

嘉实致华纯债债券型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 22 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 2021 年 07 月 01 日起至 2021 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 嘉实致华纯债债券 |
| 基金主代码 | 007716 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 11 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 869,708,743.78 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 | <p>（一）债券投资策略</p> <p>本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。具体包括：利率策略、信用债券投资策略（个别债券选择、行业配置、信用风险控制措施）、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略。</p> <p>（二）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率 |
| 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 | 华夏银行股份有限公司 |

§ 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 6,527,587.80 |
| 2. 本期利润 | 4,941,728.73 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0067 |
| 4. 期末基金资产净值 | 863,849,018.07 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9933 |

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

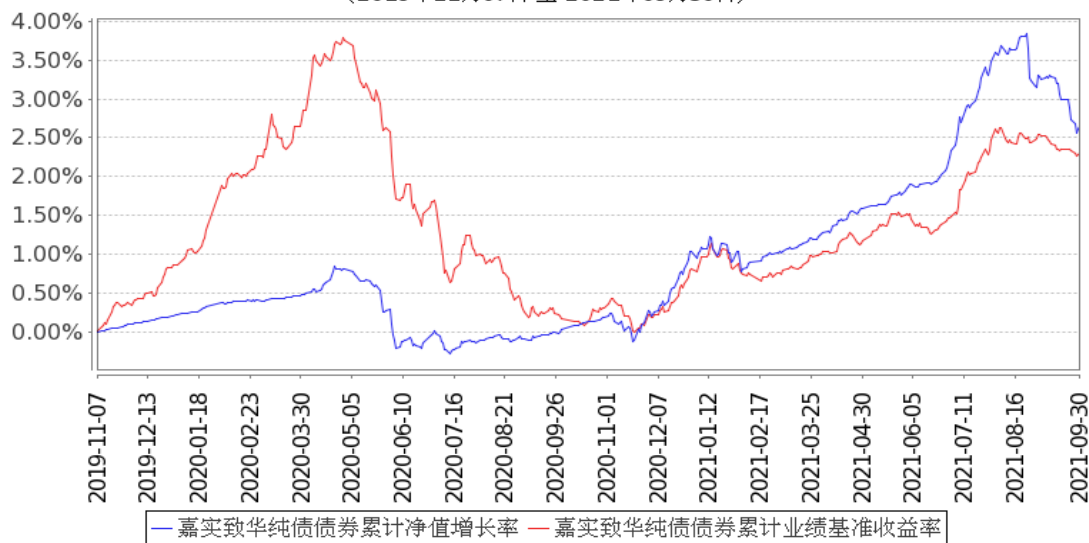
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.46% | 0.09% | 0.83% | 0.06% | -0.37% | 0.03% |
| 过去六个月 | 1.39% | 0.06% | 1.28% | 0.05% | 0.11% | 0.01% |
| 过去一年 | 2.62% | 0.06% | 2.13% | 0.04% | 0.49% | 0.02% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.65% | 0.05% | 2.30% | 0.07% | 0.35% | -0.02% |

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

嘉实致华纯债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年11月07日至2021年09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 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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 | | |
| 王立芹 | 本基金、嘉实信用债券、嘉实如意宝定期债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实致盈债 | 2020年10月22日 | - | 13年 | 曾任中诚信国际信用评级有限公司信用评级一部总经理、民生加银基金管理有限公司信用研究总监、中欧基金管理有限公司债券投资经理。2020年8月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固收投研体系。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| 券、嘉实致享纯债债券、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实致泓一年定期纯债债券基金经理 | | | | |
|--|--|--|--|--|

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实致华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 1 次，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

与二季度相比，经济基本面在三季度出现了较为明显的下行势头，主要原因：一是短期的疫情和多地区洪涝影响，拖累消费增速大幅下滑，缺芯等问题也拖累汽车消费；二是受限购和贷款政策严格影响，地产销售大幅放缓，同时对新开工、资金来源形成拖累，个别房企风险暴露加大，对房地产行业融资进一步形成打击；三是 PMI 新出口订单连续下行，出口对经济的拉动力量也开始减弱；四是 9 月以来能耗双控对生产端也形成显著拖累。另一方面，8 月中旬开始，在能耗双控的政策影响下，大宗商品涨价卷土重来，以煤炭为主的上游原材料价格暴涨，并对中下游企业利润空间形成挤压。整体来看，经济逐渐确立了“滞胀”格局。

