嘉实中短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:招商银行股份有限公司
送出日期:2019年08月29日

§1 重要提示

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

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

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

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

本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24日(基金合同生效日)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	嘉实中短债债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实中短债债券	
基金主代码	006797	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年1月24日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	321,145,063.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实中短债债券A	嘉实中短债债券C
下属分级基金的交易代码	006797	006798
报告期末下属分级基金的份额总额	250,097,716.10份	71,047,347.38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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	张燕
	联系电话	(010)65215588	(0755)83199084
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555
传真		(010)65215588	(0755)83195201

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24日(基金合同生效日)-2019年06月30日)	
	嘉实中短债债券A	嘉实中短债债券C
本期已实现收益	2,512,292.70	655,973.73
本期利润	3,542,521.37	924,224.33
加权平均基金份额本期利润	0.0097	0.0057
本期加权平均净值利润率	0.96%	0.56%
本期基金份额净值增长率	1.11%	0.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	1,906,139.05	433,564.14
期末可供分配基金份额利润	0.0076	0.0061
期末基金资产净值	252,870,224.06	71,727,020.21
期末基金份额净值	1.0111	1.0096
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	1.11%	0.96%

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)嘉实中短债债券A收取认(申)购费用和赎回费,嘉实中短债债券C从本类基金资产中计提销售服务费,不收取认(申)购费用但收取赎回费;(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。(5)本基金合同生效日为2019年1月24日,本报告期自2019年1月24日起至2019年6月30日止。

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	0.46%	0.02%	0.32%	0.02%	0.14%	0.00%
过去三个月	0.87%	0.03%	0.54%	0.03%	0.33%	0.00%
自基金合同生效起至今	1.11%	0.03%	1.04%	0.02%	0.07%	0.01%

嘉实中短债债券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	0.43%	0.03%	0.32%	0.02%	0.11%	0.01%
过去三个月	0.79%	0.03%	0.54%	0.03%	0.25%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.96%	0.03%	1.04%	0.02%	-0.08%	0.01%

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:

Benchmark(0)=1000

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

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

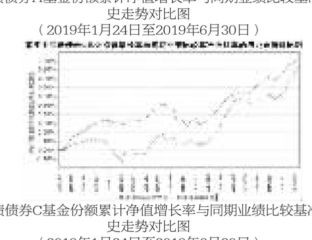

图1:嘉实中短债债券A基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年1月24日至2019年6月30日)

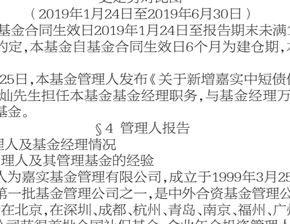

图2:嘉实中短债债券C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2019年1月24日至2019年6月30日)

注:1.本基金基金合同生效日2019年1月24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,本报告期处于建仓期内。

2.2019年1月25日,本基金管理人发布《关于新增嘉实中短债债券基金经理的公告》,增聘李金灿先生担任本基金基金经理职务,与基金经理万晓西先生、李曈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、嘉实新消费股票、嘉实低价策略股票、嘉实快线货币、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		
李金灿	本基金、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、理财宝7天债券、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实1个月理财债券、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券基金经理	2019年1月25日	-	9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。
李曈	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实安心货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实快线货币、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实现金添利货币基金经理	2019年1月24日	-	9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。
万晓西	本基金、嘉实货币、嘉实宝、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实薪金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快线货币、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券基金经理	2019年1月24日	-	18年	曾任职于中国农业银行黑龙江省分行及深圳发展银行的国际业务部,南方基金固定收益部总监助理、首席宏观研究员、南方现金增利基金经理,第一创业证券资产管理总部固定收益总监、执行总经理,民生证券资产管理事业部总裁助理兼投资研究部总经理,2013年2月加入嘉实基金管理有限公司,现任固定收益业务体系短端alpha策略组组长,中国国籍。

注:(1)基金经理万晓西、李曈的任职日期是指本基金基金合同生效之日,基金经理李金灿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

今年以来,国内经济面临较大下行压力,以及中美贸易谈判的不确定性有所增加,在这样的背景下央行进行了全面降准、定向中期借贷便利(TMLF)和普惠金融定向降准,流动性总体合理充裕。随后政策托底和地产边际放松的提振效果有所显现,经济小幅回升,流动性边际上收紧。然后地产调控再次收紧,企业融资在年初提前放贷和政策集中发力提振后再次疲弱,同时中美贸易摩擦由持续好转突然升级加剧,经济下行压力再次显现,于是5月份央行及时进行了定向降准,超额续作了MLF,并大量投放逆回购,流动性再次回归合理充裕。5月底,包商银行突然被监管机构接管,释放出监管层有意打破银行"刚兑"信号,短期对市场信心有所影响,引发交易对手和质押券的重新梳理,以及信用风险偏好的回收,流动性分层现象较为突出。此前,1年期AAA国股存单和城商行存单利差在10bps左右;包商事件后,1年期AAA国股存单、AAA城商行存单、AA+存单发行利率利差明显走阔至20、30bps。央行而后连续三周进行了大量流动性投放,至6月中旬监管部门通过召开座谈会、对锦州银行存单发行进行增信、及时公告处置进度等措施对市场情绪予以平稳,流动性供需基本平衡。

