

嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金  
金  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：宁波银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人宁波银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	42
7.7 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 .....	42
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	42
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.11 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	45
10.4 基金投资策略的改变 .....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	46
10.8 其他重大事件 .....	47
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>47</b>
11.1 备查文件目录 .....	47
11.2 存放地点 .....	47
11.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实 90 天滚动持有短债	
基金主代码	015404	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 6 月 17 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	501,039,904.50 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实 90 天滚动持有短债 A	嘉实 90 天滚动持有短债 C
下属分级基金的交易代码	015404	015405
报告期末下属分级基金的份额总额	281,287,744.80 份	219,752,159.70 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，重点投资短债主题证券，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>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，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，力争获取较高的投资收益。包括：利率策略、信用债券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略。</p> <p>本基金其他策略包括：资产支持证券投资策略、国债期货投资策略、信用衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	中债综合财富(1年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
		朱广科
		0574-87050338
		custody-audit@nbc.cn

客户服务电话	400-600-8800	0574-83895886
传真	(010)65215588	0574-89103213
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址	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	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码	100020	315100
法定代表人	经雷	陆华裕

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	嘉实 90 天滚动持有短债 A	嘉实 90 天滚动持有短债 C
本期已实现收益	2,537,915.07	1,879,284.24
本期利润	2,649,204.05	1,850,381.59
加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0214
本期加权平均净值利润率	2.29%	2.08%
本期基金份额净值增长率	2.35%	2.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	10,437,764.62	7,745,649.04

润		
期末可供分配基金份额利润	0.0371	0.0352
期末基金资产净值	292,311,226.77	227,954,969.20
期末基金份额净值	1.0392	1.0373
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	3.92%	3.73%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2) 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实 90 天滚动持有短债 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.28%	0.03%	0.18%	0.01%	0.10%	0.02%
过去三个月	1.35%	0.03%	0.67%	0.01%	0.68%	0.02%
过去六个月	2.35%	0.02%	1.31%	0.01%	1.04%	0.01%
过去一年	3.83%	0.02%	2.22%	0.01%	1.61%	0.01%
自基金合同生效起至今	3.92%	0.02%	2.31%	0.01%	1.61%	0.01%

嘉实 90 天滚动持有短债 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.26%	0.03%	0.18%	0.01%	0.08%	0.02%
过去三个月	1.29%	0.03%	0.67%	0.01%	0.62%	0.02%
过去六个月	2.24%	0.02%	1.31%	0.01%	0.93%	0.01%

过去一年	3.65%	0.02%	2.22%	0.01%	1.43%	0.01%
自基金合同生效起 至今	3.73%	0.02%	2.31%	0.01%	1.42%	0.01%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = (\text{中债综合财富（1 年以下）指数}(t) / \text{中债综合财富（1 年以下）指数}(t-1) - 1) \times 80\% + ((1 + \text{一年期定期存款利率（税后）})^{(1/365)} - 1) \times 20\%$$

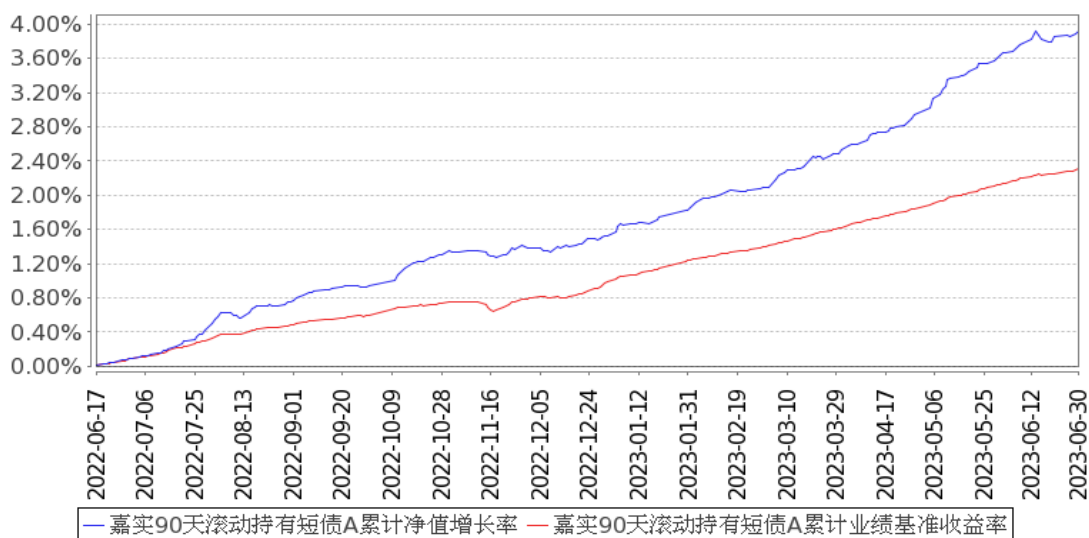
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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

