

# 嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 22 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。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。（注：本基金以 2022 年 12 月 24 日至 2023 年 3 月 23 日为第八个运作期、以 2023 年 3 月 31 日至 2023 年 6 月 30 日为第九个运作期、以 2023 年 7 月 8 日至 2023 年 10 月 8 日为第十个运作期、以 2023 年 10 月 14 日至 2024 年 1 月 12 日为第十一个运作期。）

## 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、基金净值表现及利润分配情况</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	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	16
4.10 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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	48
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 .....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	49
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 .....	49
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 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
8.11 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>51</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	52
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	52
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>52</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>52</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	53
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
11.4 基金投资策略的改变 .....	53
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>65</b>
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 .....	65
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>65</b>
13.1 备查文件目录 .....	65
13.2 存放地点 .....	65
13.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实 3 个月理财债券	
基金主代码	000487	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 6 月 27 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,347,998,624.51 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E
下属分级基金的交易代码	000487	000488
报告期末下属分级基金的份额总额	882,785,982.60 份	2,465,212,641.91 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力求本金安全的基础上，追求稳定收益。
投资策略	在运作期内，本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要，在运作期之间的短暂开放期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具，如：银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等）等。在运作期，根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，主要采取持有到期的投资策略。具体策略包括：资产配置策略、银行定期存款及大额存单投资策略、债券回购投资策略、短期信用债券投资策略、中小企业私募债投资策略。
业绩比较基准	-
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66596688

电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010)65215588	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100020	100818
法定代表人	经雷	葛海蛟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 12 月 31 日）		报告期（2022 年 1 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）		报告期（2021 年 1 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）	
	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E
本期已实现收益	30,667,748.14	43,461,634.55	241,081.84	-	274.86	6,739,774.13
本期利润	30,667,748.14	43,461,634.55	241,081.84	-	274.86	6,739,774.13
加权	0.0230	0.0177	0.0004	-	0.006	0.0068

平均基金份额本期利润					2	
本期加权平均净值利润率	2.29%	1.75%	0.04%	-	0.62%	0.68%
本期基金份额净值增长率	2.20%	1.73%	0.03%	0.00%	0.62%	0.68%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	12,089,304.37	36,137,243.37	241,081.84	-	-	-
期末可供分配基金份额利润	0.0137	0.0147	0.0003	-	-	-
期末基金资产净值	894,875,286.97	2,501,349,885.28	922,880,235.63	0.00	-	-
期末基金份额净值	1.0137	1.0147	1.0003	-	-	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

基金份额累计净值增长率	6.68%	8.38%	4.48%	6.65%	4.45%	6.65%
-------------	-------	-------	-------	-------	-------	-------

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。

（4）本基金以 2022 年 12 月 24 日至 2023 年 3 月 23 日为第八个运作期、以 2023 年 3 月 31 日至 2023 年 6 月 30 日为第九个运作期、以 2023 年 7 月 8 日至 2023 年 10 月 8 日为第十个运作期、以 2023 年 10 月 14 日至 2024 年 1 月 12 日为第十一个运作期。

## 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 3 个月理财债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.40%	0.01%	-	-	-	-
过去六个月	0.90%	0.02%	-	-	-	-
过去一年	2.20%	0.02%	-	-	-	-
过去三年	2.85%	0.02%	-	-	-	-
过去五年	3.50%	0.02%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.68%	0.01%	-	-	-	-

嘉实 3 个月理财债券 E

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

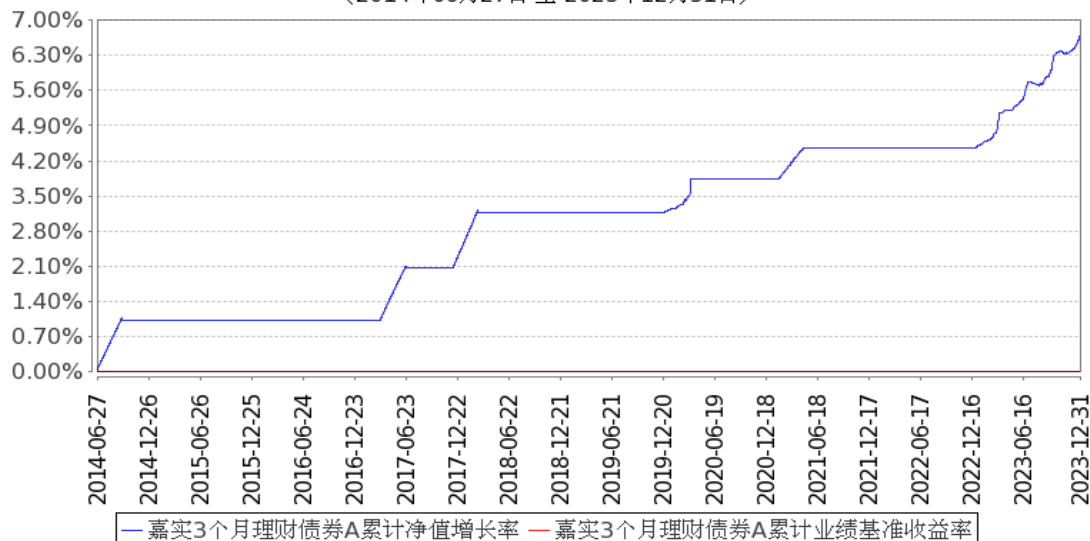


过去三个月	0.46%	0.01%	-	-	-	-
过去六个月	1.03%	0.02%	-	-	-	-
过去一年	1.73%	0.02%	-	-	-	-
过去三年	2.41%	0.02%	-	-	-	-
过去五年	3.11%	0.02%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.38%	0.01%	-	-	-	-