年初以来,资金面总体合理充裕,局部时间边际走紧,松紧程度的波动较大截至6月30日,由于全面降准、定向降准,以及财政支出力度增大等措施释放较多增量资金,央行公开市场操作净回笼10451亿元(含国库现金定存)。其中,逆回购到期40550亿元,投放37750亿元;MLF到期24100亿元,投放11400亿元;TMLF投放5249亿元。年初全面降准和普惠金融定向降准释放增量资金约5400亿元,5月定向降准释放增量资金约2800亿元。

2019年以来货币市场中枢有所下行,半年末银行间隔夜、7天、1个月和3个月回购加权利率较去年末分别-98bps、-47bps、-11bps和-27bps至1.58%、2.66%、3.41%、3.58%;短端资产价格也有一定幅度下行:3个月、6个月和1年期AAA存单收益率较去年末分别-48bps、-32bps、-30bps至2.49%、2.93%和3.03%。1年期国债较去年末上行4bps至2.64%;1年期国开债较去年末持平下行3bps至2.72%。

2019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,2019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中短债债券A基金份额净值为1.0111元,本报告期基金份额净值增长率为1.11%;截至本报告期末嘉实中短债债券C基金份额净值为1.0096元,本报告期基金份额净值增长率为0.96%;业绩比较基准收益率为1.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

向后看三季度基本面和政策面对债券市场比较友好。基本面来看,地产投资高位回落、出口消费乏力,基建和社融增速短期内难以快速回升,通胀上行压力也逐步减弱。在此背景下货币政策从宽货币向紧货币的转变将会有所延迟,经济基本面和政策面共同对债券市场形成支撑。但同时三季度债券供给较大,且贸易谈判不确定性一直存在,可能对市场形成一定冲击。四季度基本面可能逐步趋于平稳,政策可能在边际上有所调整。货币政策逐步减少短期操作,预计考量续作MLF的降准搭配以LPR为贷款报价利率机制降息操作。宽信用的前提是宽货币,故降准旨在维稳资金面,亦不会"大水漫灌";降息旨在进一步降低小微企业融资实际利率。央行货币政策委员会2019年二季度例提出"在推动高质量发展中防范化解风险,把握好处置风险的力度和节奏,稳定市场预期"。

包商银行接管事件将会对银行业结构产生深远影响,低等级中小银行同业负债利率中将包含合理的信用利差,其继续通过同业负债去参与其他投资,以此来增加杠杆、增加盈利的行为将逐步缩减,中小银行的同业业务占比也会下降。包商事件后产生流动性分层及杠杆投资模式的变迁,同业存单刚兑的打破督促市场普遍加强交易对手和质押券的风险管理,非银机构赖以生存的加杠杆套利模式会被迫进行调整,双重影响下将直接影响中低评级个券的投资和估值。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度,我行在履行托管职责中,严格遵守有关法律法规、托管协议的规定,尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款,对托管产品的投资行为进行监督,并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则,独立地设置、登录和保管本产品的全套账册,进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本半年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:嘉实中短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
资产:		
银行存款	6.4.7.1	1,438,394.87
结算备付金		199,639.57
存出保证金		507,715.20
交易性金融资产	6.4.7.2	442,752,200.00
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		442,752,200.00
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	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	4,548,170.89
应收股利		-
应收申购款		440,967.07
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		449,887,087.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年6月30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		124,059,437.96
应付证券清算款		928,678.75
应付赎回款		-
应付管理人报酬		88,597.63
应付托管费		29,532.54
应付销售服务费		22,186.33
应付交易费用	6.4.7.7	34,283.46
应交税费		37,553.63
应付利息		57,233.59
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	32,339.44
负债合计		125,289,843.33
所有者权益:		
实收基金	6.4.7.9	321,145,063.48
未分配利润	6.4.7.10	3,452,180.79
所有者权益合计		324,597,244.27
负债和所有者权益总计		449,887,087.60

注:本基金合同生效日为2019年1月24日,本报告期自基金合同生效日2019年1月24日起至2019年6月30日止。报告截止日2019年6月30日,嘉实中短债债券A基金份额净值1.0111元,基金份额总额250,097,716.10份;嘉实中短债债券C基金份额净值1.0096元,基金份额总额71,047,347.38份。基金份额总额合计为321,145,063.48份。