#### 嘉实 90 天滚动持有短债 A 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

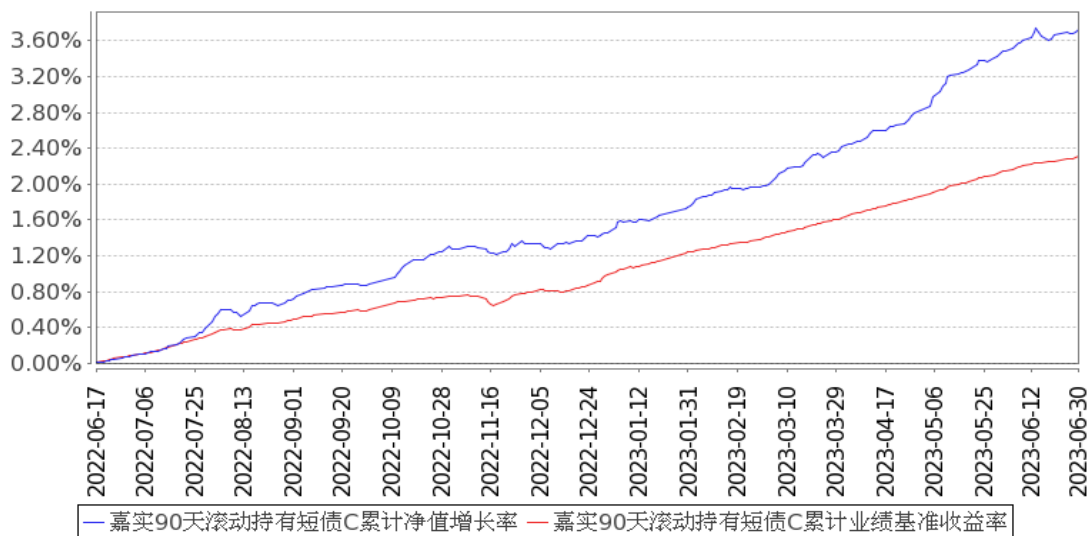
（2022 年 06 月 17 日至 2023 年 06 月 30 日）





### 嘉实90天滚动持有短债C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

(2022年06月17日至2023年06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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2023年6月30日，基金管理人共管理314只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李瞳	本基金、嘉实活钱	2022年6月17日	-	13年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014年12月加入嘉实基金

	包货币、嘉实现金添利货币、嘉实6个月理财债券、嘉实60天滚动持有短债、嘉实短债债券、嘉实30天持有期中短债债券基金经理				管理有限公司，现任固收投研体系策略投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
--	---	--	--	--	--

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行业协会相关规定。

#### 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 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 6 次，均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 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

23 年上半年全球经济景气持续面临压力，瑞信风险事件、地缘冲突等因素使得经济环境更加复杂。今年以来全球主要经济体多数经济增速放缓，同时区域之间不断分化。23 年一季度，美国 GDP 增速 2.0%，较 22 年四季度的 2.6%有所弱化；6 月失业率 3.6%，较去年峰值 4.0%有所下降。欧元区 GDP 同比 1.3%，基本持平于 22 年四季度的 1.4%。日本 GDP 增速 2.7%，强于 22 年四季度的 0.4%；主要经济体制造业景气表现较弱，6 月美国制造业 PMI 46.0、欧元区制造业 PMI 43.4、日本制造业 PMI 49.8，均处于荣枯线以下。而在经济增速放缓和货币政策偏紧的背景下，通胀压力有所缓解。截至 23 年 6 月末 CRB 商品指数较年初走低 3%，6 月美国 CPI 同比增长 3.0%、欧元区 HICP 同比增长 5.5%，增速较 22 年走低。

