嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:渤海银行股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年04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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2019年01月01日起至2019年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 6
2.1 基金基本情况 6
2.2 基金产品说明 7
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料 8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后) 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 12
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前） 13
3.1 主要会计数据和财务指标 13
3.2 基金净值表现 14
3.3 过去三年基金的利润分配情况 17
§4 管理人报告 17
4.1 基金管理人及基金经理情况 17
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 19
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 19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 21
4.9 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 21
§5 托管人报告 21
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 22
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 22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 22
§6 审计报告(转型后) 22
6.1 审计报告基本信息 22
6.2 审计报告的基本内容 22
§6 审计报告(转型前) 25
6.1 审计报告基本信息 25
6.2 审计报告的基本内容 26
§7 年度财务报表(转型后) 29
7.1 资产负债表 29
7.2 利润表 30
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 32
7.4 报表附注 33
§7 年度财务报表(转型前) 60
7.1 资产负债表 60
7.2 利润表 62
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 64

7.4 报表附注 65
§8 投资组合报告(转型后) 94
8.1 期末基金资产组合情况 94
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 95
8.3 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 96
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 99
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 102
8.6 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 102
8.7 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 102
8.8 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 102
8.9 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 102
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 102
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 103
8.12 投资组合报告附注 103
§8 投资组合报告（转型前） 104
8.1 期末基金资产组合情况 104
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 104
8.3 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 105
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 106
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 109
8.6 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 109
8.7 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 110
8.8 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 110
8.9 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 110
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 110
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 110
8.12 投资组合报告附注 110
§9 基金份额持有人信息(转型后) 111
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 111
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 112
9.3 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 112
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 112
§9 基金份额持有人信息(转型前) 112
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 113
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 113
9.3 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 113
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 113
§10 开放式基金份额变动(转型后) 114
§10 开放式基金份额变动(转型前) 114
§11 重大事件揭示 115
11.1 基金份额持有人大会决议 115
11.2 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 115
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 115
11.4 基金投资策略的改变 115
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 115
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 115
转型后 115
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 115

转型前 117
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 117
11.8 其他重大事件 118
§12 影响投资者决策的其他重要信息 123
12.1 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 123
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 124
§13 备查文件目录 124
13.1 备查文件目录 124
13.2 存放地点 125
13.3 查阅方式 125

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金名称	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉合睿金混合	
基金主代码	005090	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型合同生效日	2019年03月13日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	118,034,182.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
下属分级基金的交易代码	005090	005091
报告期末下属分级基金的份额总额	10,577,091.74份	107,457,090.26份

转型前

基金名称	嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉合睿金混合	
基金主代码	005090	
基金运作方式	契约型开放式(本基金以定期开放方式运作,即采取在封闭期内封闭运作、封闭期与封闭期之间定期开放的运作方式。)	
基金合同生效日	2018年03月21日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,961,277.90份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
下属分级基金的交易代码	005090	005091

报告期末下属分级基金的份额总额	10,452,941.18份	508,336.72份

2.2 基金产品说明

转型后

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将秉持战略和战术资产配置理念，通过稳健管理的多策略投资系统，在控制市场风险、尽量降低净值波动风险并满足流动性的前提下，动态投资于股票、债券、现金及现金等价物等资产品种并运用股指期货等各种金融工具提高收益率。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

转型前

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过定期开放的形式保持适度流动性，并通过相对灵活的资产配置和主动的投资管理，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将秉持战略和战术资产配置理念，通过稳健管理的多策略投资系统，在控制市场风险、尽量降低净值波动风险并满足流动性的前提下，动态投资于股票、债券、现金及现金等价物等资产品种并运用股指期货等各种金融工具提高收益率。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。

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	嘉合基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	崔为中	阮劲松
	联系电话	021-60168288	010-65110109
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	js.ruan@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-0603-299	4008888811/95541
传真		021-65015077	022-58314791
注册地址		上海市虹口区广纪路738号1幢329室	天津市河东区海河东路218号
办公地址		上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		200082	300012
法定代表人		郝艳芬	李伏安

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)

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	2019年03月13日（基金合同生效日） - 2019年12月31日

	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
本期已实现收益	1,102,374.10	1,166,959.10
本期利润	1,652,302.41	5,872,892.06
加权平均基金份额本期利润	0.1483	0.1469
本期加权平均净值利润率	14.18%	13.48%
本期基金份额净值增长率	15.40%	14.52%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末	
期末可供分配利润	661,002.93	6,153,578.88
期末可供分配基金份额利润	0.0625	0.0573
期末基金资产净值	12,059,498.16	121,935,071.29
期末基金份额净值	1.1402	1.1347
3.1.3 累计期末指标	2019年末	
基金份额累计净值增长率	15.40%	14.52%

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、所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（为期末余额，不是当期发生数）。

4、本基金转型后合同于2019年3月13日生效。

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

嘉合睿金混合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
过去三个月	7.71%	0.55%	4.68%	0.44%	3.03%	0.11%

过去六个月	11.90%	0.59%	4.68%	0.51%	7.22%	0.08%
自基金合同生效起至今	15.40%	0.70%	5.81%	0.69%	9.59%	0.01%

嘉合睿金混合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
过去三个月	7.37%	0.55%	4.68%	0.44%	2.69%	0.11%
过去六个月	11.32%	0.59%	4.68%	0.51%	6.64%	0.08%
自基金合同生效起至今	14.52%	0.70%	5.81%	0.69%	8.71%	0.01%

3.2.2 自基金转型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

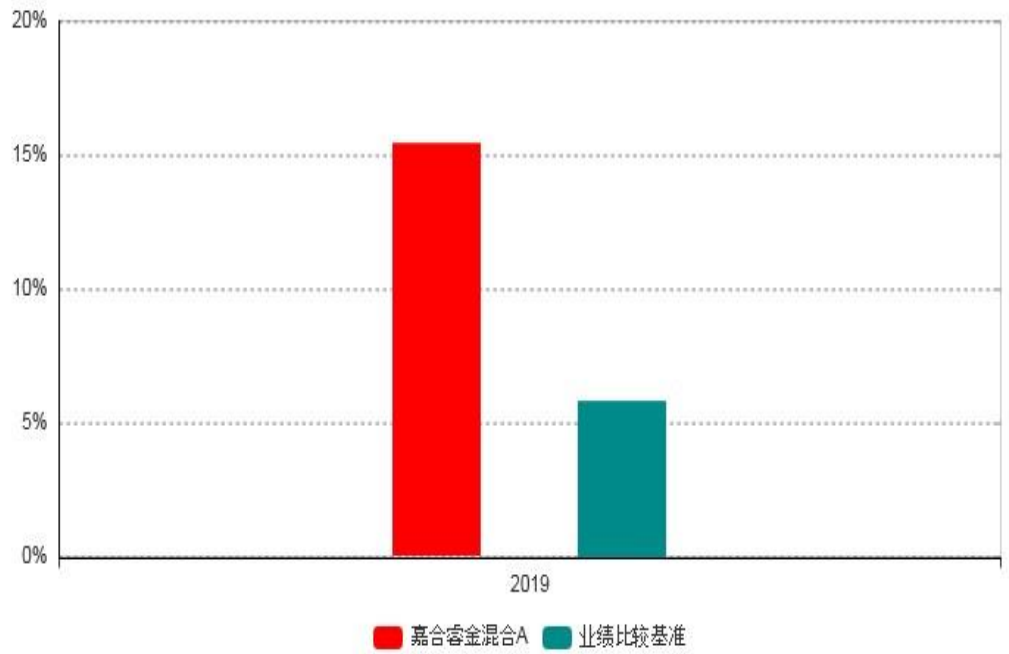
注：1、本基金于 2019 年 3 月 13 日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来。截至本报告期末，本基金转型不满一年。

2、本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 13 日，按基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。

