嘉实稳泽纯债债券型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实稳泽纯债债券
基金主代码	003056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年9月13日
报告期末基金份额总额	799,954,685.47份
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、预期收益和期期风险特征,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彩票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	中债总全价指数收益率
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。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	8,802,680.30
2.本期利润	4,541,920.30
3.加权平均基金份额本期利润	0.0057
4.期末基金资产净值	822,460,881.20
5.期末基金份额净值	1.0281

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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
过去三个月	0.55%	0.03%	-0.53%	0.11%	1.08%	-0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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:嘉实稳泽纯债债券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
(2016年9月13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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、嘉实稳鑫纯债债券、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、嘉实中证企边中期国债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、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实稳荣纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实新思路混合、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实新添瑞混合、嘉实稳元纯债债券、嘉实稳熙纯债债券、嘉实稳怡债券、嘉实新添辉定期混合基金经理	2016年9月13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、《嘉实稳泽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 公平交易专项说明

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3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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度经济基本面下行压力有所加大。一季度信贷投放增长较快,宏观经济预期改善,但同时宏观杠杆率再度攀升引发关注,货币政策以及地产融资政策均边际收紧,4月下旬政治局会议也重提房住不炒的基调,显示尽管经济下行过程中宽信用是政策方向,但控制宏观杠杆率、控制隐性债务依然是本轮调控的制约。5月初中美贸易谈判突然逆转,形势出现恶化,美国对中国2000亿出口产品关税税率从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,引发金融机构同业业务调整, 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。在此期间,通胀预期提升,猪肉、水果价格轮番上涨,二季度前期原油价格反弹也带动PPI预期回升,在经济下行叠加通胀上行的基本面环境下,滞涨担忧上升。

二季度债券市场先跌后涨,4月在通胀、货币边际收紧的影响下,收益率快速反弹,但随着5月谈判不确定性上升、以及基本面下行压力有所加大,收益率回落。5月下旬包商事件对市场产生短期冲击,品种分化明显,利率债、高等级信用债以及交易所可质押信用债收到市场追捧,而低等级信用债、中低等级存单收益率略有上行。

报告期内本基金持仓以利率债和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水平,整体保持较高的杠杆水平。力争在风险与收益之间取得平衡。

4.5 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1.0281元;本报告期基金份额净值增长率为0.55%,业绩比较基准收益率为-0.53%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	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	1,015,654,900.00	97.85
	其中:债券	1,015,654,900.00	97.85
	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	450,820.53	0.04
8	其他资产	21,915,827.85	2.11
9	合计	1,038,021,548.38	100.00

5.2 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。

5.3 报告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。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	919,032,900.00	111.74
	其中:政策性金融债	677,923,000.00	82.43
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	96,622,000.00	11.75
9	其他	-	-
10	合计	1,015,654,900.00	123.49

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	120412	12农发12	2,000,000	200,140,000.00	24.33
2	180402	18农发02	1,800,000	184,662,000.00	22.45
3	180212	18国开12	1,300,000	131,456,000.00	15.98
4	1820027	18鹿执银行01	780,000	79,341,600.00	9.65
5	1720080	17兰州银行绿色金融01	700,000	71,519,000.00	8.70

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细
报告期末,本基金未持有权证。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期内,本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1
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。

5.11.2
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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	21,915,827.85
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,915,827.85

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	799,954,490.50
报告期期间基金总申购份额	254.46
减:报告期期间基金总赎回份额	59.49
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	799,954,685.47

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
报告期内,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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期内,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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2019/04/01至2019/06/30	799,938,075.46	-	-	799,938,075.46	100.00
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(1) 中国证监会准予嘉实稳泽纯债债券型证券投资基金注册的批复文件;
(2)《嘉实稳泽纯债债券型证券投资基金合同》;
(3)《嘉实稳泽纯债债券型证券投资基金招募说明书》;
(4)《嘉实稳泽纯债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) 报告期内嘉实稳泽纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点
北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

9.3 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
2019年7月17日

嘉实现金添利货币市场基金

2019年第二季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实现金添利货币
基金主代码	004501
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年3月29日
报告期末基金份额总额	98,403,052,293.48份
投资目标	在力求基金资产安全性、流动性的基础上,追求超过业绩比较基准的稳定收益。
投资策略	本基金在严谨深入的研究分析基础上,综合考量资产配置比例,同时根据对市场收益率水平变化趋势的判断,本基金动态调整组合久期,以谋求控制风险,增加或锁定收益。严格控制风险的前提下选择具有较高投资价值的银行存款进行投资,同时积极利用市场机会获得超额收益
业绩比较基准	人民币活期存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金,基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日 - 2019年6月30日)
1.本期已实现收益	561,966,426.85
2.本期利润	561,966,426.85
3.期末基金资产净值	98,403,052,293.48

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等;(2)本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用;(3)本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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
过去三个月	0.6742%	0.0009%	0.0871%	0.0000%	0.5871%	0.0009%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

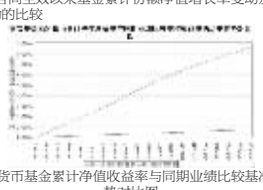

图:嘉实现金添利货币基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年3月29日至2019年6月30日)

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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、嘉实新金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、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基金经理	2017年5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。
李曜	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、嘉实快钱货币、嘉实定期宝6个月理财债券、嘉实中短债债券基金经理	2017年4月13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、嘉实新金宝货币、嘉实3个月理财债券、嘉实快钱货币、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基金经理	2017年3月29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、李曜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、《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》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 公平交易专项说明