随着三季度经济下行压力加大，央行货币政策边际上有所变松，7 月初超预期全面降准支持中小微企业，并对经济潜在的下行压力进行对冲。7 月末召开政治局会议，要求做好宏观政策跨周期调节，整体来看政策基调是较为稳健的。

债券市场，7 月份降准带动收益率快速下行 25bp-30bp，且短端下行幅度更大，收益率曲线呈现陡峭变化。9 月开始，大宗商品价格快速上涨，PPI 单月破 10%，同时地方债供给压力逐渐加大，资金面波动加大，且前期因债券市场对经济下行和货币宽松交易较为充分，因此利率在 9 月以来反弹，长端利率震荡上行 3-5bp 左右。

组合操作方面，组合采取中性杠杆和久期策略，投资利率债和高等级优质信用债，并根据市场环境进行波段交易。

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 0.9933 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.46%，业绩比较基准收益率为 0.83%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形；存在连续 60 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形，时间范围为 2021-07-01 至 2021-08-30。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报

告并提出解决方案。

§ 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 | 648,300,800.00 | 70.60 |
| | 其中：债券 | 648,300,800.00 | 70.60 |
| | 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 | 110,000,405.00 | 11.98 |
| | 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 | 20,528,907.87 | 2.24 |
| 8 | 其他资产 | 139,475,598.51 | 15.19 |
| 9 | 合计 | 918,305,711.38 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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

无。

5.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

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 | 1,000,800.00 | 0.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 647,300,000.00 | 74.93 |
| | 其中：政策性金融债 | 110,311,000.00 | 12.77 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 648,300,800.00 | 75.05 |

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 | 2028042 | 20 兴业银行 永续债 | 500,000 | 51,795,000.00 | 6.00 |
| 2 | 2028051 | 20 浦发银行 永续债 | 500,000 | 51,780,000.00 | 5.99 |
| 3 | 2028037 | 20 光大银行 永续债 | 500,000 | 51,120,000.00 | 5.92 |
| 4 | 2128011 | 21 邮储银行 永续债 01 | 500,000 | 51,080,000.00 | 5.91 |
| 5 | 2128019 | 21 中国银行 永续债 01 | 500,000 | 50,315,000.00 | 5.82 |

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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

(1) 2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】67 号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规事实，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 4880 万元。

2021 年 7 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2021】31 号），对中国进出口银行违规投资企业股权、个别高管人员未经核准实际履职、监管数据漏报错报等违法违规事实，于 2021 年 7 月 23 日作出行政处罚决定，罚款 7345.6 万元。

2021 年 4 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局发布行政处罚信息公开表（沪银保监罚决字（2021）29 号），对上海浦东发展银行股份有限公司 2016 年 5 月至 2019 年 1 月未按规定开展代销业务的违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中国银监会关于规范商业银行代理销售业务的通知》（银监发〔2016〕24 号）（三十九），于 2021 年 4 月 23 日作出行政处罚决定，责令改正并处罚款共计 760 万元。2021 年 7 月 16 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）27 号），对上海浦东发展银行股份有限公司监管发现的问题屡查屡犯、配合现场检查不力、内部控制制度修订不及时、信息系统管控有效性不足等违规行为，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2021 年 7 月 13 日作出行政处罚决定，罚款 6920 万元。

2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）71 号），对中国工商银行股份有限公司未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞、为同业投资业务提供隐性担保等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十三条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 5470 万元。

2021 年 8 月 20 日，中国人民银行银罚字（2021）26 号对兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日作出行政处罚决定，罚款合计 5 万

元。

2020 年 12 月 5 日, 中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2020)60 号), 对中国银行股份有限公司对中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括产品管理不规范、风险管理不审慎、内控管理不健全、销售管理不合规等, 因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 于 2020 年 12 月 1 日作出行政处罚决定, 罚款合计 5050 万元。2021 年 5 月 21 日, 中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2021)11 号), 对中国银行股份有限公司关于向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、存款月末冲时点、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足、与名单外交易对手开展同业业务等违法违规事实, 因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条, 《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条和相关审慎经营规则, 于 2021 年 5 月 17 日做出行政处罚决定, 罚款共计 8761.355 万元。