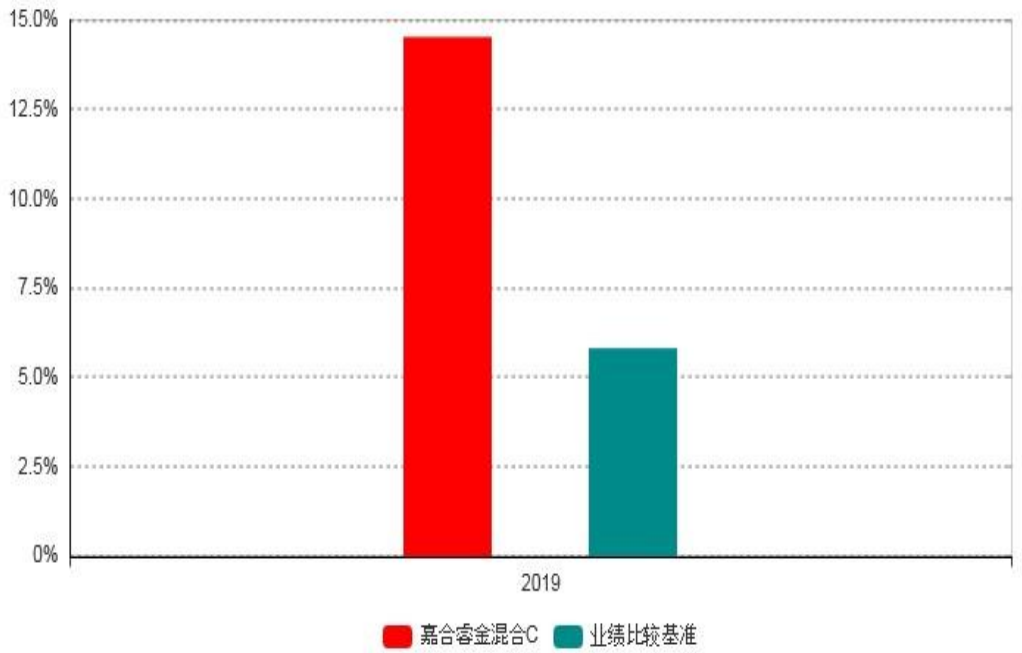
3、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

注：1、本基金于 2019 年 3 月 13 日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来。截至本报告期末，本基金转型不满一年。
2、本基金基金合同生效日为 2019 年 3 月 13 日，按基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。
3、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金于 2019 年 3 月 13 日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来，图中列示的 2019 年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。



注：本基金于 2019 年 3 月 13 日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来，图中列示的 2019 年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

嘉合睿金混合A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019年	0.200	209,301.25	-	209,301.25	-
合计	0.20	209,301.25	-	209,301.25	-

嘉合睿金混合C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2019年	0.150	7,639.97	-	7,639.97	-
合计	0.15	7,639.97	-	7,639.97	-

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）

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03月12日)		2018年03月21日（基金合同生效日）-2018年12月31日	
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
本期已实现收益	117,964.86	5,628.55	-324,064.39	-603,556.43
本期利润	401,937.01	19,410.56	-326,205.29	-651,574.47
加权平均基金份额本期利润	0.0385	0.0382	-0.0312	-0.0094
本期加权平均净值利润率	3.93%	3.91%	-3.14%	-9.40%
本期基金份额净值增长率	3.96%	3.95%	-3.12%	-3.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年03月12日)		2018年末	
期末可供分配利润	-206,099.53	-11,052.71	-326,205.29	-16,785.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0197	-0.0217	-0.0312	-0.0330
期末基金资产净值	10,528,672.90	510,962.02	10,126,735.89	491,551.46
期末基金份额净值	1.0072	1.0052	0.9688	0.9670
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年03月12日)		2018年末	
基金份额累计净值增长率	0.72%	0.52%	-3.12%	-3.30%

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、所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（为期末余额，不是当期发生数）。

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

嘉合睿金混合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
2019年1月1日至2019年3月12日	3.96%	0.45%	15.01%	0.92%	-11.05%	-0.47%
2018年7月1日至2019年3月12日	0.36%	0.33%	5.38%	0.91%	-5.02%	-0.58%
2018年3月21日至2019年3月12日	0.72%	0.28%	-2.97%	0.85%	3.69%	-0.57%

嘉合睿金混合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
2019年1月1日至2019年3月12日	3.95%	0.45%	15.01%	0.92%	-11.06%	-0.47%
2018年7月1日至2019年3月12日	0.19%	0.33%	5.38%	0.91%	-5.19%	-0.58%
2018年3月21日至2019年3月12日	0.52%	0.28%	-2.97%	0.85%	3.49%	-0.57%

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

注：1、本基金基金合同于 2018 年 3 月 21 日生效，截至 2019 年 3 月 12 日本基金合同生效未满一年。

2、本基金基金合同生效日为 2018 年 3 月 21 日，按基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

注：1、本基金基金合同于 2018 年 3 月 21 日生效，截至 2019 年 3 月 12 日本基金合同生效未满一年。

2、本基金基金合同生效日为 2018 年 3 月 21 日，按基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起 6 个月。建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注：图中列示的 2018 年、2019 年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。

注：图中列示的 2018 年、2019 年基金净值增长率按该年度本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

截至2019年3月12日（基金合同失效前日），本基金未实施利润分配。

§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

嘉合基金管理有限公司（以下简称"嘉合基金"或"公司"）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、广东万和集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、北京智勇仁信投资咨询有限公司及山东通汇资本投资集团有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2019年12月31日，公司注册资本金为人民币3亿元。

截至2019年12月31日，嘉合基金旗下共管理11只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合消费升级混合型发起式证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合医疗健康混合型发起式证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金。

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		
骆海涛	权益投资部副总监、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金的基金经理	2019-03-13	-	10年	美国密歇根大学金融工程硕士，亚利桑那大学光学博士，上海交通大学应用物理学学士和凝聚态物理硕士，拥有10年金融从业经历。历任美国普氏能源（Platts)公司量化分析师，平安资产管理公司和平安投管中心任战略资产配置团队负责人。2015年4月加入嘉合基金管理有限公司。

注：1、骆海涛的"任职日期"为合同生效日。
2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人依据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，制定了《嘉合基金管理有限公司公平交易制度》，明确各部门的职责以及公平交易控制的内容、方法。

本基金管理人通过事前识别、事中控制、事后检查三个步骤来保证公平交易。事前识别的任务是制定制度和业务流程、设置系统控制项以强制执行公平交易和防范反向交易；事中控制的工作是确保公司授权、研究、投资、交易等行为控制在事前设定的范围之内，各项业务操作根据制度和业务流程进行；事后检查公司投资行为与事前设定的流程、限额等有无偏差，编制投资组合公平交易报告，分析事中控制的效果，并将评价结果报告公司管理层。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

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

2019年，全球经济处于下行周期，美联储全年三次降息标志着全球新一轮货币宽松周期的开启，利率中枢下降，全球步入新一轮资产荒。国内方面，宏观经济面临下行压力，稳增长的积极财政政策及稳健偏松的货币政策持续发力，逆周期调控力度持续加大，国内经济硬着陆的风险较小。与此同时，随着刚性兑付的打破，金融对于实体经济持续反哺，国内利率中枢同样进入下行通道，国内权益资产相对其余大类资产已凸显出较为明显的比价优势，另外全球来看，国内股票市场整体估值偏低，A股市场的中长期配置时点已经来临。

本报告期内本基金保持了一定的权益仓位，配置方面包括金融、消费、科技、医药等行业，整体风格较为均衡，不但取得了良好的收益表现，同时也控制了相对较小的净值回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年3月12日，嘉合睿金混合A基金份额净值为1.0072元；自2019年1月1日至2019年3月12日本基金份额净值增长率为3.96%，同期业绩比较基准收益率为15.01%。

截至2019年3月12日，嘉合睿金混合C基金份额净值为1.0052元；自2019年1月1日至2019年3月12日本基金份额净值增长率为3.95%，同期业绩比较基准收益率为15.01%。

截至2019年12月31日，嘉合睿金混合A基金份额净值为1.1402元；自2019年3月13日至2019年12月31日本基金份额净值增长率为15.40%，同期业绩比较基准收益率为5.81%。