一定程度上受基数因素影响上半年国内经济同比增速表现不弱，但可以关注到需求景气面临压力。23 年上半年 GDP 同比增长 5.5%，其中二季度同比增长 6.3%、一季度同比增长 4.5%。国际贸易表现较去年明显偏弱，上半年出口总额同比-3.2%、进口总额同比-6.7%，共录得贸易顺差 4086.9 亿美元。地产开发商信用风险、居民收入预期不稳等多重因素影响下地产行业景气继续面临下行压力，上半年地产销售同比 1.1%、地产投资完成额同比-7.9%。疫情管控放松后居民经济活动明显恢复、消费领域表现较好，上半年社会商品零售总额同比 8.2%。制造业投资表现则边际弱化，上半年制造业固定资产投资同比 6.0%，弱于 22 年整体表现。基建项目对经济形成一定支撑，上半年基建固定资产投资同比 10.7%，略弱于 22 年全年的 11.5%增长水平。通胀压力明显弱化，上半年 CPI 增长 0.7%、PPI 下降 3.1%。在经济景气分化、地缘政治冲突等因素影响下，人民币面临一定贬值压力，美元对人民币汇率上半年最多跌至 7.26。财政政策仍然保持相当定力，23 年上半年财政支出同比 3.9%，弱于 22 年全年的 6.1%增长水平。货币政策维持整体偏松状态，人民银行 3 月降低金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，6 月下调 7 天逆回购利率、常备借贷便利利率 10BP。资金价格呈现区间震荡状态，DR007 月度均值由 23 年 1 月的 1.91%小幅下降至 6 月的 1.89%。1 年期限同业存单收益率有所下行，收益率由 3 月的最高 2.75%下降至 6 月末的 2.31%。二季度以来市场形成了较强的弱经济预期，长端利率趋势性下行，10 年期限国开收益率 6 月末 2.77%，低于年初的 2.97%水平。

23 年上半年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券、同业存单和同业存款等多类资产，管理现金流分布，保障组合充足流动性。整体看，23 年上半年本基金成功应对了市场波动，投资业绩平稳提高，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、

创造安全收益打下了良好基础。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实 90 天滚动持有短债 A 基金份额净值为 1.0392 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.35%；截至本报告期末嘉实 90 天滚动持有短债 C 基金份额净值为 1.0373 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.24%；业绩比较基准收益率为 1.31%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，国内经济形势仍然面临比较大的不确定性。预计对外贸易表现难有起色，对于制造业整体景气形成持续压力。而居民部门将保持良好的经济活跃度，社会零售表现仍有支撑。7 月政治局会议对于当前经济状态进行了界定，会议内容体现较强稳定经济的政策态度。重点关注未来房地产行业需求端的政策变化，观察增量政策内容能否扭转居民预期，缓解地产销售的下行局面。基建仍然保持一定力度，以对冲经济下行压力。主要受到经济需求不振的影响预计通胀仍将维持在较低水平，短期内不构成采取积极政策举措的制约。阶段性我国经济内生增长动力仍然较为疲弱，货币政策难以趋势性收紧。7 月以来市场流动性仍然较为宽松，DR007 价格进一步下行至 1.79%附近水平。如若宽信用政策不断落地，实体经济部门融资需求相应恢复，将会造成流动性的自然消耗，预计资金价格和短端资产收益率将会有所调整。另外需要密切关注汇率波动状况，以及由此对于境内流动性环境的影响。

本基金将坚持一贯以来的谨慎操作风格，强化投资风险控制，以确保组合安全性和流动性为首要任务，兼顾收益性。密切关注各项宏观数据、政策调整和市场资金面情况，平衡配置同业存款和债券投资，谨慎控制组合的信用配置，保持合理流动性资产配置，细致管理现金流，以控制利率风险和应对组合规模波动，努力为投资人创造安全稳定的收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对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，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	265,690.36	4,947,014.47
结算备付金		3,749,037.81	-
存出保证金		192,811.00	-