2021 年 2 月 5 日, 中国人民银行银罚字(2021)1 号对中信银行股份有限公司因未按规定履行客户身份识别义务、未按规定保存客户身份资料和交易记录、未按规定报送大额交易报告和可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易等违法违规行为, 于 2021 年 2 月 5 日作出行政处罚决定, 罚款合计 2890 万元。2021 年 3 月 19 日, 中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2021)5 号)对中信银行股份有限公司因对客户信息保护体制机制不健全、客户信息收集环节管理不规范、对客户敏感信息管理不善, 致其流出至互联网、系统权限管理存在漏洞, 重要岗位及外包机构管理存在缺陷等违法违规行为, 因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则, 《中华人民共和国商业银行法》第七十三条, 于 2021 年 3 月 17 日作出行政处罚决定, 罚款合计 450 万元。

2021 年 7 月 16 日, 中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2021)28 号), 对交通银行股份有限公司理财业务和同业业务制度不健全等违法违规事实, 于 2021 年 7 月 13 日作出行政处罚决定, 罚款 4100 万元。

2021 年 1 月 8 日, 中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表(银保监罚决字(2020)72 号)对中国邮政储蓄银行股份有限公司因同业投资业务接受第三方金融机构信用担保、买入返售项下的金融资产不符合监管规定、信贷资产收益权转让业务接受交易对手兜底承诺、同业投资投前调查不尽职、理财投资收益未及时确认为收入、投资权益类资产的理财产品违规面向一般个人客户销售、理财风险准备金用于期限错配引发的应收未收利息垫款、未在理财产品存续期内披露非标资产风险状况发生实质性变化的信息、债券承销与投资业务未建立“防火墙”制度等违法违规行为, 因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条, 《中华人民共

和国商业银行法》第四十三条、第五十五条、第七十四条和相关审慎经营规则，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款合计 4550 元。2021 年 7 月 5 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）23 号）对中国邮政储蓄银行股份有限公司违规向部分客户收取唯一账户年费和小额账户管理费、向监管机构报送材料内容不实、未按监管要求提供保存业务办理相关凭证等违法违规行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条、第四十七条和相关审慎经营规则《中华人民共和国商业银行法》第七十三条，于 2021 年 6 月 22 日作出行政处罚决定，没收违法所得 11.401116 万元，罚款 437.677425 万元，罚没合计 449.078541 万元。

本基金投资于“21 国开 11(210211)”、“21 进出 05(210305)”、“20 浦发银行永续债(2028051)”、“21 工商银行永续债 01 (2128021)”、“20 兴业银行永续债 (2028042)”、“21 中国银行永续债 01 (2128019)”、“21 中信银行永续债 (2128017)”、“21 交通银行永续债 (2128022)”、“21 邮储银行永续债 01 (2128011)”的决策程序说明：基于对 21 国开 11、21 进出 05、20 浦发银行永续债、21 工商银行永续债 01、20 兴业银行永续债、21 中国银行永续债 01、21 中信银行永续债、21 交通银行永续债、21 邮储银行永续债 01 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“21 国开 11”、“21 进出 05”、“20 浦发银行永续债”、“21 工商银行永续债 01”、“20 兴业银行永续债”、“21 中国银行永续债 01”、“21 中信银行永续债”、“21 交通银行永续债”、“21 邮储银行永续债 01”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他一名证券发行主体无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。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.10.3 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 | 9,481,578.52 |
| 5 | 应收申购款 | 129,994,019.99 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 139,475,598.51 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 797,195,398.13 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 271,797,428.25 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 199,284,082.60 |
| 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 | 869,708,743.78 |

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 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 | 2021/07/01 至 2021/09/30 | 398,597,200.25 | - | - | 398,597,200.25 | 45.83 |

| | | | | | |
|--|-------------------------------|----------------|---|-----------------|-------|
| 2 | 2021/07/01 至 2021/09/30 | 199,282,582.70 | - | -199,282,582.70 | 22.91 |
| 3 | 2021/07/01 至 2021/08/26 | 199,281,068.46 | - | -199,281,068.46 | - |
| 产品特有风险 | | | | | |
| <p>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。</p> <p>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。</p> | | | | | |

§ 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致华纯债债券型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实致华纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实致华纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实致华纯债债券型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实致华纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

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 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日