截至2019年12月31日，嘉合睿金混合C基金份额净值为1.1347元；自2019年3月13日至2019年12月31日本基金份额净值增长率为14.52%，同期业绩比较基准收益率为5.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年初，国内爆发新冠肺炎疫情，给国内经济生活及资本市场带来了巨大冲击，同时，疫情有向海外进一步蔓延趋势，全球经济面临挑战。一方面，为应对疫情压力，海内外货币环境将大概率处于偏松状态，金价将获得一定支撑，同时广谱利率的下行以及通胀预期的抬升也将利好权益市场估值。另一方面，随着各国应对疫情工作的有效开展，疫情对于经济的冲击终将结束，经济生产终将恢复正常。因此，我们总体判断疫情冲击对于权益市场的冲击是短暂的且从中长期角度看正好为优质资产提供了一个很好的介入点。因此总体上对于今年的权益市场保持谨慎乐观的态度，中观层面相对看好两类行业：一是因为疫情影响行业集中度存在加速提升的传统行业，另一类是受益于经济转型以及景气周期持续向上的新兴行业，我们将重点关注这些行业中具有持续竞争优势的上市企业的相关投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，为了保证公司合规运作、加强内部控制、防范经营风险、保障基金份额持有人的利益，监察稽核人员按照独立、客观、公正的原则，依据国家相关法律法规、基金合同和管理制度，采用日常检查与专项检查、定期检查和不定期检查有机结合的方式，对公司内控制度的合法性和合规性、执行的有效性和完整性、风险的防范和控制等进行了持续的监察稽核，对发现的问题进行提示和追踪落实，定期制作监察稽核报告，及时呈报公司领导层及上级监管部门。

本基金管理人采取的主要措施包括：

（1）积极响应中国证监会关于加强市场监管的号召，通过组织全体员工开展对监管政策规范、公司规章制度等的学习，使员工从思想上提高合规理念，从实践中增强合规操作，确保其行为守法合规、严格自律、恪守诚实信用原则，以充分维护基金持有人的利益。

（2）修订管理制度，完善投资业务流程

根据监管部门的规定，及时更新公司各项投资管理制度，不断加强内部流程控制，动态作出各项合规提示，防范投资风险。

本基金管理人将一如既往地遵循诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产、不断提高投资管理工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总经理批准后实施。

基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用中国证券投资基金业协会核算估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准来估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为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；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类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。

本报告期内，本基金于2019年7月8日实施利润分配，嘉合睿金混合A每10份基金份额派发红利0.200元，嘉合睿金混合C每10份基金份额派发红利0.150元。

4.9 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

本报告期内无需要说明的相关情形。

§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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《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，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人对本基金本报告中财务指标、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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告(转型后)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2000446号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的嘉合睿金混合型发起式证券投资基金 （以下简称"嘉合睿金混合基金"） 财务报表，包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2019 年 3 月 13 日 (基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 （基金净值） 变动表以及财务报表附注。

	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 （以下简称"中国证监会"） 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了嘉合睿金混合基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2019 年 3 月 13 日(基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 （以下简称"审计准则"） 的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉合睿金混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	嘉合睿金混合基金管理人嘉合基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")对其他信息负责。其他信息包括嘉合睿金混合基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息

	存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映， 并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉合睿金混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 （如适用），并运用持续经营假设，除非嘉合睿金混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督嘉合睿金混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证， 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

	(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉合睿金混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉合睿金混合基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 （包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通， 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张楠 欧梦溦
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼
审计报告日期	2020-04-23

§6 审计报告(转型前)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2000819号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金 （以下简称"嘉合睿金混合基金"） 财务报表，包括 2019 年 3 月 12 日(基金合同失效前日)的资产负债表、2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 12 日(基金合同失效前日)止期间的利润表、所有者权益 （基金净值） 变动表以及财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会 （以下简称"中国证监会"） 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了嘉合睿金混合基金 2019 年 3 月 12 日(基金合同失效前日)的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 3 月 12 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果及基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 （以下简称"审计准则"） 的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉合睿金混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-

其他信息	嘉合睿金基金管理人嘉合基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")对其他信息负责。其他信息包括嘉合睿金混合基金 2019 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映， 并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉合睿金混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非嘉合睿金混合基金计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督嘉合睿金混合基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证， 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由

	于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉合睿金混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉合睿金混合基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通， 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控

	制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	张楠	欧梦溦
会计师事务所的地址	上海市南京西路1266号恒隆广场2期25楼	
审计报告日期	2020-04-23	

§7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	9,097,411.44
结算备付金		15,666,055.40
存出保证金		330,007.69
交易性金融资产	7.4.7.2	109,487,675.87
其中：股票投资		109,487,675.87
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		4,139,338.51
应收利息	7.4.7.5	3,851.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-

资产总计		138,724,340.02
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		4,148,306.14
应付赎回款		57,614.43
应付管理人报酬		131,266.71
应付托管费		10,938.89
应付销售服务费		79,512.72
应付交易费用	7.4.7.7	202,131.68
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	100,000.00
负债合计		4,729,770.57
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	118,034,182.00
未分配利润	7.4.7.10	15,960,387.45
所有者权益合计		133,994,569.45
负债和所有者权益总计		138,724,340.02

注：1、报告截止日2019年12月31日，基金份额净值1.1352元，其中A类基金份额净值1.1402元，C类基金份额净值1.1347元；基金份额总额118,034,182.00份，其中A类基金份额10,577,091.74份，C类基金份额107,457,090.26份。

2、本基金转型后合同于2019年3月13日生效。

3、本财务报表的实际编制期间为2019年3月13日（转型后首日）至2019年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年03月13日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年03月13日 至2019年12月31日
一、收入		9,236,570.93
1.利息收入		229,536.75
其中：存款利息收入	7.4.7.11	59,659.45
债券利息收入		0.10
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		169,877.20
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,738,778.56
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,586,637.61
基金投资收益	7.4.7.13	-
债券投资收益	7.4.7.14	159.82
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	151,981.13
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,255,861.27
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	12,394.35
减：二、费用		1,711,376.46
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	550,682.72
2．托管费	7.4.10.2.2	45,890.27
3．销售服务费	7.4.10.2.3	291,779.04
4．交易费用	7.4.7.20	719,250.72
5．利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6．税金及附加		-
7．其他费用	7.4.7.21	103,773.71
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,525,194.47
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,525,194.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年03月13日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年03月13日至2019年12月31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)	10,961,277.90	78,357.02	11,039,634.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,525,194.47	7,525,194.47
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）	107,072,904.10	8,573,777.18	115,646,681.28
其中：1.基金申购款	225,675,758.41	19,266,768.44	244,942,526.85
2.基金赎回款	-118,602,854.31	-10,692,991.26	-129,295,845.57
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净	-	-216,941.22	-216,941.22

值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	118,034,182.00	15,960,387.45	133,994,569.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

蔡奕	沈珂	季玲
———————————	———————————	———————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉合睿金混合型发起式证券投资基金（以下简称"本基金"）是由嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型而来。根据嘉合基金管理有限公司于2019年2月13日发布的《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，原嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金于2019年1月9日至2019年2月11日以通讯方式召开了基金份额持有人大会。依据此次基金持有人大会决议，本基金《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》自2019年3月13日起生效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》和《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、股指期货、资产支持证券、权证、货币市场工具、银行存款以及现金，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）。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为50%－95%，持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年12月31日的财务状况、自2019年3月13日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与2018年年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历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自2019年3月13日 (基金合同生效日) 至2019年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资分类为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资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类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。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分

配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称"估值处理标准"），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权

分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	9,097,411.44
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个月以上	-
其他存款	-
合计	9,097,411.44

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		103,984,219.38	109,487,675.87	5,503,456.49
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		103,984,219.38	109,487,675.87	5,503,456.49

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,863.09
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	824.67
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	163.35
合计	3,851.11

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末

	2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	202,131.68
银行间市场应付交易费用	-
合计	202,131.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	100,000.00
合计	100,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 嘉合睿金混合A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合A)	本期2019年03月13日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,452,941.18	10,452,941.18
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	2,922,584.96	2,922,584.96
本期赎回（以“-”号填列）	-2,798,434.40	-2,798,434.40
本期末	10,577,091.74	10,577,091.74

7.4.7.9.2 嘉合睿金混合C

金额单位：人民币元

项目 （嘉合睿金混合C）	本期2019年03月13日至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	508,336.72	508,336.72
-基金份额折算调整	-	-
-未领取红利份额折算调整（若有）	-	-
-集中申购募集资金本金及利息	-	-
-基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	222,753,173.45	222,753,173.45
本期赎回（以“-”号填列）	-115,804,419.91	-115,804,419.91
本期末	107,457,090.26	107,457,090.26

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 嘉合睿金混合A

单位：人民币元

项目 （嘉合睿金混合A）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-206,099.53	281,831.25	75,731.72
本期利润	1,102,374.10	549,928.31	1,652,302.41
本期基金份额交易产生的变动数	-25,970.39	-10,356.07	-36,326.46
其中：基金申购款	120,722.94	127,867.47	248,590.41
基金赎回款	-146,693.33	-138,223.54	-284,916.87
本期已分配利润	-209,301.25	-	-209,301.25
本期末	661,002.93	821,403.49	1,482,406.42