交易性金融资产	6.4.7.2	710,550,243.39	108,271,221.23
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		710,550,243.39	108,271,221.23
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		3,421,607.58	93,831.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		718,179,390.14	113,312,067.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		197,578,215.59	17,302,920.45
应付清算款		-	-
应付赎回款		25.33	-
应付管理人报酬		62,877.61	26,229.17
应付托管费		15,719.41	6,557.27
应付销售服务费		31,466.35	206.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		19,860.98	5,374.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	205,028.90	176,462.59
负债合计		197,913,194.17	17,517,750.70
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	501,039,904.50	94,351,387.65
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,226,291.47	1,442,928.66
净资产合计		520,266,195.97	95,794,316.31

负债和净资产总计		718,179,390.14	113,312,067.01
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，嘉实 90 天滚动持有短债 A 基金份额净值 1.0392 元，基金份额总额 281,287,744.80 份，嘉实 90 天滚动持有短债 C 基金份额净值 1.0373 元，基金份额总额 219,752,159.70 份，基金份额总额合计为 501,039,904.50 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 17 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		5,596,928.50	197,474.42
1. 利息收入		5,709.14	197,474.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,709.14	185,280.04
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	12,194.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		5,508,833.03	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	5,518,804.33	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-9,971.30	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.20	82,386.33	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	6.4.7.21	-	-

号填列)			
<b>减：二、营业总支出</b>		1,097,342.86	21,639.74
1. 管理人报酬		201,244.06	14,391.84
2. 托管费		50,310.98	3,597.96
3. 销售服务费		94,637.55	114.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		641,541.44	-
其中：卖出回购金融资产支出		641,541.44	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		6,706.27	-
8. 其他费用	6.4.7.23	102,902.56	3,535.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,499,585.64	175,834.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,499,585.64	175,834.68
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		4,499,585.64	175,834.68

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	94,351,387.65	-	1,442,928.66	95,794,316.31
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	94,351,387.65	-	1,442,928.66	95,794,316.31



三、本期 增减变 动额(减 少以“-” 号填列)	406,688,516.85	-	17,783,362.81	424,471,879.66
(一)、 综合收 益总额	-	-	4,499,585.64	4,499,585.64
(二)、 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)	406,688,516.85	-	13,283,777.17	419,972,294.02
其中:1. 基金申 购款	476,669,901.84	-	15,304,021.94	491,973,923.78
2 .基金赎 回款	-69,981,384.99	-	-2,020,244.77	-72,001,629.76
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基	501,039,904.50	-	19,226,291.47	520,266,195.97

金净值)				
项目	上年度可比期间 2022年6月17日(基金合同生效日)至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	201,951,187.82	-	-	201,951,187.82
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	175,834.68	175,834.68
(一)、综合收益总额	-	-	175,834.68	175,834.68
(二)、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	-	-	-	-

回款				
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综合 收益结转 留存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产(基金净 值)	201,951,187.82	-	175,834.68	202,127,022.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]442 号《关于准予嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于 2022 年 5 月 30 日至 2022 年 6 月 15 日向社会公开募集，基金合同于 2022 年 6 月 17 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 201,951,187.82 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款	265,690.36
等于：本金	265,666.82	
加：应计利息	23.54	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
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	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	265,690.36	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	702,175,994.33	8,245,693.39	710,550,243.39
	合计	702,175,994.33	8,245,693.39	710,550,243.39
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	702,175,994.33	8,245,693.39	710,550,243.39	128,555.67

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-32,394,200.00	-	-	

其中：国债期货投资	-32,394,200.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-32,394,200.00	-	-	-

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
T2309	T2309	-2.00	-2,039,300.00	-9,600.00
TS2309	TS2309	-15.00	-30,405,000.00	-40,500.00
合计				-50,100.00
减：可抵销期货暂收款				-50,100.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	-
应付交易费用	70,726.34
其中：交易所市场	-
银行间市场	70,726.34
应付利息	-
预提费用	134,302.56
合计	205,028.90

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实 90 天滚动持有短债 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,918,430.93	91,918,430.93
本期申购	215,673,673.95	215,673,673.95
本期赎回（以“-”号填列）	-26,304,360.08	-26,304,360.08
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	281,287,744.80	281,287,744.80