### 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

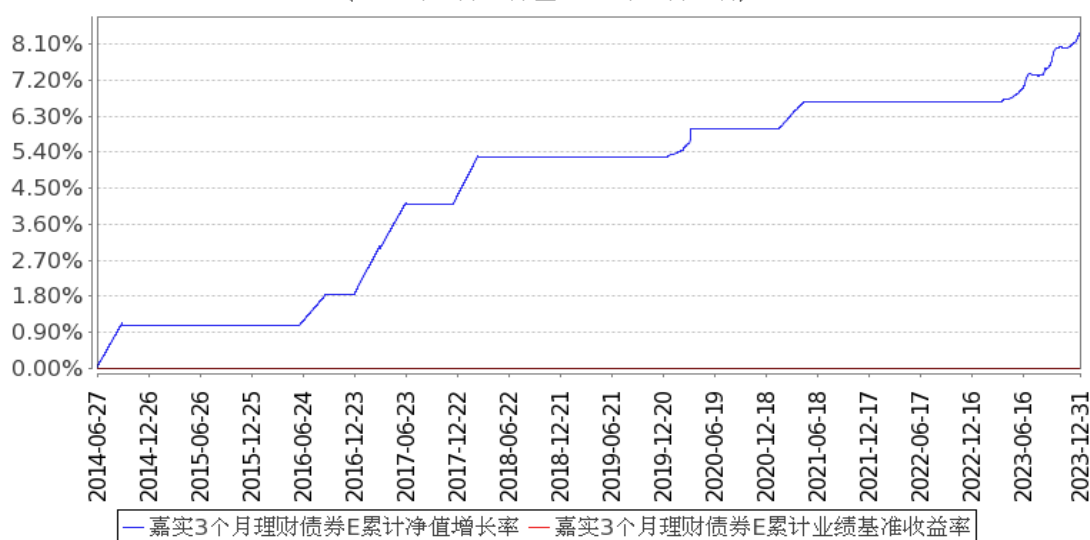
**嘉实3个月理财债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**

(2014年06月27日至2023年12月31日)



**嘉实3个月理财债券E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**

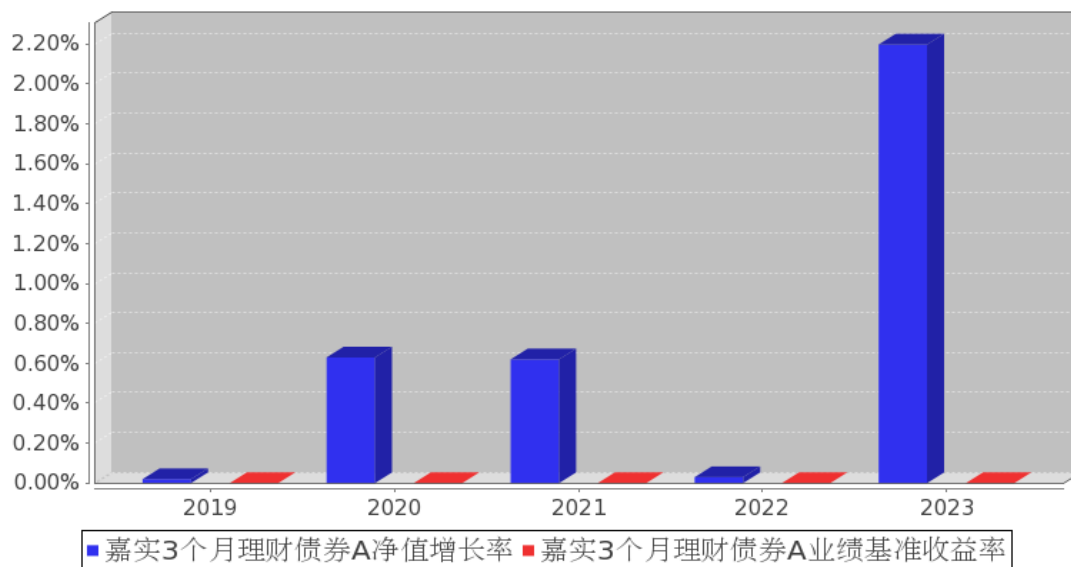
(2014年06月27日至2023年12月31日)