7.4.7.10.2 嘉合睿金混合C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

（嘉合睿金混合C）			
基金合同生效日	-11,052.71	13,678.01	2,625.30
本期利润	1,166,959.10	4,705,932.96	5,872,892.06
本期基金份额交易产生的变动数	5,005,312.46	3,604,791.18	8,610,103.64
其中：基金申购款	10,608,958.79	8,409,219.24	19,018,178.03
基金赎回款	-5,603,646.33	-4,804,428.06	-10,408,074.39
本期已分配利润	-7,639.97	-	-7,639.97
本期末	6,153,578.88	8,324,402.15	14,477,981.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年03月13日至2019年12月31日
活期存款利息收入	49,304.77
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	8,711.66
其他	1,643.02
合计	59,659.45

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	247,283,922.86
减：卖出股票成本总额	243,697,285.25
买卖股票差价收入	3,586,637.61

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	159.82
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	159.82

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,160.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,999.96
减：应收利息总额	0.22
买卖债券差价收入	159.82

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	151,981.13
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	151,981.13

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
1.交易性金融资产	5,255,861.27
——股票投资	5,255,861.27
——债券投资	-
——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	5,255,861.27

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
基金赎回费收入	12,394.35
合计	12,394.35

注：赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	719,250.72
银行间市场交易费用	-
合计	719,250.72

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
审计费用	40,273.71
信息披露费	50,000.00

证券出借违约金	-
中债登	13,500.00
合计	103,773.71

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

本基金本报告不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。

关联方名称	与本基金的关系
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	550,682.72
其中：支付销售机构的客户维护费	55,662.64

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	45,890.27

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 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 2019年03月13日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	160,112.76	160,112.76
合计	0.00	160,112.76	160,112.76

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

嘉合睿金混合A

份额单位：份

项目	本期

	2019年03月13日至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年03月13日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%

嘉合睿金混合C

份额单位：份

项目	本期 2019年03月13日至2019年12月31日
基金合同生效日（2019年03月13日）持有的基金份额	-
报告期初持有的基金份额	508,336.72
报告期间申购/买入总份额	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00
减:报告期间赎回/卖出总份额	0.00
报告期末持有的基金份额	508,336.72
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.43%

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

嘉合睿金混合A

关联方名称	本期末 2019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
广东万和集团有限公司	3,484,547.06	2.95%
上海慧弘实业集团有限公司	3,484,197.06	2.95%
福建圣农控股集团有限公司	3,484,197.06	2.95%

7.4.10.6 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 2019年03月13日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司	9,097,411.44	49,304.77

注：除上表列示的金额外，本基金通过"渤海银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，2019年12月31日的相关余额为人民币1,666,055.40元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

嘉合睿金混合A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注

1	2019-07-08	2019-07-08	0.200	209,301.25	-	209,301.25	-
合计			0.200	209,301.25	-	209,301.25	-

嘉合睿金混合C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2019-07-08	2019-07-08	0.150	7,639.97	-	7,639.97	-
合计			0.150	7,639.97	-	7,639.97	-

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688111	金山办公	2019-11-11	2020-05-17	科创板限售	45.86	128.63	14,659	672,261.74	1,885,587.17	-
688258	卓易信息	2019-11-28	2020-06-08	科创板限售	26.49	70.05	3,465	91,787.85	242,723.25	-
688101	三达膜	2019-11-08	2020-05-14	科创板限售	18.26	17.89	9,560	174,565.60	171,028.40	-
688288	鸿泉物联	2019-10-29	2020-05-05	科创板限售	24.99	28.45	3,429	85,690.71	97,555.05	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

●信用风险

●流动性风险

●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。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和投研风控的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及投资风控部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及投资风控部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

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

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行渤海银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；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，以保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、权证等权益类工具，以及债券等固定收益类工具，其中权益类投资占有较大比例。本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%，截至2019年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.79%。

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	9,097,411.44	-	-	-	-	-	9,097,411.44
结算备付金	15,666,055.40	-	-	-	-	-	15,666,055.40
存出保证金	330,007.69	-	-	-	-	-	330,007.69
交易性金融资产	-	-	-	-	-	109,487,675.87	109,487,675.87
应收证券清算款	-	-	-	-	-	4,139,338.51	4,139,338.51
应收利息	-	-	-	-	-	3,851.11	3,851.11
资产总计	25,093,474.53	-	-	-	-	113,630,865.49	138,724,340.02
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	4,148,306.14	4,148,306.14
应付赎回款	-	-	-	-	-	57,614.43	57,614.43
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	131,266.71	131,266.71
应付托管费	-	-	-	-	-	10,938.89	10,938.89
应付销售服务	-	-	-	-	-	79,512.72	79,512.72

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	202,131.68	202,131.68
其他负债	-	-	-	-	-	100,000.00	100,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	4,729,770.57	4,729,770.57
利率敏感度缺口	25,093,474.53	-	-	-	-	108,901,094.92	133,994,569.45

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、基金净值已按照影子价格进行调整	
分析	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 2019年12月31日
	市场利率平行下降25个基点	-
	市场利率平行上升25个基点	-

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	109,487,675.87	81.71
交易性金融资产－基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-
其他	-	-
合计	109,487,675.87	81.71

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感度分析基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	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 2019年12月31日
	敏感度分析基准上升5%	3,192,848.10
	敏感度分析基准下降5%	-3,192,848.10

注：本基金根据持仓类别情况选用基金业绩比较基准作为市场价格波动风险的敏感度分析基准。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

2019年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币107,090,782.00元，属于第二层次的余额为人民币2,396,893.87元，属于第三层次的余额为0。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金将综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

2019年12月31日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.2其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§7 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年03月12日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	63,005.18	31,328.04
结算备付金		364,590.04	2,431,624.15
存出保证金		62,766.98	84,971.56
交易性金融资产	7.4.7.2	4,422,440.96	446,549.00

其中：股票投资		4,420,441.00	446,549.00
基金投资		-	-
债券投资		1,999.96	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	6,000,000.00	7,700,000.00
应收证券清算款		637,811.16	97,687.00
应收利息	7.4.7.5	4,237.08	7,810.26
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,554,851.40	10,799,970.01
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019年03月12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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		432,697.39	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,143.90	5,429.55
应付托管费		357.33	904.95
应付销售服务费		16.54	41.92
应付交易费用	7.4.7.7	20,275.03	25,306.24
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	59,726.29	150,000.00
负债合计		515,216.48	181,682.66
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	10,961,277.90	10,961,277.90
未分配利润	7.4.7.10	78,357.02	-342,990.55
所有者权益合计		11,039,634.92	10,618,287.35
负债和所有者权益总计		11,554,851.40	10,799,970.01

注：1、报告截止日2019年3月12日，基金份额净值1.0071元，其中A类基金份额净值1.0072元，C类基金份额净值1.0052元；基金份额总额10,961,277.90份，其中A类基金份额10,452,941.18份，C类基金份额508,336.72份。

2、本基金转型前基金合同生效日为2018年3月21日。

3、本财务报表的实际编制期间为2019年1月1日至2019年3月12日止（基金合同失效前日）。

7.2 利润表

会计主体：嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年03月12日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
一、收入		531,170.70	-110,840.43
1.利息收入		49,628.61	1,982,303.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,391.42	118,886.16
债券利息收入		0.08	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		47,237.11	1,863,417.35

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		183,787.93	-2,042,985.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	183,787.93	-2,160,023.91
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	-	117,038.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	297,754.16	-50,158.94
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-	-
减：二、费用		109,823.13	866,939.33
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	12,491.76	373,148.71
2．托管费	7.4.10.2.2	2,081.98	62,191.40
3．销售服务费	7.4.10.2.3	96.46	54,092.38
4．交易费用	7.4.7.20	35,926.64	218,106.84
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	-
7．其他费用	7.4.7.21	59,226.29	159,400.00
三、利润总额（亏损总额		421,347.57	-977,779.76

以“-”号填列）			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		421,347.57	-977,779.76

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年03月12日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年03月12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)	10,961,277.90	-342,990.55	10,618,287.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	421,347.57	421,347.57
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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	10,961,277.90	78,357.02	11,039,634.92

益（基金净值）			
项 目	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31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)	135,674,965.18	-	135,674,965.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-977,779.76	-977,779.76
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)	-124,713,687.28	634,789.21	-124,078,898.07
其中：1.基金申购款	508,336.72	-8,336.72	500,000.00
2.基金赎回款	-125,222,024.00	643,125.93	-124,578,898.07
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）	10,961,277.90	-342,990.55	10,618,287.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