6.2 利润表

会计主体:嘉实中短债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
一、收入		6,481,683.28
1.利息收入		9,198,964.29
其中:存款利息收入	6.4.7.11	1,157,864.57
债券利息收入		7,323,273.57
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		717,826.15
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-4,017,008.28
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	-4,054,188.86
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	37,180.58
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	1,298,479.27
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	1,248.00
减:二、费用		2,014,937.58
1. 管理人报酬		687,308.11
2. 托管费		229,102.65
3. 销售服务费		246,935.43
4. 交易费用	6.4.7.18	32,216.03
5. 利息支出		751,091.55
其中:卖出回购金融资产支出		751,091.55
6. 税金及附加		17,640.42
7. 其他费用	6.4.7.19	50,643.39
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		4,466,745.70
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		4,466,745.70

注:本基金合同生效日为2019年1月24日,本期是指2019年1月24日至2019年6月30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:嘉实中短债债券型证券投资基金

本报告期:2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月24日(基金合同生效日)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)	634,083,856.77	-	634,083,856.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,466,745.70	4,466,745.70
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)	-312,938,793.29	-1,014,564.91	-313,953,358.20
其中:1. 基金申购款	11,075,431.48	69,966.74	11,145,398.22
2.基金赎回款	-324,014,224.77	-1,084,531.65	-325,098,756.42
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)	321,145,063.48	3,452,180.79	324,597,244.27

注:本基金合同生效日为2019年1月24日,本期是指2019年1月24日至2019年6月30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	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 基金基本情况

嘉实中短债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[2018]2053号《关于准予嘉实中短债债券型证券投资基金注册的批复》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》和《嘉实中短债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,嘉实中短债债券A类份额首次募集的有效净认购金额为人民币410,917,765.62元,嘉实中短债债券C类份额首次募集的有效净认购金额为人民币223,101,658.17元,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_A01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《嘉实中短债债券型证券投资基金基金合同》于2019年1月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为634,083,856.77份基金份额(其中,A类基金份额为410,955,621.53份,C类基金份额为223,128,235.24份),其中认购资金利息折合64,432.98份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《嘉实中短债债券型证券投资基金基金合同》和《嘉实中短债债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。各类别基金份额,分别设置代码,合并投资运作,分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。本基金自募集起,基金份额类别包括A类和C类。A类基金份额,是在投资者认购或申购时收取认购费或申购费,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;C类基金份额,是在投资者认购或申购时不收取认购费或申购费、但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实中短债债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,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。基金的投资组合比例为:本基金对债券资产的投资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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产(或负债),并形成其他单位的金融负债(或资产)或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项;

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等;

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等,以及不作为有效套期工具的衍生工具,按照取得时的公允价值作为初始确认金额,相关的交易费用在发生时计入当期损益;

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利,应当确认为当期收益。每日,本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益;

处置该金融资产或金融负债时,其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益,同时调整公允价值变动收益;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,该金融负债或其一部分将终止确认;

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债;

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下:

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益,卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

本基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债,根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值,确定所属的公允价值层次:第一层次输入值,在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;第二层次输入值,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;第三层次输入值,相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2)不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4)如有新增事项,按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在"损益平准金"科目中核算,并于期末全额转入"未分配利润/(累计亏损)"。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额,扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入,按买入返售金融资产的成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率),在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(8)股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(9)公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方,经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下,本基金可以进行收益分配,本基金每年收益分配次数最多为12次,每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的20%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

(2)本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(3)基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(4)同一类别内每一基金份额享有同等分配权;由于本基金各基金份额类别收取费用情况不同,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同;

(5)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

(6)经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 关联方关系

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
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人、基金代销机构

6.4.7 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。

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本期(2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日),本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	687,308.11
其中:支付销售机构的客户维护费	330,153.99

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0.30%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。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	229,102.65

注:支付基金托管人招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。

6.4.7.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实中短债债券A	嘉实中短债债券C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	519.59	519.59
招商银行	-	239,436.33	239,436.33
合计	-	239,955.92	239,955.92

注:(1)本基金C类份额销售服务费年费率为0.35%,每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日C类基金份额销售服务费=前一日C类基金份额资产净值×0.35%/当年天数。(2)本基金A类基金份额不收取销售服务费。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行	-	-	-	-	147,500,000.00	5,325.12

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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24日(基金合同生效日)至2019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。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末(2019年6月30日),其他关联方未持有本基金。

6.4.7.5 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24日(基金合同生效日)至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司_活期	1,438,394.87	131,867.06

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按适用利率计息。

6.4.7.6 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24日(基金合同生效日)至2019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。