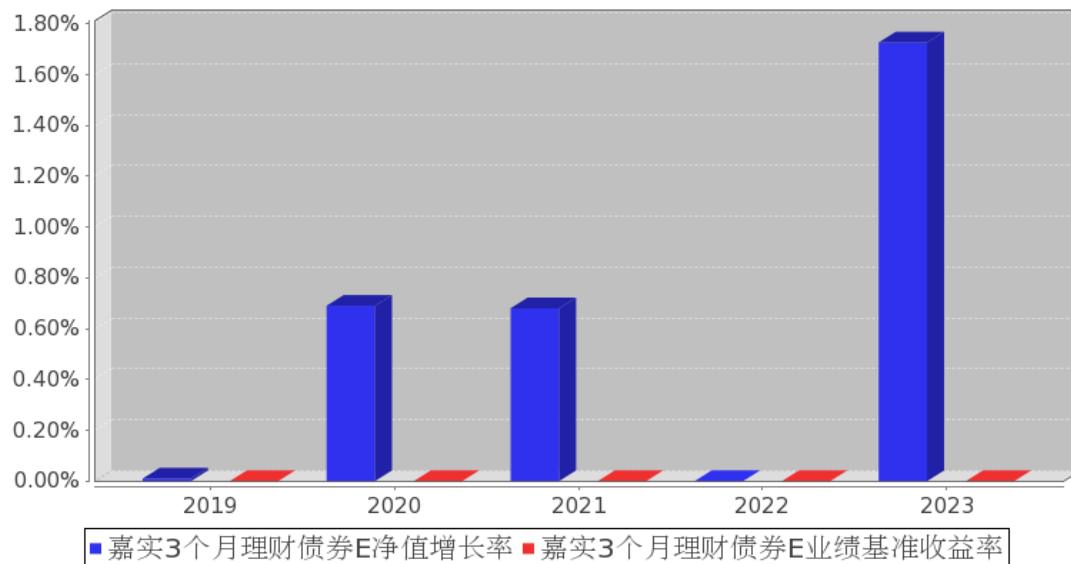
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自每个运作期开始后的 10 个工作日内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 过去五年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

**嘉实3个月理财债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



**嘉实3个月理财债券E基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图**



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

嘉实 3 个月理财债券 A

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
2023 年	0.0870	13,414,601.02	-	13,414,601.02	-
合计	0.0870	13,414,601.02	-	13,414,601.02	-

嘉实 3 个月理财债券 E

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
2023 年	0.0970	25,204,046.29	-	25,204,046.29	-
合计	0.0970	25,204,046.29	-	25,204,046.29	-

## § 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 12 月 31 日，基金管理人共管理 334 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		
张文玥	本基金、嘉实货币、嘉实安心货币、嘉实活期宝货币、嘉实薪金宝货币、嘉实快线货币、嘉实	2014 年 8 月 13 日	-	15 年	曾任中国邮政储蓄银行股份有限公司金融市场部货币市场交易员及债券投资经理。2014 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

现金宝货币、嘉实融享货币基金经理					
------------------	--	--	--	--	--

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 3 个月理财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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统

和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 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 13 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

2023 年，我国经济总体弱复苏，具体分析来看：需求端，基建依旧是稳增长的主抓手、全年看呈现“先稳后加速”的态势；地产持续走弱是经济的主要拖累因素；全年出口回落，二季度转为负增长、下半年跌幅收窄并逐渐进入修复通道；通胀端，海外发达经济体通胀触顶回落，国内则有所承压，CPI 及 PPI 均呈现下跌转负的态势。

2023 年，受国内基本面变化、中国与海外主要发达经济体的货币政策周期错位影响，人民币先涨后跌再反弹，全年波动较大。全年人民币汇率走势可分为四阶段：一是年初，受国内疫后复苏的基本面乐观情绪延续，人民币汇率快速回落至 6.70；二是 2 月-8 月，美联储鹰派态度带动美债收益率屡创新高、中国央行两次降息托底经济，中美国债利差加剧，人民币承压上行至 7.30；三是 8 月-10 月底，中国央行释放“稳汇率”信号，人民币汇率在 7.30 企稳；四是 11 月-12 月，美通胀数据走弱，美联储降息预期升温带动美元指数回落，人民币汇率走强至 7.10。

2023 年，中国人民银行货币政策取向整体稳健宽松，货币政策操作上呈现“总量+结构”双发力局面，流动性保持充裕水平，为支持实体经济复苏提供适宜的流动性环境。央行 3 月降准 0.25 个百分点释放 5000 亿中长期资金，6 月宣布调降政策利率，7 天逆回购和 1 年 MLF 利率同时下行 10BP 至 1.90%和 2.65%，同时引导 1 年期 LPR 和 5 年期 LPR 调降 10 BP 至 3.55%和 4.20%。8 月央行再度超预期调降政策利率且此次调降为非对称调降，7 天逆回购下调 10BP 至 1.80%、1 年 MLF 利率下调 15BP 至 2.50%，同时引导 1 年期 LPR 下调 10BP、5 年期 LPR 保持不变。9 月央行再度降准 0.25 个百分点释放 5000 亿中长期资金；四季度央行加大 OMO 及 MLF 投放力度以平抑资金波动，并在年末公开市场投放大量资金呵护跨年流动性。

全年看，银行间资金面呈现中性偏松，资金利率大多时间围绕短端政策利率震荡；节奏上，全年资金利率呈现“M”型走势：一季度资金面收敛，是疫后经济复苏叠加信贷投放对流动性挤压