蔡奕	沈珂	季玲
————————	————————	————————
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经2016年11月7日中国证券监督管理委员会下发的《关于准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]2544号）注册，根据2017年7月31日中国证监会下发的《关于准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2017]1408号）变更注册为嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金，由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2018年3月21日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集资金总额人民币135,674,965.18元。上述募集资金已由会计师事务所验证，并出具了验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、股指期货、资产支持证券、权证、货币市场工具、银行存款以及现金，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）。本基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例为0%－100%，每个交易日日终在扣除股指期货需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；开放期内，股票资产占基金资产的比例为0%－95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

根据《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，基金份额持有人大会于2019年2月12日表决通过了《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》，新的基金合同于2019年3月13日生效，基金名称由“嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金”变更为“嘉合睿金混合型发起式证券投资基金”，

运作方式由“契约型开放式，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式”变更为“契约型开放式”，存续期为不定期，因此本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2019年3月12日(基金合同失效前日)的财务状况、2019年1月1日至2019年3月12日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与2018年年度报告相一致。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历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自2019年1月1日至2019年3月12日（基金合同失效前日）止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为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资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-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。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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认列。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。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益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(如适用)后的净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，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，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如不影响估值日基金份额净值小数点后第四位，发生时直接计入基金损益；如果影响基金份额净值小数点后第四位的，应采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类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。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分

配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称"估值处理标准"），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103号文《关于股权

分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日(含)以后，资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入个人所得税应纳税所得额。

(e)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	63,005.18	31,328.04
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个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	63,005.18	31,328.04

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年03月12日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,172,845.78	4,420,441.00	247,595.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,999.96	1,999.96	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,999.96	1,999.96	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,174,845.74	4,422,440.96	247,595.22
项目		上年度末2018年12月31日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		496,707.94	446,549.00	-50,158.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		496,707.94	446,549.00	-50,158.94

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

项目	本期末2019年03月12日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-
项目	上年度末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	7,700,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	826.84	12.38
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	2,567.77	1,203.62
应收债券利息	0.12	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	587.52	6,552.24
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	254.83	42.02
合计	4,237.08	7,810.26

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	20,275.03	25,306.24
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	20,275.03	25,306.24

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31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	59,726.29	150,000.00
合计	59,726.29	150,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 嘉合睿金混合A

金额单位：人民币元

项目（嘉合睿金混合A）	本期2019年01月01日至2019年03月12日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,452,941.18	10,452,941.18
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,452,941.18	10,452,941.18

7.4.7.9.2 嘉合睿金混合C

金额单位：人民币元

项目（嘉合睿金混合C）	本期2019年01月01日至2019年03月12日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	508,336.72	508,336.72
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	508,336.72	508,336.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 嘉合睿金混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-324,064.39	-2,140.90	-326,205.29
本期利润	117,964.86	283,972.15	401,937.01
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-206,099.53	281,831.25	75,731.72

7.4.7.10.2 嘉合睿金混合C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,681.26	-104.00	-16,785.26
本期利润	5,628.55	13,782.01	19,410.56
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,052.71	13,678.01	2,625.30

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
活期存款利息收入	814.46	49,998.25

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	1,364.15	68,168.13
其他	212.81	719.78
合计	2,391.42	118,886.16

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至 2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
卖出股票成交总额	13,029,978.11	85,965,314.48
减：卖出股票成本总额	12,846,190.18	88,125,338.39
买卖股票差价收入	183,787.93	-2,160,023.91

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	-	117,038.91
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	-	117,038.91

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
1.交易性金融资产	297,754.16	-50,158.94
——股票投资	297,754.16	-50,158.94
——债券投资	-	-
——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	297,754.16	-50,158.94

7.4.7.19 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
交易所市场交易费用	35,926.64	218,106.84
银行间市场交易费用	-	-
合计	35,926.64	218,106.84

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
审计费用	9,726.29	50,000.00
信息披露费	-	100,000.00
证券出借违约金	-	-
中债登	4,500.00	9,000.00
其他费用	45,000.00	400.00
合计	59,226.29	159,400.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金于2019年1月5日公告以通讯方式召开基金份额持有人大会，审议《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型并修改基金合同等有关事项的议案》，会议议案于2019年2月12日获得通过，大会决议自同日起生效。自2019年3月13日起，"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"正式转型为"嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金"。

7.4.9 关联方关系

7.4.9.1 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

本基金本报告不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。

7.4.9.2 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
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,491.76	373,148.71
其中：支付销售机构的客户维护费	-	80.08

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,081.98	62,191.40

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

7.4.10.2.3 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 2019年01月01日至2019年03月12日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	96.46	96.46
合计	0.00	96.46	96.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	54,065.65	54,065.65
合计	0.00	54,065.65	54,065.65

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年费率/当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

嘉合睿金混合A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金合同生效日（2018年03月21日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

嘉合睿金混合C

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年03月12日	上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日
基金合同生效日（2018年03月21日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	508,336.72	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	508,336.72
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	508,336.72	508,336.72
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.64%	4.64%

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

嘉合睿金混合A

关联方名称	本期末 2019年03月12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
广东万和集团有限公司	3,484,547.06	31.79%	3,484,547.06	31.79%
上海慧弘实业集团有限公司	3,484,197.06	31.79%	3,484,197.06	31.79%

福建圣农控股集团有限公司	3,484,197.06	31.79%	3,484,197.06	31.79%

7.4.10.6 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 2019年01月01日至2019年03月12日		上年度可比期间 2018年03月21日（基金合同生效日）至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司	63,005.18	814.46	31,328.04	49,998.25

注：本基金通过“渤海银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2019年3月12日(基金合同失效前日)的相关余额为人民币364,590.04元。（2018年12月31日：人民币2,431,624.15元）

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019年03月12日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
1130	中信	2019	2019	新债	100.	100.	20	1,99	1,99	-

21	转债	-03-06	-03-19	未上市	00	00		9.96	9.96	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至2019年3月12日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至2019年3月12日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

●信用风险

●流动性风险

●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。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和投研风控的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及投资风控

部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及投资风控部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

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

7.4.13.2 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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行渤海银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
AAA	1,999.96	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,999.96	-

注：1、上述表格列示中不含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。
2、根据中国人民银行2006年3月29日发布的"银发[2006]95号"文《中国人民银行信用评级管理指导意见》，以及2006年11月21日发布的《信贷市场和银行间债券市场信用评级规范》等文件的有关规定，中长期债券信用等级划分成三等九级，分别用AAA、AA、A、BBB、BB、B、CCC、CC和C表示，其中，除AAA级、CCC级(含)以下等级外，每一个信用等级可用"+"、"-"符号进行微调，表示略高或略低于本等级。
3、未评级为短期融资券等无信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和批露；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，以保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、权证等权益类工具，以及债券等固定收益类工具，其中权益类投资占有较大比例。本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的15%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)，本基金与由本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不超过该上市公司可流通股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%，截至2019年3月12日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.02%。

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性，因此利率风险在一定程度上存在。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年03月12日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	63,005.18	-	-	-	-	-	63,005.18

结算备付金	364,590.04	-	-	-	-	-	364,590.04
存出保证金	62,766.98	-	-	-	-	-	62,766.98
交易性金融资产	-	-	1,999.96	-	-	4,420,441.00	4,422,440.96
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	637,811.16	637,811.16
应收利息	-	-	-	-	-	4,237.08	4,237.08
资产总计	6,490,362.20	-	1,999.96	-	-	5,062,489.24	11,554,851.40
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	432,697.39	432,697.39
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,143.90	2,143.90
应付托管费	-	-	-	-	-	357.33	357.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16.54	16.54
应付交易费用	-	-	-	-	-	20,275.03	20,275.03
其他负债	-	-	-	-	-	59,726.29	59,726.29
负债总计	-	-	-	-	-	515,216.48	515,216.48
利率敏感度缺口	6,490,362.20	-	1,999.96	-	-	4,547,272.76	11,039,634.92
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	31,328.04	-	-	-	-	-	31,328.04
结算备付金	2,431,624.15	-	-	-	-	-	2,431,624.15
存出保证金	84,971.56	-	-	-	-	-	84,971.56
交易性金融资产	-	-	-	-	-	446,549.00	446,549.00
买入返售金融资产	7,700,000.00	-	-	-	-	-	7,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	97,687.00	97,687.00
应收利息	-	-	-	-	-	7,810.26	7,810.26