## 嘉实 90 天滚动持有短债 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,432,956.72	2,432,956.72
本期申购	260,996,227.89	260,996,227.89
本期赎回（以“-”号填列）	-43,677,024.91	-43,677,024.91
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	219,752,159.70	219,752,159.70

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 嘉实 90 天滚动持有短债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,392,408.25	14,961.88	1,407,370.13
本期利润	2,537,915.07	111,288.98	2,649,204.05
本期基金份额交易产生的变动数	6,507,441.30	459,466.49	6,966,907.79
其中：基金申购款	7,140,963.70	496,484.54	7,637,448.24
基金赎回款	-633,522.40	-37,018.05	-670,540.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,437,764.62	585,717.35	11,023,481.97

## 嘉实 90 天滚动持有短债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	35,162.18	396.35	35,558.53
本期利润	1,879,284.24	-28,902.65	1,850,381.59
本期基金份额交易产生的变动数	5,831,202.62	485,666.76	6,316,869.38
其中：基金申购款	7,090,109.99	576,463.71	7,666,573.70
基金赎回款	-1,258,907.37	-90,796.95	-1,349,704.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,745,649.04	457,160.46	8,202,809.50

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,789.03
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	1,920.11
其他	-
合计	5,709.14

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,262,625.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,256,179.04
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	5,518,804.33

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,395,074,399.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,378,823,708.59
减：应计利息总额	14,910,388.14
减：交易费用	84,123.25
买卖债券差价收入	1,256,179.04

## 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

## 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

## 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-9,971.30

## 6.4.7.19 股利收益

无。

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	132,486.33
股票投资	-
债券投资	132,486.33
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-50,100.00
权证投资	-
期货投资	-50,100.00
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	82,386.33

## 6.4.7.21 其他收入

无。

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	102,902.56

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 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
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
宁波银行股份有限公司(“宁波银行”)	基金托管人
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

##### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 17 日(基金合 同生效日)至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	201,244.06	14,391.84
其中:支付销售机构的客户维护费	62,912.20	463.32

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 6 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	50,310.98	3,597.96

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

## 6.4.10.2.3 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实 90 天滚动持有短 债 A	嘉实 90 天滚动持有短 债 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	347.66	347.66
宁波银行	-	573.07	573.07
嘉实财富	-	4.50	4.50
合计	-	925.23	925.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 6 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实 90 天滚动持有短 债 A	嘉实 90 天滚动持有短 债 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	14.69	14.69
宁波银行	-	24.83	24.83
合计	-	39.52	39.52

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.22%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.22% / 当年天数。

（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

（3）根据《关于嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金销售服务费优惠活动的公告》，自 2022 年 9 月 16 日起至 2022 年 12 月 17 日止，销售服务费年费率由 0.22% 变更为 0.01%。

(4) 根据《关于嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金销售服务费优惠活动的公告》，自 2022 年 12 月 18 日起，销售服务费年费率由 0.01% 变更为 0.22%。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
宁波银行股份有限公司	9,871,536.63	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 6 月 17 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

无。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 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

无。

#### 6.4.10.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 6 月 17 日（基金合同生效日） 至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
宁波银行股份有限公司活期	265,690.36	3,789.03	122,208,467.86	185,279.25

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本期(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 197,578,215.59 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
012381038	23 闽漳龙 SCP001	2023 年 7 月 3 日	101.04	20,000	2,020,872.35
012381989	23 津城建 SCP031	2023 年 7 月 3 日	100.42	50,000	5,021,050.82
012382436	23 海安城建 SCP002	2023 年 7 月 3 日	99.95	50,000	4,997,467.21
042280367	22 皖新华 CP001	2023 年 7 月 3 日	101.75	20,000	2,034,908.93
042380177	23 甘公投 CP002	2023 年 7 月 3 日	102.11	28,000	2,858,954.54
042380232	23 开滦 CP001	2023 年 7 月 3 日	101.11	19,000	1,921,133.61
042380267	23 湘高速 CP002	2023 年 7 月 3 日	100.42	100,000	10,041,672.13
042380273	23 通顺交投 CP001	2023 年 7 月 3 日	100.39	30,000	3,011,636.07
102002250	20 金坛投资 MTN002	2023 年 7 月 3 日	103.64	25,000	2,590,928.77
102100009	21 湖州城投 MTN001	2023 年 7 月 3 日	102.57	100,000	10,256,972.60
102100528	21 柯桥国资	2023 年 7 月 3 日	102.12	10,000	1,021,188.52