的结果；4月-8月，经济趋弱、信贷乏力，资金面宽松；9月-10月，专项债和特殊再融资债等政府债发行提速对流动性造成较大冲击，资金面趋紧；11月-年底，政府债发行高峰结束叠加央行大额投放，资金面再度转松。短端资产利率跟资金利率走势趋同，以1年AAA同业存单价格为例：一季度信贷发力带动大幅上行至2.75%，3月两会强刺激落空回落至2.60%，二季度存款利率调降叠加降息落地带动下行至2.26%，8月社融不佳叠加CPI转负央行再度降息下至年内最低2.21%，9月资金利率抬升叠加后续专项债及特殊再融资债提速发行，银行负债端承压开始提价发存单，1年AAA同业存单持续上行至2.67%，最后在年末央行呵护跨年流动性环境下回落至2.40%。

2023年，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性和流动性为首要任务；灵活配置债券、同业存单和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性。整体看，2023年全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3个月理财债券A基金份额净值为1.0137元，本报告期基金份额净值增长率为2.20%；截至本报告期末嘉实3个月理财债券E基金份额净值为1.0147元，本报告期基金份额净值增长率为1.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年，中国经济预计仍将延续复苏态势。基建投资在财政发力的支撑下仍有望维持较高增速，成为“稳增长”的主抓手；消费增速大概率会保持稳定且对经济增长形成正贡献；出口方面，受益于全球制造业和商品贸易复苏，中国出口修复方向较为确定；房地产市场持续调整，是目前经济的主要拖累项。

2024年货币政策总体基调是总量“灵活适度”、结构“精准有效”，总量和结构政策双重发力，一方面要托底增长同时也要推动结构性改革，支持防范化解风险，着力营造良好的货币金融环境，高质量服务实体经济。

2024年财政政策整体基调是“适度加力、提质增效”，“适度加力”是组合使用多种政策工具，适度扩大财政支出规模，促进经济持续回升向好，“提质增效”是提高资金使用效率，加强与其他宏观政策协同联动，最大程度提升宏观政策的调控效能。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新产品新业务新制度新客户新投资工具并进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告

“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实 3 个月理财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《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《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“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分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 审计报告

### 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	普华永道中天审字(2024)第 23323 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	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	（一） 我们审计的内容 我们审计了嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金(以下简称“嘉实 3 个月理财债券基金”)的财务报表，包括 2023 年 12



	<p>月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了嘉实 3 个月理财债券基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实 3 个月理财债券基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实 3 个月理财债券基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实 3 个月理财债券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，除非基金管理人管理层计划清算嘉实 3 个月理财债券基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实 3 个月理财债券基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 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</p>

	<p>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。</p> <p>(二) 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。</p> <p>(三) 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。</p> <p>(四) 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，就可能导致对嘉实 3 个月理财债券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实 3 个月理财债券基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇 柴瀚英
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	676,701,024.59	184,063,406.96
结算备付金		-	-
存出保证金		49,719.48	-
交易性金融资产	7.4.7.2	-	-
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	585,057,404.84	191,908,057.74
债权投资	7.4.7.5	2,160,167,856.68	527,045,371.20
其中：债券投资		2,160,167,856.68	527,045,371.20
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		126,312.34	50,089,068.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		3,422,102,317.93	953,105,904.40
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		25,004,666.11	-
应付清算款		-	30,136,160.55
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		143,957.04	9,564.00
应付销售服务费		210,876.23	47,819.95
应付投资顾问费		-	-
应交税费		297,796.93	5,002.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	219,849.37	27,121.92
负债合计		25,877,145.68	30,225,668.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	3,347,998,624.51	922,639,153.79
未分配利润	7.4.7.12	48,226,547.74	241,081.84
净资产合计		3,396,225,172.25	922,880,235.63
负债和净资产总计		3,422,102,317.93	953,105,904.40

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，嘉实 3 个月理财债券 A 基金份额净值（暂估浮动管理费前）1.0137 元，基金份额总额 882,785,982.60 份，基金净资产（暂估浮动管理费前）894,875,286.97

元；嘉实 3 个月理财债券 E 基金份额净值（暂估浮动管理费前）1.0147 元，基金份额总额 2,465,212,641.91 份，基金净资产（暂估浮动管理费前）2,501,349,885.28 元，基金份额总额合计为 3,347,998,624.51 份，基金净资产（暂估浮动管理费前）合计为 3,396,225,172.25 元。2023 年度，利润表未体现嘉实 3 个月理财债券 A 基金暂估浮动管理费金额为 0.00 元（2022 年度：0.00 元），未体现嘉实 3 个月理财债券 E 基金暂估浮动管理费金额为 0.00 元（2022 年度：0.00 元）。于 2023 年 12 月 31 日，嘉实 3 个月理财债券 A 基金相关暂估浮动管理费余额为 0.00 元（2022 年 12 月 31 日：0.00 元），基金净资产（暂估浮动管理费后）894,875,286.97 元，嘉实 3 个月理财债券 E 基金相关暂估浮动管理费余额为 0.00 元（2022 年 12 月 31 日：0.00 元），基金净资产（暂估浮动管理费后）2,501,349,885.28 元。该暂估浮动管理费余额是各基金份额持有人于年末时点的暂估浮动管理费的合计，各基金份额持有人实际应承担的浮动管理费金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估浮动管理费金额存在差异。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		85,515,553.51	455,102.92
1. 利息收入		85,505,325.25	452,514.52
其中：存款利息收入	7.4.7.13	17,132,408.69	98,975.05
债券利息收入		60,668,071.64	148,876.27
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,704,844.92	204,663.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-	-
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-