6.4.8 期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 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124,059,437.96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
011802358	18首钢SCP012	2019年7月1日	100.56	300,000	30,168,000.00
101800696	18闽投MTN002	2019年7月1日	102.42	200,000	20,484,000.00
101801058	18京能源MTN002	2019年7月1日	102.00	200,000	20,400,000.00
101900593	19华润MTN004	2019年7月1日	100.76	99,000	9,975,240.00
111909158	19浦发银行CD158	2019年7月1日	96.98	200,000	19,396,000.00
111997611	19南京银行CD035	2019年7月1日	96.93	31,000	3,004,830.00
190205	19国开05	2019年7月1日	97.95	57,000	5,583,150.00
199917	19贴现国债17	2019年7月1日	99.47	100,000	9,947,000.00
199920	19贴现国债20	2019年7月1日	99.46	100,000	9,946,000.00
合计				1,287,000	128,904,220.00

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本期末(2019年6月30日),本基金无交易所市场债券正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	442,752,200.00	98.41
	其中:债券	442,752,200.00	98.41
	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	1,638,034.44	0.36
8	其他各项资产	5,496,853.16	1.22
9	合计	449,887,087.60	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

报告期末,本基金未持有股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

报告期末,本基金未持有股票。

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

报告期内(2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日),本基金未持有股票。

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

报告期内(2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日),本基金未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

报告期内(2019年1月24日(基金合同生效日)至2019年6月30日),本基金未持有股票。

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	21,726,200.00	6.69
2	央行票据	-	-
3	金融债券	29,526,000.00	9.10
	其中:政策性金融债	29,526,000.00	9.10
4	企业债券	20,530,000.00	6.32
5	企业短期融资券	130,439,000.00	40.18
6	中期票据	192,056,000.00	59.17
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	48,475,000.00	14.93
9	其他	-	-
10	合计	442,752,200.00	136.40

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	011802358	18首钢SCP012	300,000	30,168,000.00	9.29
2	101900047	19苏国资MTN001	300,000	30,090,000.00	9.27
3	111997611	19南京银行CD035	300,000	29,079,000.00	8.96
4	112697	18苏宁02	200,000	20,530,000.00	6.32
5	101800696	18闽投MTN002	200,000	20,484,000.00	6.31

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末,本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

报告期末,本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期内,本基金未参与股指期货交易。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本期国债期货操作主要通过国开债与国债期货配合交易,另外在市场波动的情形下,通过国债期货的套保把握了波段机会。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
T1909	T1909	26	25,348,700.00	62,000.00	-
公允价值变动总额合计(元)					62,000.00
国债期货投资本期收益(元)					37,180.58
国债期货投资本期公允价值变动(元)					62,000.00

7.11.3 本期国债期货投资评价

整体操作上相对谨慎,对组合的收益以及波动性方面都有明显的提升作用,后期仍将努力把握确定性较大的机会,合理分配各个策略之间的仓位占比,力争提升组合收益的同时,将回撤保持在可控范围内。

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	507,715.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,548,170.89
5	应收申购款	440,967.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,496,853.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末,本基金未持有股票。

§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(%)
嘉实中短债债券A	1,572	159,095.24	-	-	250,097,716.10	100.00
嘉实中短债债券C	412	172,445.02	-	-	71,047,347.38	100.00
合计	1,969	163,100.59	-	-	321,145,063.48	100.00

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

(2)嘉实中短债债券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中短债债券C份额占嘉实中短债债券C总份额比例、个人投资者持有嘉实中短债债券C份额占嘉实中短债债券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	嘉实中短债债券A	30,615.42	0.01
	嘉实中短债债券C	10,000.45	0.01
	合计	40,615.87	0.01

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

§9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	嘉实中短债债券A	嘉实中短债债券C
基金合同生效日(2019年1月24日)基金份额总额	410,955,621.53	223,128,235.24
本报告期基金总申购份额	3,438,442.57	7,636,988.91
减:本报告期基金总赎回份额	164,296,348.00	159,717,876.77
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	250,097,716.10	71,047,347.38

注:报告期期间基金总申购份额含转换入份额,基金总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1)基金管理人的重大人事变动情况

2019年1月25日本基金管理人发布《关于新增嘉实中短债债券基金经理的公告告》,聘请李金灿先生担任本基金基金经理职务,与万晓西先生、李曈先生共同管理本基金。

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

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

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

(2)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内,基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、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

报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),为本基金的审计机构。

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	
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	41,953,490.00	67.24%	320,000,000.00	100.00%	-	-
中信证券股份有限公司	20,437,600.00	32.76%	-	-	-	-

投资者对本报告如有疑问,可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司,咨询电话400-600-8800,或发电子邮件,E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司
2019年08月29日