	MTN001	日			
102100768	21 广州城投 MTN001	2023 年 7 月 3 日	101.48	100,000	10,148,010.93
102100893	21 华侨城 MTN002A(乡 村振兴)	2023 年 7 月 3 日	101.26	100,000	10,126,196.72
102101393	21 招金 MTN003	2023 年 7 月 3 日	104.05	100,000	10,404,583.56
102101795	21 宝钢 MTN001(可持 续挂钩)	2023 年 7 月 3 日	102.93	10,000	1,029,329.21
102101975	21 南航股 MTN002	2023 年 7 月 3 日	102.95	80,000	8,235,939.07
102102038	21 华侨城 MTN004	2023 年 7 月 3 日	103.37	70,000	7,235,652.99
102103005	21 栖霞建设 MTN002	2023 年 7 月 3 日	104.51	50,000	5,225,424.66
102280107	22 袍江工业 MTN001	2023 年 7 月 3 日	102.50	50,000	5,124,961.64
102280705	22 香城投资 MTN003	2023 年 7 月 3 日	101.35	50,000	5,067,596.17
1928010	19 平安银行 二级	2023 年 7 月 3 日	102.36	73,000	7,472,028.69
2120025	21 杭州银行 小微债 01	2023 年 7 月 3 日	101.67	200,000	20,334,994.54
2128013	21 交通银行 小微债	2023 年 7 月 3 日	101.61	180,000	18,290,567.21
220408	22 农发 08	2023 年 7 月 3 日	101.31	43,000	4,356,400.68
180321	18 进出 21	2023 年 7 月 7 日	104.13	100,000	10,412,671.23
1828013	18 建设银行 二级 02	2023 年 7 月 7 日	103.85	50,000	5,192,691.78
1828015	18 招商银行 二级 01	2023 年 7 月 7 日	103.64	250,000	25,910,739.73
1928010	19 平安银行 二级	2023 年 7 月 7 日	102.36	127,000	12,999,282.79
合计				2,085,000	213,343,857.15

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 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。本基金均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。

本基金在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，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	9,265,682.96
A-1 以下	-	-
未评级	132,264,787.23	32,286,948.34
合计	132,264,787.23	41,552,631.30

注：评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	269,488,240.64	37,943,900.88
AAA 以下	145,661,463.89	19,677,977.43
未评级	65,290,435.24	9,096,711.62
合计	480,440,139.77	66,718,589.93

注：评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	97,845,316.39	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	97,845,316.39	-

注：评级取自第三方评级机构。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人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，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	265,690.36	-	-	-	265,690.36
结算备付金	3,749,037.81	-	-	-	3,749,037.81
存出保证金	-	-	-	192,811.00	192,811.00
交易性金融资产	456,695,535.73	87,498,215.05	166,356,492.61	-	710,550,243.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,421,607.58	3,421,607.58
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	460,710,263.90	87,498,215.05	166,356,492.61	3,614,418.58	718,179,390.14
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	197,578,215.59	-	-	-	197,578,215.59
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	25.33	25.33
应付管理人报酬	-	-	-	62,877.61	62,877.61
应付托管费	-	-	-	15,719.41	15,719.41
应付销售服务费	-	-	-	31,466.35	31,466.35
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	19,860.98	19,860.98
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	205,028.90	205,028.90
负债总计	197,578,215.59	-	-	334,978.58	197,913,194.17
利率敏感度缺口	263,132,048.31	87,498,215.05	166,356,492.61	3,279,440.00	520,266,195.97
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
银行存款	4,947,014.47	-	-	-	4,947,014.47
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	82,654,946.92	12,136,937.59	13,479,336.72	-	108,271,221.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	93,831.31	93,831.31
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	87,601,961.39	12,136,937.59	13,479,336.72	93,831.31	113,312,067.01
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	17,302,920.45	-	-	-	17,302,920.45
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	26,229.17	26,229.17
应付托管费	-	-	-	6,557.27	6,557.27
应付销售服务费	-	-	-	206.82	206.82
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,374.40	5,374.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	176,462.59	176,462.59
负债总计	17,302,920.45	-	-	214,830.25	17,517,750.70
利率敏感度缺口	70,299,040.94	12,136,937.59	13,479,336.72	-120,998.94	95,794,316.31