其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	10,228.26	2,588.40
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>11,386,170.82</b>	<b>214,021.08</b>
1. 管理人报酬		-	-
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费		1,636,687.63	9,564.00
3. 销售服务费		3,584,109.30	47,819.95
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		5,795,431.83	790.69
其中：卖出回购金融资产支出		5,795,431.83	790.69
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-64,979.23	131,565.47
7. 税金及附加		216,188.34	535.97
8. 其他费用	7.4.7.23	218,732.95	23,745.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>74,129,382.69</b>	<b>241,081.84</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>74,129,382.69</b>	<b>241,081.84</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>74,129,382.69</b>	<b>241,081.84</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实3个月理财债券型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	922,639,153.79	-	241,081.84	922,880,235.63
二、本期期初净资产	922,639,153.79	-	241,081.84	922,880,235.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,425,359,470.72	-	47,985,465.90	2,473,344,936.62
（一）、综合收益总额	-	-	74,129,382.69	74,129,382.69

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	2,425,359,470.72	-	12,474,730.52	2,437,834,201.24
其中: 1. 基金申购款	7,912,508,889.00	-	65,696,075.88	7,978,204,964.88
2. 基金赎回款	-5,487,149,418.28	-	-53,221,345.36	-5,540,370,763.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-38,618,647.31	-38,618,647.31
四、本期期末净资产	3,347,998,624.51	-	48,226,547.74	3,396,225,172.25
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	-	-	-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	922,639,153.79	-	241,081.84	922,880,235.63
(一)、综合收益总额	-	-	241,081.84	241,081.84
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	922,639,153.79	-	-	922,639,153.79
其中: 1. 基金申购款	922,799,235.19	-	-	922,799,235.19
2. 基金赎回款	-160,081.40	-	-	-160,081.40
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-	-

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	922,639,153.79	-	241,081.84	922,880,235.63

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
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

嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1586 号《关于核准嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 6 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 225,251,353.24 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 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。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产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及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、债权投资、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂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。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债权投资的账面价值中。

对于应收款项、债权投资和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。



本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

不适用。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 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。对于曾

经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以摊余成本计量的金融资产于处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金开放期及运作期内，本基金的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。

本基金的管理人报酬按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

本基金暂停运作期间所发生的费用，由基金管理人承担。

#### 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，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式：现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

无。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

##### 预期信用损失的计量

对于以摊余成本计量的金融资产，其预期信用损失的计量中使用了模型和假设，这些模型和假设涉及未来的宏观经济情况对手方的信用行为。在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的采用等。本基金管理人通过违约风险敞口和预期信用损失率计算预期信用损失，并基于违约概率和违约损失率确定预期信用损失率。在划分减值阶段及确定预期信用损失率时，本基金管理人使用可获取的外部评级、外部报告和外部统计数据等，并定期监控和复核与预期信用损失计算相关的重要宏观经济假设和参数。具体信息请参考附注 7.4.13.2。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《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《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《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》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	12,933,451.25	978,696.44
等于：本金	12,933,273.94	977,133.94
加：应计利息	177.31	1,562.50
减：坏账准备	-	-
定期存款	663,767,573.34	183,084,710.52
等于：本金	660,000,000.00	183,000,000.00
加：应计利息	3,776,366.92	97,412.55
减：坏账准备	8,793.58	12,702.03
其中：存款期限1个月以内	-	45,015,750.00
存款期限1-3个月	663,767,573.34	88,030,147.99
存款期限3个月以上	-	50,038,812.53
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	676,701,024.59	184,063,406.96

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

无。

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	585,057,404.84	-
银行间市场	-	-
合计	585,057,404.84	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	191,908,057.74	-
银行间市场	-	-
合计	191,908,057.74	-

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值	
债券	交易所市场	-	-	-	-	
	银行间市场	2,115,000,000.00	3,635,277.17	41,590,372.17	57,792.66	2,160,167,856.68
	小计	2,115,000,000.00	3,635,277.17	41,590,372.17	57,792.66	2,160,167,856.68

		000.00	.17	.17		56.68
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		2,115,000,000.00	3,635,277.17	41,590,372.17	57,792.66	2,160,167,856.68
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	520,000,000.00	1,014,959.01	6,149,275.63	118,863.44	527,045,371.20
	小计	520,000,000.00	1,014,959.01	6,149,275.63	118,863.44	527,045,371.20
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		520,000,000.00	1,014,959.01	6,149,275.63	118,863.44	527,045,371.20

