房住不炒、控制隐性债务、推动金融供给侧改革。利率水平总体震荡,年初的流动性宽松带来了信用利差的压缩,但改革过程中,仍有部分弱资质主体不可避免地出现违约和信用利差的走扩。权益市场也随宏观流动性及风险偏好波动,1-4月总体表现较好,但中美冲突之后消费等“核心资产”与市场指数整体表现分化。

报告期内本基金始终以力争获取绝对回报为前提,坚持稳健投资原则,持仓以中高等级信用债为主,根据市场情况变化适时调整组合的久期和杠杆水平,力争在风险与收益之间取得平衡。

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1.0255元;本报告期基金份额净值增长率为2.09%,业绩比较基准收益率为1.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年来看,基本面来大概率继续筑底,近期平台隐性债务再提置换,部分银行出台隐性债务化解办法,但另一方面地产融资政策再度收紧,从地产ABS、房地产信托、再到海外地产债发行。城投和地产形成有保有压的模式,未来经济下行压力依然较大,政府坚持房住不炒的态度也较为坚决,因此市场仍面临继续出清。

通胀方面,M1同比仍处在低位显示经济活力尚未恢复,基础货币增速为历史最低水平,核心CPI同比降至2017年来新低,均显示未来内生性通胀压力有限;黑色涨价源于铁矿石供给收缩、环保限产和钢铁行业供给侧改革,总体工业品跌价由于需求持续放缓。在CPI和PPI均呈现走高之后,三季度特别7-8月随着翘尾因素转负,物价或将明显回落。四季度或重新回升,但目前来看,较难超过3%这个关口。

政策和流动性方面,由于基本面走弱和贸易摩擦很可能长期化,财政和货币政策都将有所松动以应对;其中,财政政策发力空间相对较大,见效较快;而在金融周期下行期,货币政策(尤其是信用政策)的进一步宽松短期内仍受房地产和杠杆率的掣肘,另外,在金融严监管约束下,宽货币向宽信用的传导有较大制约。包商银行受到接管是一个开始,短期内央行将会呵护市场流动性以维护市场平稳;中长期而言,由于银行同业存单和存款的刚性兑付被打破,其对信用定价分层将会带来深远影响。

对于债券市场总体而言,我们认为三季度随着名义增长的下行,利率有阶段性下行筑底的可能。而一些对冲性的宽信用政策可能伴随三季度后期和四季度名义价格的企稳而逐渐产生效果,风险偏好也有望提振。7月重点关注政治局会议对未来政策的定调,我们认为大概率维持相对节制的宽信用政策,延续不搞大水漫灌的政策思路。长期来看,潜在增长压力在未来几年压力降逐渐增大,制约逆周期刺激力度,也倒逼投资拉动的经济体被迫转型,过去10年资本形成效率下降、债券收益率中枢相对名义增长居高不下的状态会发生一些变化。

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历。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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《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,对嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金2019年上半年的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司在嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的2019年半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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:嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金
报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 1,647,626.52 | 289,141.14 |
| 结算备付金 | | 12,345,462.31 | 15,389,630.27 |
| 存出保证金 | | 54,453.17 | 73,909.30 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 1,913,636,212.00 | 1,867,994,629.20 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 1,913,636,212.00 | 1,867,994,629.20 |
| 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 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 35,856,049.72 | 30,901,217.43 |
| 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 | | 1,963,539,803.72 | 1,914,648,527.34 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019年6月30日 | 上年度末 2018年12月31日 |
| 负债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 412,058,127.41 | 395,500,000.00 |
| 应付证券清算款 | | 1,163,356.41 | 38,655.00 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 380,922.15 | 393,975.95 |
| 应付托管费 | | 152,368.89 | 157,590.37 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 13,953.67 | 9,260.51 |
| 应交税费 | | 129,170.16 | 154,176.91 |
| 应付利息 | | 269,228.28 | 443,228.62 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 103,490.84 | 390,000.00 |
| 负债合计 | | 414,270,617.81 | 397,086,887.36 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,510,772,186.62 | 1,510,732,395.27 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 38,496,999.29 | 6,829,244.71 |
| 所有者权益合计 | | 1,549,269,185.91 | 1,517,561,639.98 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,963,539,803.72 | 1,914,648,527.34 |