资产总计	10,247,923.75	-	-	-	-	552,046.26	10,799,970.01
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,429.55	5,429.55
应付托管费	-	-	-	-	-	904.95	904.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	41.92	41.92
应付交易费用	-	-	-	-	-	25,306.24	25,306.24
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	181,682.66	181,682.66
利率敏感度缺口	10,247,923.75	-	-	-	-	370,363.60	10,618,287.35

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、基金净值已按照影子价格进行调整		
分析	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 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
	市场利率平行下降25个基点	-	-
	市场利率平行上升25个基点	-	-

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每

日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年03月12日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	4,420,441.00	40.04	446,549.00	4.21
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,999.96	0.02	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,422,440.96	40.06	446,549.00	4.21

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感度分析基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	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 2019年03月12日	上年度末 2018年12月31日
	敏感度分析基准上升5%	140,392.86	118,289.50
	敏感度分析基准下降5%	-140,392.86	-118,289.50

注：本基金根据持仓类别情况选用基金业绩比较基准作为市场价格波动风险的敏感度分析基准。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1以公允价值计量的资产和负债

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

2019年3月12日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币4,420,441.00元，属于第二层次的余额为人民币1,999.96元，属于第三层次的余额为0（2018年12月31日，属于第一层次的余额为人民币446,549.00元，属于第二层次的余额为人民币0，属于第三层次的余额为0）。

(a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金将综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

(b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

2019年3月12日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2018年12月31日：无)。

7.4.14.2其他金融工具的公允价值(年末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

§8 投资组合报告(转型后)

8.1 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	109,487,675.87	78.92
	其中：股票	109,487,675.87	78.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	24,763,466.84	17.85
8	其他各项资产	4,473,197.31	3.22
9	合计	138,724,340.02	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,716,332.00	1.28
C	制造业	60,869,658.38	45.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,097,024.00	1.57
F	批发和零售业	9,922,170.00	7.40
G	交通运输、仓储和邮政业	6,020,553.65	4.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,640,740.42	1.97
J	金融业	23,965,853.42	17.89
K	房地产业	1,249,632.00	0.93
L	租赁和商务服务业	213,480.00	0.16

M	科学研究和技术服务业	792,232.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	109,487,675.87	81.71

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	64,127	5,480,293.42	4.09
2	603305	旭升股份	138,900	4,715,655.00	3.52
3	603939	益丰药房	58,000	4,246,760.00	3.17
4	603833	欧派家居	35,500	4,153,500.00	3.10
5	002352	顺丰控股	108,935	4,051,292.65	3.02
6	002273	水晶光电	245,000	3,959,200.00	2.95
7	600612	老凤祥	73,600	3,504,096.00	2.62
8	002415	海康威视	103,000	3,372,220.00	2.52
9	002572	索菲亚	160,000	3,352,000.00	2.50
10	002422	科伦药业	130,000	3,053,700.00	2.28
11	600104	上汽集团	126,700	3,021,795.00	2.26
12	600036	招商银行	77,600	2,916,208.00	2.18
13	300003	乐普医疗	87,000	2,877,960.00	2.15

14	300735	光弘科技	102,000	2,660,160.00	1.99
15	601933	永辉超市	350,000	2,639,000.00	1.97
16	601166	兴业银行	124,400	2,463,120.00	1.84
17	603313	梦百合	111,800	2,360,098.00	1.76
18	300363	博腾股份	164,100	2,348,271.00	1.75
19	601633	长城汽车	260,000	2,301,000.00	1.72
20	600660	福耀玻璃	85,000	2,039,150.00	1.52
21	600276	恒瑞医药	22,300	1,951,696.00	1.46
22	688111	金山办公	14,659	1,885,587.17	1.41
23	600000	浦发银行	144,000	1,781,280.00	1.33
24	000012	南 玻Ａ	350,000	1,753,500.00	1.31
25	603883	老百姓	27,000	1,730,160.00	1.29
26	600031	三一重工	92,000	1,568,600.00	1.17
27	600519	贵州茅台	1,255	1,484,665.00	1.11
28	600016	民生银行	231,200	1,458,872.00	1.09
29	002120	韵达股份	42,500	1,415,250.00	1.06
30	601328	交通银行	243,300	1,369,779.00	1.02
31	603180	金牌厨柜	20,000	1,335,600.00	1.00
32	603233	大参林	25,000	1,306,250.00	0.97
33	600585	海螺水泥	22,400	1,227,520.00	0.92
34	601668	中国建筑	208,000	1,168,960.00	0.87
35	601398	工商银行	198,800	1,168,944.00	0.87
36	600887	伊利股份	37,685	1,165,973.90	0.87
37	600309	万华化学	19,400	1,089,698.00	0.81
38	601865	福莱特	85,000	1,031,050.00	0.77
39	600030	中信证券	38,500	974,050.00	0.73
40	601601	中国太保	22,500	851,400.00	0.64
41	600048	保利地产	52,400	847,832.00	0.63
42	600690	海尔智家	42,800	834,600.00	0.62
43	603259	药明康德	8,600	792,232.00	0.59
44	600819	耀皮玻璃	150,000	763,500.00	0.57

45	601818	光大银行	164,100	723,681.00	0.54
46	601229	上海银行	74,400	706,056.00	0.53
47	300136	信维通信	15,000	680,700.00	0.51
48	600837	海通证券	43,600	674,056.00	0.50
49	601088	中国神华	33,500	611,375.00	0.46
50	601688	华泰证券	29,400	597,114.00	0.45
51	600028	中国石化	111,200	568,232.00	0.42
52	601988	中国银行	149,500	551,655.00	0.41
53	600019	宝钢股份	89,500	513,730.00	0.38
54	600050	中国联通	87,000	512,430.00	0.38
55	601628	中国人寿	14,400	502,128.00	0.37
56	601939	建设银行	69,100	499,593.00	0.37
57	600703	三安光电	26,500	486,540.00	0.36
58	601288	农业银行	131,100	483,759.00	0.36
59	601989	中国重工	82,100	430,204.00	0.32
60	601336	新华保险	8,500	417,775.00	0.31
61	601857	中国石油	70,300	409,849.00	0.31
62	600340	华夏幸福	14,000	401,800.00	0.30
63	601186	中国铁建	35,900	364,026.00	0.27
64	601390	中国中铁	58,100	345,114.00	0.26
65	601111	中国国航	29,700	287,793.00	0.21
66	600196	复星医药	9,900	263,340.00	0.20
67	600029	南方航空	35,100	252,018.00	0.19
68	688258	卓易信息	3,465	242,723.25	0.18
69	601800	中国交建	23,900	218,924.00	0.16
70	601888	中国国旅	2,400	213,480.00	0.16
71	601138	工业富联	11,300	206,451.00	0.15
72	688101	三达膜	9,560	171,028.40	0.13
73	601211	国泰君安	8,900	164,561.00	0.12
74	603993	洛阳钼业	29,100	126,876.00	0.09
75	688288	鸿泉物联	3,429	97,555.05	0.07

76	601066	中信建投	3,200	97,280.00	0.07
77	601319	中国人保	11,100	84,249.00	0.06
78	300616	尚品宅配	700	52,164.00	0.04
79	603109	N神驰	684	18,105.48	0.01
80	000333	美的集团	200	11,650.00	0.01
81	603288	海天味业	100	10,751.00	0.01
82	600009	上海机场	100	7,875.00	0.01
83	600233	圆通速递	500	6,325.00	0.00
84	601766	中国中车	200	1,428.00	0.00
85	000413	东旭光电	200	672.00	0.00
86	688268	华特气体	3	131.55	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	15,827,442.49	11.81
2	600519	贵州茅台	12,239,182.40	9.13
3	601166	兴业银行	9,959,757.92	7.43
4	600036	招商银行	9,662,293.50	7.21
5	600030	中信证券	8,200,665.00	6.12
6	600612	老凤祥	8,112,335.00	6.05
7	600031	三一重工	7,397,557.02	5.52
8	600887	伊利股份	6,418,991.00	4.79
9	601601	中国太保	6,190,953.19	4.62
10	600276	恒瑞医药	5,882,076.00	4.39
11	600104	上汽集团	5,839,981.00	4.36
12	603883	老百姓	5,739,015.90	4.28
13	600000	浦发银行	5,689,849.00	4.25
14	601328	交通银行	5,515,696.00	4.12