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	118,863.44	-	-	118,863.44
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	3,584,912.09	-	-	3,584,912.09
本期转回	3,645,982.87	-	-	3,645,982.87
其他变动	-	-	-	-
期末余额	57,792.66	-	-	57,792.66

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 7.4.7.7 其他权益工具投资

## 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 7.4.7.8 其他资产

无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	-	-
应付交易费用	89,849.37	7,121.92
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	89,849.37	7,121.92
应付利息	-	-
预提费用	130,000.00	20,000.00
合计	219,849.37	27,121.92

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 嘉实 3 个月理财债券 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	922,639,153.79	922,639,153.79
本期申购	3,560,192,526.89	3,560,192,526.89
本期赎回（以“-”号填列）	-3,600,045,698.08	-3,600,045,698.08
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	882,785,982.60	882,785,982.60

## 嘉实 3 个月理财债券 E

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	4,352,316,362.11	4,352,316,362.11



本期赎回(以“-”号填列)	-1,887,103,720.20	-1,887,103,720.20
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	2,465,212,641.91	2,465,212,641.91

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 其他综合收益

无。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实3个月理财债券A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	241,081.84	-	241,081.84
本期期初	241,081.84	-	241,081.84
本期利润	30,667,748.14	-	30,667,748.14
本期基金份额交易产生的变动数	-5,404,924.59	-	-5,404,924.59
其中：基金申购款	27,932,325.99	-	27,932,325.99
基金赎回款	-33,337,250.58	-	-33,337,250.58
本期已分配利润	-13,414,601.02	-	-13,414,601.02
本期末	12,089,304.37	-	12,089,304.37

嘉实3个月理财债券E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	43,461,634.55	-	43,461,634.55
本期基金份额交易产生的变动数	17,879,655.11	-	17,879,655.11
其中：基金申购款	37,763,749.89	-	37,763,749.89
基金赎回款	-19,884,094.78	-	-19,884,094.78
本期已分配利润	-25,204,046.29	-	-25,204,046.29
本期末	36,137,243.37	-	36,137,243.37

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	1,543,362.60	1,562.50
定期存款利息收入	15,470,463.26	97,412.55
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	117,915.57	-
其他	667.26	-
合计	17,132,408.69	98,975.05

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 7.4.7.19 股利收益

无。

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

无。

## 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	10,178.26	2,401.21
其他	50.00	187.19
合计	10,228.26	2,588.40

## 7.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
银行存款	-3,908.45	12,702.03
买入返售金融资产	-	-
债权投资	-61,070.78	118,863.44
其他债权投资	-	-
其他	-	-
合计	-64,979.23	131,565.47

注：在预期信用损失的计量中所包含的重大判断和假设主要包括：选择恰当的预期信用损失模型并确定相关参数、减值阶段划分的判断标准以及用于计量预期信用损失的前瞻性信息及其权重的

采用等。本基金结合中债预期信用损失比例和资产负债表日的资产账面余额计算处于减值第一阶段及第二阶段的资产的预期信用损失。预期信用损失比例通过中债市场隐含违约率与违约损失率的乘积计算获得，违约损失率参数由市场数据分析法确定并可根据历史违约债券的市场信息计算得到。此外，在考虑未来经济影响下，通过对多场景进行分析对资产预期信用损失比例进行前瞻性调整。在考虑前瞻性信息时，本基金考虑了不同的宏观经济情景。2023 年度，中性、乐观与悲观场景下的权重分别为 80%、10%、10% (2022 年度：80%、10%、10%)，用于计算中债预期信用损失前瞻性调整系数的国内生产总值同比增长率在中性、乐观以及悲观场景下的预测值为 6.47%、7.76%、5.18% (2022 年度：4.60%、5.52%、3.68%)。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	10,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	60,982.95	3,745.00
债券托管账户维护费	27,750.00	-
合计	218,732.95	23,745.00

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 1 月 11 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份嘉实 3 个月理财债券 A 基金份额派发红利 0.0570 元，每 10 份嘉实 3 个月理财债券 E 基金份额派发红利 0.0630 元。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
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

#### 7.4.10 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。

##### 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

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	-	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

1. 本基金不收取固定管理费，以分档计提方式收取浮动管理费；
2. 本基金 A 类、E 类基金份额年化管理费率上限为 0.30%；
3. 当期运作期期满时，基金管理人以各类基金份额的“运作期年化收益率”为基础分别分三档收取管理费；对于每一类别基金份额，在分档模式下，基金管理人将“运作期年化收益率”由低到高分档并设定不同等级的管理费率；“运作期年化收益率”越大的档，管理费率越高；
4. 基金管理费以每个运作期最后一日各类基金份额的基金资产净值为基数，按相应类别基金份额“运作期年化收益率”对应档数的管理费率计算；其计算公式如下：A 类基金份额或 E 类基金份额当期运作应计提的管理费 = 当期运作期最后一日 A 类基金份额的基金资产净值或 E 类基金份额的基金资产净值 × A 类基金份额或 E 类基金份额根据合同约定适用的当期运作期管理费率 × 当期运作期合计日历日天数 / 365。管理费计提后由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于运作期最后一个工作日后的 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给