注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0255元,基金份额总额1,510,772,186.62份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 41,195,693.11 | 51,462,360.15 |
| 1.利息收入 | | 38,886,562.54 | 36,933,337.09 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 138,004.65 | 32,732.42 |
| 债券利息收入 | | 38,748,557.89 | 36,817,290.10 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 83,314.57 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以“-”填列) | | 2,697,633.48 | -5,052,320.04 |
| 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 | 2,697,633.48 | -5,052,320.04 |
| 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 | -388,544.46 | 19,581,332.88 |
| 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 | 41.55 | 10.22 |
| 减:二、费用 | | 9,528,253.16 | 7,828,717.91 |
| 1. 管理人报酬 | | 2,284,246.23 | 2,264,345.63 |
| 2. 托管费 | | 913,698.54 | 905,738.25 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.18 | 13,905.61 | 17,879.19 |
| 5. 利息支出 | | 6,096,479.54 | 4,325,672.46 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 6,096,479.54 | 4,325,672.46 |
| 6. 税金及附加 | | 86,429.84 | 94,064.58 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.19 | 133,493.40 | 221,017.80 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 31,667,439.95 | 43,633,642.24 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 31,667,439.95 | 43,633,642.24 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:嘉实稳鑫纯债债券型证券投资基金
本报告期:2019年1月1日 至 2019年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 1,510,732,395.27 | 6,829,244.71 | 1,517,561,639.98 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 31,667,439.95 | 31,667,439.95 |
| 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) | 39,791.35 | 314.63 | 40,105.98 |
| 其中:1.基金申购款 | 110,114.28 | 1,416.44 | 111,530.72 |
| 2.基金赎回款 | -70,322.93 | -1,101.81 | -71,424.74 |
| 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) | 1,510,772,186.62 | 38,496,999.29 | 1,549,269,185.91 |
| 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) | 1,510,761,478.19 | -12,022,067.90 | 1,498,739,410.29 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 43,633,642.24 | 43,633,642.24 |
| 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) | -58,244.05 | -884.73 | -59,128.78 |
| 其中:1.基金申购款 | 12,056.87 | 191.15 | 12,248.02 |
| 2.基金赎回款 | -70,300.92 | -1,075.88 | -71,376.80 |
| 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) | 1,510,703,234.14 | 31,610,689.61 | 1,542,313,923.75 |

报表附注为财务报表的组成部分。

| 本报告6.1 | 至6.4财务报表由下列负责人签署: | |
|---|---|---|
| 经雷 | 王红 | 张公允 |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.3 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

6.4.4.2 关联方报酬

6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,284,246.23 | 2,264,345.63 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | - | - |

注:支付基金管理人嘉实基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.3%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×0.3%/当年天数。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 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 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 913,698.54 | 905,738.25 |

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.12%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×0.12%/当年天数。

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固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),基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

| 关联方名称 | 本期末 2019年6月30日 | | 上年度末 2018年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例(%) |
| 中信银行股份有限公司 | 1,510,594,753.65 | 99.99 | 1,510,594,753.65 | 99.99 |

6.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

| 关联方名称 | 本期 2019年1月1日 至 2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日 至 2018年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信银行股份有限公司_活期 | 1,647,626.52 | 6,446.51 | 606,279.99 | 14,079.55 |

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按适用利率计息。

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.5 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末(2019年6月30日),本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额235,058,127.41元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量(张) | 期末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|
| 011802071 | 18桂铁投SCP002 | 2019年7月1日 | 100.60 | 290,000 | 29,174,000.00 |
| 101456068 | 14青国信MTN001 | 2019年7月1日 | 101.39 | 200,000 | 20,278,000.00 |
| 101562033 | 15宁河西MTN001 | 2019年7月1日 | 102.02 | 300,000 | 30,606,000.00 |
| 101572004 | 15海宁城投MTN001 | 2019年7月1日 | 101.79 | 300,000 | 30,537,000.00 |
| 101651007 | 16陕延油MTN001 | 2019年7月1日 | 100.25 | 269,000 | 26,967,250.00 |
| 101656037 | 16首农MTN001 | 2019年7月1日 | 100.53 | 100,000 | 10,053,000.00 |
| 101658004 | 16陕高速MTN001 | 2019年7月1日 | 100.66 | 200,000 | 20,132,000.00 |
| 101660031 | 16南宁城投MTN001 | 2019年7月1日 | 100.10 | 347,000 | 34,734,700.00 |
| 101664062 | 16中铝业MTN003 | 2019年7月1日 | 100.78 | 100,000 | 10,078,000.00 |
| 101754013 | 17河钢集MTN001 | 2019年7月1日 | 101.31 | 127,000 | 12,866,370.00 |
| 101809960 | 18贵州高速MTN001 | 2019年7月1日 | 102.58 | 100,000 | 10,258,000.00 |
| 101801444 | 18京热力MTN001 | 2019年7月1日 | 100.80 | 89,000 | 8,971,200.00 |
| 合计 | | | | 2,422,000 | 244,655,520.00 |

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年6月30日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额177,000,000.00元,于2019年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

## §7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中:股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 1,913,636,212.00 | 97.46 |
| | 其中:债券 | 1,913,636,212.00 | 97.46 |
| | 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 | 13,993,088.83 |