15	600309	万华化学	5,208,207.00	3.89
16	600016	民生银行	5,185,192.00	3.87
17	601288	农业银行	5,086,169.00	3.80
18	601398	工商银行	4,970,256.00	3.71
19	002352	顺丰控股	4,933,364.50	3.68
20	600660	福耀玻璃	4,760,448.00	3.55
21	603939	益丰药房	4,674,744.00	3.49
22	300003	乐普医疗	4,598,643.00	3.43
23	300735	光弘科技	4,432,623.30	3.31
24	601668	中国建筑	4,390,222.00	3.28
25	603305	旭升股份	4,281,596.00	3.20
26	600026	中远海能	4,053,800.00	3.03
27	601633	长城汽车	4,008,493.22	2.99
28	600600	青岛啤酒	4,000,784.88	2.99
29	603833	欧派家居	3,887,409.00	2.90
30	002415	海康威视	3,872,838.00	2.89
31	600048	保利地产	3,734,323.22	2.79
32	000001	平安银行	3,612,378.00	2.70
33	600585	海螺水泥	3,515,231.78	2.62
34	002273	水晶光电	3,448,896.00	2.57
35	002422	科伦药业	3,297,573.00	2.46
36	300363	博腾股份	3,265,884.00	2.44
37	002572	索菲亚	3,233,278.00	2.41
38	601933	永辉超市	3,181,338.00	2.37
39	603259	药明康德	3,025,460.00	2.26
40	600837	海通证券	2,800,675.00	2.09
41	601211	国泰君安	2,691,242.02	2.01
42	000625	长安汽车	2,681,951.00	2.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计买入金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	11,665,172.00	8.71
2	601318	中国平安	10,123,522.00	7.56
3	601166	兴业银行	8,097,100.00	6.04
4	600036	招商银行	7,185,437.40	5.36
5	600030	中信证券	7,097,111.12	5.30
6	600031	三一重工	6,619,484.66	4.94
7	600887	伊利股份	5,195,882.43	3.88
8	601601	中国太保	5,108,060.05	3.81
9	601288	农业银行	4,690,123.00	3.50
10	600276	恒瑞医药	4,409,455.00	3.29
11	600612	老凤祥	4,332,669.00	3.23
12	600309	万华化学	4,207,691.92	3.14
13	601328	交通银行	4,186,774.00	3.12
14	603883	老百姓	4,137,840.00	3.09
15	600000	浦发银行	4,127,829.47	3.08
16	601398	工商银行	3,917,731.00	2.92
17	600600	青岛啤酒	3,906,430.00	2.92
18	600016	民生银行	3,802,779.00	2.84
19	600026	中远海能	3,602,504.00	2.69
20	000001	平安银行	3,587,929.00	2.68
21	601668	中国建筑	3,394,451.00	2.53
22	600048	保利地产	3,219,580.00	2.40
23	000625	长安汽车	2,843,282.00	2.12
24	600660	福耀玻璃	2,766,527.54	2.06

25	600104	上汽集团	2,715,905.00	2.03

注：1、卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	343,508,658.85
卖出股票收入（成交）总额	247,283,922.86

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票，卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、"买入股票成本（成交）总额"、"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 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	330,007.69
2	应收证券清算款	4,139,338.51
3	应收股利	-
4	应收利息	3,851.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,473,197.31

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 投资组合报告（转型前）

8.1 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	4,420,441.00	38.26
	其中：股票	4,420,441.00	38.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,999.96	0.02
	其中：债券	1,999.96	0.02
	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	6,000,000.00	51.93
	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	427,595.22	3.70
8	其他各项资产	704,815.22	6.10
9	合计	11,554,851.40	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,932,569.00	26.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	306,500.00	2.78
F	批发和零售业	3,200.00	0.03

G	交通运输、仓储和邮政业	1,302.00	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	706,800.00	6.40
J	金融业	460,050.00	4.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,020.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,420,441.00	40.04

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	600031	三一重工	40,000	470,400.00	4.26
2	601128	常熟银行	49,000	409,150.00	3.71
3	601138	工业富联	25,000	404,500.00	3.66
4	002376	新北洋	20,000	393,600.00	3.57
5	300529	健帆生物	6,000	327,000.00	2.96
6	002202	金风科技	20,000	312,000.00	2.83

7	601668	中国建筑	50,000	306,500.00	2.78
8	600050	中国联通	40,000	300,000.00	2.72
9	603486	科沃斯	5,000	298,300.00	2.70
10	300724	捷佳伟创	7,000	261,870.00	2.37
11	300170	汉得信息	10,000	207,900.00	1.88
12	300017	网宿科技	13,000	198,900.00	1.80
13	300122	智飞生物	3,000	140,370.00	1.27
14	603515	欧普照明	2,500	82,850.00	0.75
15	600519	贵州茅台	100	74,501.00	0.67
16	601012	隆基股份	2,000	55,640.00	0.50
17	002241	歌尔股份	5,000	54,050.00	0.49
18	601860	紫金银行	5,000	50,900.00	0.46
19	600487	亨通光电	500	11,545.00	0.10
20	300070	碧水源	1,000	10,020.00	0.09
21	603801	志邦家居	300	8,751.00	0.08
22	002841	视源股份	100	7,720.00	0.07
23	002466	天齐锂业	200	7,348.00	0.07
24	300577	开润股份	200	6,640.00	0.06
25	300203	聚光科技	200	5,942.00	0.05
26	002867	周大生	100	3,200.00	0.03
27	300296	利亚德	300	2,832.00	0.03
28	600426	华鲁恒升	200	2,800.00	0.03
29	002078	太阳纸业	200	1,428.00	0.01
30	601231	环旭电子	100	1,395.00	0.01
31	603885	吉祥航空	100	1,302.00	0.01
32	002020	京新药业	100	1,087.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002376	新北洋	926,665.00	8.73
2	601939	建设银行	863,540.00	8.13
3	603885	吉祥航空	778,160.00	7.33
4	603568	伟明环保	688,410.00	6.48
5	600050	中国联通	636,400.00	5.99
6	300529	健帆生物	594,041.00	5.59
7	601128	常熟银行	579,401.66	5.46
8	601231	环旭电子	499,498.00	4.70
9	601318	中国平安	415,240.00	3.91
10	601668	中国建筑	413,350.00	3.89
11	601138	工业富联	404,100.00	3.81
12	600031	三一重工	404,100.00	3.81
13	600487	亨通光电	378,540.00	3.56
14	300308	中际旭创	342,468.00	3.23
15	002020	京新药业	322,012.00	3.03
16	002202	金风科技	305,353.00	2.88
17	603486	科沃斯	291,453.00	2.74
18	600276	恒瑞医药	288,580.00	2.72
19	600600	青岛啤酒	288,285.00	2.71
20	603899	晨光文具	279,420.00	2.63
21	601233	桐昆股份	259,980.00	2.45
22	600516	方大炭素	257,006.00	2.42
23	300724	捷佳伟创	252,644.00	2.38
24	603306	华懋科技	248,824.00	2.34
25	601100	恒立液压	232,431.36	2.19
26	300203	聚光科技	230,970.00	2.18
27	600570	恒生电子	216,055.00	2.03

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计买入金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	846,240.00	7.97
2	603885	吉祥航空	789,168.60	7.43
3	603568	伟明环保	720,216.00	6.78
4	002376	新北洋	546,964.00	5.15
5	601231	环旭电子	501,367.00	4.72
6	601318	中国平安	427,290.00	4.02
7	600487	亨通光电	381,237.00	3.59
8	300308	中际旭创	356,933.00	3.36
9	600050	中国联通	338,800.00	3.19
10	002020	京新药业	316,695.00	2.98
11	600600	青岛啤酒	289,683.00	2.73
12	300529	健帆生物	289,420.00	2.73
13	600276	恒瑞医药	281,400.00	2.65
14	603899	晨光文具	277,860.00	2.62
15	601233	桐昆股份	266,020.00	2.51
16	600516	方大炭素	262,643.00	2.47
17	603306	华懋科技	255,084.00	2.40
18	601128	常熟银行	246,950.00	2.33
19	300203	聚光科技	233,920.00	2.20
20	601100	恒立液压	231,943.16	2.18
21	300070	碧水源	228,040.00	2.15
22	600570	恒生电子	216,019.00	2.03

注：1、卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,522,328.02
卖出股票收入（成交）总额	13,029,978.11