基金管理人。

5. 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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,636,687.63	9,564.00

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。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E	合计
嘉实基金管理有限公司	16,041.77	171,091.61	187,133.38
中国银行	30,150.33	-	30,150.33
合计	46,192.10	171,091.61	217,283.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E	合计
嘉实基金管理有限公司	140.93	-	140.93
中国银行	519.50	-	519.50
合计	660.43	-	660.43

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，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：各类别基金日销售服务费 = 各类别基金份额前一日基金资产净值 × 各类别基金份额适用的销售服务费率 / 当年天数。

#### 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

无。

## 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

无。

## 7.4.10.4.2 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。

## 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

无。

## 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

无。

## 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
	中国银行股份有限公司_活期	12,933,451.25	1,543,362.60	978,696.44

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

嘉实 3 个月理财债券 A								
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
		场内	场外					
1	2023年6月29日	-	2023年6月29日	0.0350	9,799,615.75	-	9,799,615.75	-
2	2023年9月27日	-	2023年9月27日	0.0520	3,614,985.27	-	3,614,985.27	-

合计	-	-	-	0.0870	13,414,601.02	-	13,414,601.02	-
嘉实 3 个月理财债券 E								
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
		场内	场外					
1	2023 年 6 月 29 日	-	2023 年 6 月 29 日	0.0390	9,448,303.94	-	9,448,303.94	-
2	2023 年 9 月 27 日	-	2023 年 9 月 27 日	0.0580	15,755,742.35	-	15,755,742.35	-
合计	-	-	-	0.0970	25,204,046.29	-	25,204,046.29	-

注：根据相关法律法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2024 年 1 月 11 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份嘉实 3 个月理财债券 A 基金份额派发红利 0.0570 元，每 10 份嘉实 3 个月理财债券 E 基金份额派发红利 0.0630 元。

#### 7.4.12 期末（2023 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

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 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 2023 年 12 月 31 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 25,004,666.11 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
012381486	23 鲁高速 SCP002	2024 年 1 月 2 日	101.48	281,000	28,515,019.08
合计				281,000	28,515,019.08

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。



## 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

本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求本金安全的基础上，追求稳定收益。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。

### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级 AA 级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相

关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至 C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级 AA 级为低信用风险阈值，并将存款减值阶段划分如下：在资产负债表日，若存款的主体隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则存款处于减值第一阶段；若存款的主体隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则存款处于减值第二阶段；若存款的主体隐含评级下调至 C，或出现其他认定为违约的情形时，存款处于减值第三阶段。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,724,298,422.38	453,409,497.29
合计	1,724,298,422.38	453,409,497.29

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	186,072,764.59	73,635,873.91
AAA 以下	239,293,077.61	-
未评级	10,503,592.10	-
合计	435,869,434.30	73,635,873.91

注：评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门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期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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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。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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	676,701,024.59	-	-	-	676,701,024.59
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	49,719.48	-	-	-	49,719.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	585,057,404.84	-	-	-	585,057,404.84
应收清算款	-	-	-	126,312.34	126,312.34
债权投资	2,160,167,856.68	-	-	-	2,160,167,856.68
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>3,421,976,005.59</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>126,312.34</b>	<b>3,422,102,317.93</b>
<b>负债</b>					
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	25,004,666.11	-	-	-	25,004,666.11
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	143,957.04	143,957.04
应付销售服务费	-	-	-	210,876.23	210,876.23
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	297,796.93	297,796.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	219,849.37	219,849.37
<b>负债总计</b>	<b>25,004,666.11</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>872,479.57</b>	<b>25,877,145.68</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>3,396,971,339.48</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-746,167.23</b>	<b>3,396,225,172.25</b>
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>

资产				
货币资金	184,063,406.96	-	-	184,063,406.96
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	191,908,057.74	-	-	191,908,057.74
应收清算款	-	-	50,089,068.50	50,089,068.50
债权投资	527,045,371.20	-	-	527,045,371.20
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	903,016,835.90	-	50,089,068.50	953,105,904.40
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	-	-	-	-
应付清算款	-	-	30,136,160.55	30,136,160.55
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	9,564.00	9,564.00
应付销售服务费	-	-	47,819.95	47,819.95
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	5,002.35	5,002.35
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	27,121.92	27,121.92
负债总计	-	-	30,225,668.77	30,225,668.77
利率敏感度缺口	903,016,835.90	-	19,863,399.73	922,880,235.63

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

无重大影响。

#### 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，因此无重大外汇风险。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 7.4.13.4.2.2 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		
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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.3.2 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		
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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	-	-
业绩比较基准下降 5%	-	-	

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

无。

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期末，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于本报告期末，本基金持有的债权投资的账面价值为 2,160,167,856.68 元，公允价值为 2,167,268,872.17 元(上年度末：本基金持有的债权投资的账面价值为 527,045,371.20 元，公允价值为 527,460,275.63 元)。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。(ii) 当金融工具不存在活跃市场，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。(iii) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于本报告期末，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(上年度末：同)。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,160,167,856.68	63.12
	其中：债券	2,160,167,856.68	63.12
	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	585,057,404.84	17.10
	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	676,701,024.59	19.77
8	其他各项资产	176,031.82	0.01
9	合计	3,422,102,317.93	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