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,437,969.37	-134,725.63
	市场利率下降 25 个基点	1,444,854.39	135,417.99

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币	-	-

	升值 5%		
	所有外币相对人民币		
	贬值 5%		

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 5%	-	-
	业绩比较基准下降 5%	-	-

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	710,550,243.39	108,271,221.23
第三层次	-	-
合计	710,550,243.39	108,271,221.23

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	710,550,243.39	98.94
	其中：债券	710,550,243.39	98.94



	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	4,014,728.17	0.56
8	其他各项资产	3,614,418.58	0.50
9	合计	718,179,390.14	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 7.3 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

无。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	1,011,392.60	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	236,713,058.05	45.50
	其中：政策性金融债	37,030,709.17	7.12
4	企业债券	10,277,290.71	1.98
5	企业短期融资券	115,342,626.27	22.17
6	中期票据	249,360,559.37	47.93
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	97,845,316.39	18.81
9	其他	-	-

10	合计	710,550,243.39	136.57
----	----	----------------	--------

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112303119	23 农业银行 CD119	1,000,000	97,845,316.39	18.81
2	1828015	18 招商银行二级 01	250,000	25,910,739.73	4.98
3	2028044	20 广发银行二级 01	200,000	21,196,175.34	4.07
4	1928010	19 平安银行二级	200,000	20,471,311.48	3.93
5	2120025	21 杭州银行小微债 01	200,000	20,334,994.54	3.91

## 7.7 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

无。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

## 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.10.1 本期国债期货投资政策

本基金国债期货操作主要以对冲现有持仓的久期风险为主，基于对利率债市场的判断和曲线形态进行择时套期保值。

### 7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货对组合整体风险影响较小，符合既定的投资政策和目标。

## 7.11 投资组合报告附注

### 7.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，广发银行股份有限公司、杭州银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中原银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

### 7.11.2 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。

### 7.11.3 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	192,811.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,421,607.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,614,418.58

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实 90 天 滚动持有 短债 A	9,640	29,179.23	85,178,381.86	30.28	196,109,362.94	69.72
嘉实 90 天 滚动持有 短债 C	7,636	28,778.44	-	-	219,752,159.70	100.00
合计	17,166	29,187.92	85,178,381.86	17.00	415,861,522.64	83.00

注：(1) 嘉实 90 天滚动持有短债 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总

份额比例，分别为机构投资者持有嘉实 90 天滚动持有短债 A 份额占嘉实 90 天滚动持有短债 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实 90 天滚动持有短债 A 份额占嘉实 90 天滚动持有短债 A 总份额比例；

(2) 嘉实 90 天滚动持有短债 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实 90 天滚动持有短债 C 份额占嘉实 90 天滚动持有短债 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实 90 天滚动持有短债 C 份额占嘉实 90 天滚动持有短债 C 总份额比例。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实 90 天滚动持有短债 A	512,002.08	0.18
	嘉实 90 天滚动持有短债 C	2,021.10	0.00
	合计	514,023.18	0.10

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实 90 天滚动持有短债 A	0
	嘉实 90 天滚动持有短债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实 90 天滚动持有短债 A	0
	嘉实 90 天滚动持有短债 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实 90 天滚动持有短债 A	嘉实 90 天滚动持有短债 C
基金合同生效日 (2022 年 6 月 17 日) 基金份额总额	200,490,465.96	1,460,721.86
本报告期期初基金份额总额	91,918,430.93	2,432,956.72
本报告期基金总申购份额	215,673,673.95	260,996,227.89
减：本报告期基金总赎回份额	26,304,360.08	43,677,024.91
本报告期基金拆分变	-	-

动份额		
本报告期末基金份 额总额	281,287,744.80	219,752,159.70

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，姚志鹏先生任公司副总经理。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	3	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

#### 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 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	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金调整发售对象并修改基金合同及招募说明书等事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 28 日
2	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 21 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 20 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实 90 天滚动持有短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 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 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

### 11.3 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

2023 年 8 月 29 日