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票，卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、"买入股票成本（成交）总额"、"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	1,999.96	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,999.96	0.02

8.6 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	113021	中信转债	20	1,999.96	0.02

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 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	62,766.98
2	应收证券清算款	637,811.16

3	应收股利	-
4	应收利息	4,237.08
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	704,815.22

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 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
嘉合睿金混合A	12	881,424.31	10,452,941.18	98.83%	124,150.56	1.17%
嘉合睿金混合C	99	1,085,425.15	3,951,690.18	3.68%	103,505,400.08	96.32%
合计	111	1,063,371.01	14,404,631.36	12.20%	103,629,550.64	87.80%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	嘉合睿金混合A	10.06	0.00%
	嘉合睿金混合C	1,533.62	0.00%
	合计	1,543.68	0.00%

9.3 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

本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金。

9.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	10,452,941.18	8.86%	10,447,761.18	8.85%	自基金合同生效之日起不少于3年
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,452,941.18	8.86%	10,447,761.18	8.85%	-

§9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 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
嘉合睿金混合A	3	3,484,313.73	10,452,941.18	100.00%	0.00	0.00%
嘉合睿金混合C	1	508,336.72	508,336.72	100.00%	0.00	0.00%
合计	4	2,740,319.48	10,961,277.90	100.00%	0.00	0.00%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本基金本报告期末，本基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.3 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

本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金的基金经理未持有本基金。

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-

基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	10,452,941.18	95.36%	10,447,761.18	95.32%	自基金合同生效之日起不少于3年
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,452,941.18	95.36%	10,447,761.18	95.32%	-

§10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
基金合同生效日(2019年03月13日)基金份额总额	10,452,941.18	508,336.72
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,922,584.96	222,753,173.45
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,798,434.40	115,804,419.91
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,577,091.74	107,457,090.26

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
基金合同生效日(2018年03月21日)基金份额总额	10,452,941.18	125,222,024.00
本报告期期初基金份额总额	10,452,941.18	508,336.72
本报告期基金总申购份额	-	-

减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,452,941.18	508,336.72

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，原嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金于2019年1月9日至2019年2月11日以通讯方式召开了基金份额持有人大会。依据此次基金持有人大会决议，本基金《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》自2019年3月13日起生效，本基金由嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金转型为嘉合睿金混合型发起式证券投资基金。

11.2 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

本基金管理人在本报告期内无重大人事变动情况。

自2019年12月12日起，赵亚萍女士不再担任渤海银行股份有限公司托管业务部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

转型后

报告期2019年03月13日 - 2019年12月31日

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
华西证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	215,266,705.78	36.74%	135,146.93	34.07%	-
国泰君安	2	97,037,727.35	16.56%	70,426.44	17.75%	-
海通证券	2	161,933,467.98	27.64%	117,765.81	29.68%	-
申万宏源	2	79,676,322.46	13.60%	50,068.84	12.62%	-
兴业证券	2	32,040,641.43	5.46%	23,311.32	5.88%	-

注：1、本基金本报告期内退租兴业证券两个、新增华西证券一个交易单元。

2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	337,600,000.00	36.48%	-	-	-	-

国泰君安	-	-	294,000,000.00	31.77%	-	-	-	-
海通证券	-	-	235,000,000.00	25.39%	-	-	-	-
申万宏源	2,160.00	100.00%	40,900,000.00	4.42%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	18,000,000.00	1.94%	-	-	-	-

转型前

报告期2019年01月01日 - 2019年03月12日

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
广发证券	2	11,182,945.18	37.84%	6,981.30	34.43%	-
国泰君安	2	8,161,616.60	27.62%	5,922.48	29.21%	-
海通证券	2	6,572,276.35	22.24%	4,737.42	23.37%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	3,635,468.00	12.30%	2,633.83	12.99%	-

注：1、本基金本报告期内退租中信证券两个交易单元。

2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

11.7.2 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	-	-	30,800,000.00	20.51%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	13,800,000.00	9.19%	-	-	-	-
海通证券	-	-	68,600,000.00	45.67%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	37,000,000.00	24.63%	-	-	-	-

11.8 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	嘉合基金管理有限公司旗下基金2018年年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-01-02
2	关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券时报》、基金管理人网站	2019-01-05
3	关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站	2019-01-07
4	关于以通讯方式召开嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券时报》、基金管理人网站	2019-01-08
5	嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金	《证券日报》、基金管理人网站	2019-01-21

	2018年第四季度报告		
6	关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告-0212定稿	《证券日报》、基金管理人网站	2019-02-13
7	关于嘉合睿金混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-03-13
8	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书	《证券日报》、基金管理人网站	2019-03-13
9	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同	《证券日报》、基金管理人网站	2019-03-13
10	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金托管协议	《证券日报》、基金管理人网站	2019-03-13
11	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国融证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-03-15
12	嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年年度报告	基金管理人网站	2019-03-26
13	嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	《证券日报》、基金管理人网站	2019-03-26
14	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加恒泰证券为销售机构的公告	《上海证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-01
15	嘉合基金管理有限公司关于嘉合睿金混合型发起式证券投资基金增加银河证券为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-16

16	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华安证券为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-17
17	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金参加植信基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-19
18	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联储证券为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-19
19	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2019年第一季度报告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-20
20	嘉合基金管理有限公司关于嘉合睿金混合型发起式证券投资基金增加国泰君安为销售机构的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-04-26
21	嘉合基金管理有限公司关于直销交易平台开展费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-06-10
22	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-06-17
23	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国盛证券为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-06-19
24	嘉合基金管理有限公司关于开展旗下部分基金直销柜台费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-06-28
25	嘉合基金管理有限公司关于	《上海证券报》、《中国证	2019-07-01

	直销交易平台开展基金转换申购补差费率优惠活动的公告	券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	
26	嘉合基金管理有限公司旗下基金2019年6月30日 基金资产净值和基金份额净值公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-01
27	关于嘉合睿金混合型发起式证券投资基金暂停申购、转换转入及定投业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-02
28	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2019年度第一次分红公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-04
29	关于嘉合睿金混合型发起式证券投资基金恢复申购、转换转入及定投业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-11
30	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2019年第二季度报告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-17
31	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加增财基金为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-22
32	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板投资及相关风险提示的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-24
33	嘉合基金管理有限公司关于公司股权变更的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-07-31
34	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国信嘉利为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-08-21
35	嘉合基金管理有限公司关于	《上海证券报》、《中国证	2019-08-21

	旗下部分基金增加汇林保大为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	
36	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加九江银行为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-08-21
37	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告	基金管理人网站	2019-08-29
38	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2019年半年度报告摘要	《证券日报》、基金管理人网站	2019-08-29
39	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加浦领基金为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、公司网站	2019-08-30
40	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金暂停大额申购（转换转入、定期定额投资）的公告	《证券日报》、基金管理人网站	2019-09-10
41	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2019年第三季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2019-10-22
42	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2019年第三季度报告	基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-10-22
43	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2019年第1号）	基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-10-25
44	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同	基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-10-25
45	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金托管协议	基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-10-25

46	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2019年第1号）	基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-10-25
47	嘉合基金管理有限公司关于嘉合睿金混合型发起式证券投资基金修改基金合同及托管协议的公告	《证券日报》、基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-10-25
48	关于恢复嘉合睿金混合型发起式证券投资基金大额申购、转换转入及定投业务的公告	《证券日报》、基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-11-13
49	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、公募基金信息披露网站	2019-11-18

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20190101-20190909	3,484,197.06	0.00	0.00	3,484,197.06	2.95%
	2	20190101-20190909	3,484,547.06	0.00	0.00	3,484,547.06	2.95%
	3	20190101-201	3,484,197.06	0.00	0.00	3,484,197.06	2.95%

		90909					
	4	20190909	0.00	2,761,494.17	2,761,494.17	0.00	0.00%
	5	20190910-20191126	0.00	55,386,319.58	55,386,319.58	0.00	0.00%
个人	1	20191127-20191231	-	45,479,476.69	0.00	45,479,476.69	38.53%
	2	20190910-20191126	-	55,386,319.58	55,386,319.58	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

一、中国证监会准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

二、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

三、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

四、中国证监会准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更注册的文件

五、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》

六、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金托管协议》

七、相关法律意见书

八、基金管理人业务资格批件和营业执照

九、基金托管人业务资格批件和营业执照

十、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（www.haoamc.com）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司

二〇二〇年四月二十八日