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,本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年二季度全球经济的不确定性上升,主要发达经济体的货币政策转向的迹象更加明显。二季度美国经济多个指标已出现高位回落态势,下半年或会进入下行通道,欧洲经济也将延续疲软态势,日本与英国的经济前景亦存在明显压力,部分新兴经济体较去年出现好转迹象。 世界银行发布的新一期《全球经济展望》,预计全球经济增长2019年将放慢至2.6%,2020年略微回升至2.7%。由于出口和投资下滑,发达经济体作为一个整体,预计2019年增速将会放缓,尤其是在欧元区。美国增速今年预计将放缓至2.5%,2020年进一步放慢至1.7%。2020至2021年欧元区增速预计将在1.4%左右徘徊,虽有货币政策持续支持,但贸易和内需疲软拖累了经济增长。新兴市场和发展中经济体2019年增速预计将下滑至4%的四年低点,2020年有望回升至4.6%。一些经济体正在应对金融压力和政局不确定性的影响。随着一些国家度过财政紧张期,预计新兴市场和发展中经济体增长下一年将趋于稳定,但增长势头依然乏力。

2019年二季度国内经济下行压力较大,贸易战不确定性增加,工业、投资和出口等月度指标大部分表现平稳。2019年4月至5月,我国规模以上工业增加值均值同比实际增长5.2%, 比一季度低1.02%;4至5月固定资产投资均值同比增速为5.85%, 比一季度低0.35%;4至5月社会消费品零售总额均值同比增速为7.9%,比一季度低0.55%;4至5月出口金额均值同比增速为-0.8%,低于一季度的0.77%。

2019年二季度在岸人民币汇率贬值2.20%, 离岸人民币汇率贬值2.16%,4-5月央行外汇资产下降20亿元。

进入二季度以来,受一季度金融数据向好、贸易战形势变化和同业业务信用收缩等影响,利率波动频率增强、波动幅度扩大,汇率贬值速度提高。央行二季度货币政策前紧后松,资金利率前高后低,市场利率中枢有所上行,市场流动性整体处于前紧后松态势。

在此期间,我们紧跟央行政策风向和操作节奏,合理应对缴税和节假日等时点因素和人民币汇率阶段性波动,保证流动性安全的同时,把握时点性收益相对高点,积极调整组合,保持了基金的流动性安全和收益平稳增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为0.6742%,业绩比较基准收益率为0.0871%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	51,450,760,731.98	47.91
	其中:债券	50,982,760,731.98	47.48
	资产支持证券	468,000,000.00	0.44
2	买入返售金融资产	4,298,925,628.46	4.00
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	50,933,514,277.72	47.43
4	其他资产	699,716,945.34	0.65
5	合计	107,382,917,583.50	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	13.51	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	8,931,664,454.19	9.08
	其中:买断式回购融资	-	-

注:(1) 报告期内债券回购融资余额为报告期内每日的融资余额的合计数,报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。(2)本基金基金合同第十二部分约定:债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	97
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	91

注:报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过120天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	25.14	9.08
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	22.58	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	14.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	7.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	39.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		108.41	9.08

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过240天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	229,901,601.94	0.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,846,961,170.73	4.93
	其中:政策性金融债	4,846,961,170.73	4.93
4	企业债券	376,573,856.74	0.38
5	企业短期融资券	11,059,498,843.43	11.24
6	中期票据	926,133,498.10	0.94
7	同业存单	33,543,691,761.04	34.09
8	其他	-	-
9	合计	50,982,760,731.98	51.81
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

注:上表中,附息债券的成本包括债券面值和折溢价,贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111909174	19浦发银行CD174	20,000,000	1,988,112,421.79	2.02
2	111918138	19恒丰银行CD138	15,000,000	1,496,525,867.78	1.52
3	111920056	19广发银行CD056	15,000,000	1,496,352,336.80	1.52
4	111909022	19浦发银行CD022	15,000,000	1,485,323,790.89	1.51
5	160215	16国开15	11,000,000	1,100,461,393.68	1.12
6	111903030	19农业银行CD030	10,000,000	998,343,354.83	1.01
7	111909153	19浦发银行CD153	10,000,000	996,386,996.43	1.01
8	111907092	19招商银行CD092	10,000,000	994,257,235.73	1.01
9	111917014	19光大银行CD014	10,000,000	989,186,645.85	1.01
10	111909198	19浦发银行CD198	10,000,000	978,031,416.25	0.99

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0722%
报告期内偏离度的最低值	0.0029%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0337%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到0.25%。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到0.5%。

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	156794	信泽01A2	2,000,000	200,000,000.00	0.20
2	159180	信泽02A1	1,390,000	139,000,000.00	0.14
3	159312	信泽03A1	1,290,000	129,000,000.00	0.13

注:报告期末,本基金仅持有上述3只资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明
本基金采用固定份额净值,基金份额账面净值始终保持为1.00人民币元。
本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益或损失。

5.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明
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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	34,457.64
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	699,024,136.72
4	应收申购款	658,350.98
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	699,716,945.34

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	71,900,885,118.15
报告期期间基金总申购份额	230,210,232,384.30
报告期期间基金总赎回份额	203,708,065,208.97
报告期期末基金份额总额	98,403,052,293.48

注:报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
报告期内,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。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
(1)中国证监会准予嘉实现金添利货币市场基金注册的批复文件;
(2)《嘉实现金添利货币市场基金基金合同》;
(3)《嘉实现金添利货币市场基金托管协议》;
(4)《嘉实现金添利货币市场基金招募说明书》;
(5)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(6)报告期内嘉实现金添利货币市场基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点
北京市建国门北大街8号华润大厦8层嘉实基金管理有限公司

9.3 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
2019年7月17日

嘉实新收益灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:嘉实基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2019年7月17日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2019年7月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自2019年4月1日起至2019年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实新收益混合
基金主代码	000870
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
报告期末基金份额总额	681,477,171.22份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的条件下,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,追求长期稳健的绝对收益。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率