无。



## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 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

无。

## 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

## 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	82,742,095.62	2.44
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,724,298,422.38	50.77
6	中期票据	353,127,338.68	10.40
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,160,167,856.68	63.60

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

## 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	012382567	23 亦庄投资 SCP003	2,200,000	222,015,342.03	6.54
2	012381486	23 鲁高速 SCP002	1,000,000	101,476,936.23	2.99
3	042380019	23 晋能煤业 CP001	900,000	92,462,153.24	2.72

4	2122001	21 汇理汽车债 01	800,000	82,742,095.62	2.44
5	012384094	23 中铝 SCP001(科创 票据)	600,000	60,146,956.41	1.77

**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**  
无。

**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**  
无。

**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**  
无。

**8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**8.10.1 本期国债期货投资政策**  
无。

**8.10.2 本期国债期货投资评价**  
无。

**8.11 投资组合报告附注**

**8.11.1 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，中信建投证券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。

**8.11.2 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。

**8.11.3 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	49,719.48
2	应收清算款	126,312.34
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	176,031.82
---	----	------------

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 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 (%)
嘉实 3 个月理财债券 A	11,471	76,958.07	121,377,696.16	13.75	761,408,286.44	86.25
嘉实 3 个月理财债券 E	12	205,434,386.83	2,465,192,770.01	100.00	19,871.90	0.00
合计	11,480	291,637.51	2,586,570,466.17	77.26	761,428,158.34	22.74

注：(1) 嘉实 3 个月理财债券 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例, 分别为机构投资者持有嘉实 3 个月理财债券 A 份额占嘉实 3 个月理财债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实 3 个月理财债券 A 份额占嘉实 3 个月理财债券 A 总份额比例;

(2) 嘉实 3 个月理财债券 E: 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 3 个月理财债券 E 份额占嘉实 3 个月理财债券 E 总份额比例、个人投资者持有嘉实 3 个月理财债券 E 份额占嘉实 3 个月理财债券 E 总份额比例。

### 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	嘉实 3 个月理财债券 A	296,871.20	0.03
	嘉实 3 个月理财债券 E	19,871.90	0.00

有本基金			
	合计	316,743.10	0.01

### 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

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 3 个月理财债券 A	0
	嘉实 3 个月理财债券 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实 3 个月理财债券 A	0~10
	嘉实 3 个月理财债券 E	0~10
	合计	0~10

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实 3 个月理财债券 A	嘉实 3 个月理财债券 E
基金合同生效日 (2014 年 6 月 27 日) 基金份额总额	214,778,381.84	10,472,971.40
本报告期期初基金份额总额	922,639,153.79	-
本报告期基金总申购份额	3,560,192,526.89	4,352,316,362.11
减：本报告期基金总赎回份额	3,600,045,698.08	1,887,103,720.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	882,785,982.60	2,465,212,641.91

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

## 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

### (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。

## 11.3 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。

## 11.4 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。

## 11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 10,000.00 元, 该审计机构已连续 7 年为本基金提供审计服务。

## 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

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期, 基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 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, 本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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 (%)	

渤海证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
诚通证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券有 限责任公 司	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
广发证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
国新证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华林证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

华泰证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
联储证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
山西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
万联证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限	3	-	-	-	-	-



公司						
野村东方国际证券有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	10	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

公司						
----	--	--	--	--	--	--

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。

3. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。安信证券股份有限公司更名为国投证券股份有限公司。联储证券有限责任公司更名为联储证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：华西证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：财通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，东北证券股份有限公司新增交易单元 1 个，国泰君安证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中山证券有限责任公司新增交易单元 2 个，中邮证券有限责任公司新增交易单元 2 个。

## 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	
	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 (%)
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
诚通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	120,096,480.00	16.43	2,347,363,000.00	14.07	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

司						
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华林证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	610,788,150.00	83.57	14,332,481,000.00	85.93	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联储证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公	-	-	-	-	-	-

司						
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
万联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
西部证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
湘财证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
野村东 方国际 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
英大证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
粤开证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

## 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	关于嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金第八期运作期投资组合构建情况说明的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 9 日
2	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金关于第八期运作期到期后进入第九期运作期开放申购赎回、起始运作及到期赎回等安排的公告	证券时报、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 17 日
3	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	证券时报、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
4	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金关于第八期运作期实际年化收益率的公告	证券时报、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 28 日
5	关于嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金第九期运作期投资组合构建情况说明的公告	证券时报、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 17 日
6	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、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
7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、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
8	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金关于第九期运作期到期后进入第十期运作期开放申购赎回、起始运作及到期赎回等安排的公告	证券时报、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 26 日
9	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金 2023 年第一次收益分配公告	证券时报、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 28 日
10	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金关于第九期运作期实际年化收益率的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 5 日
11	关于嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金第十期运作期投资组合构建情况说明的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 7 月 21 日
12	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金关于第十期运作期到期后进入第十一期运作期开放申购赎回、起始运作及到期赎回等安排的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 25 日
13	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金 2023 年第二次收益分配公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 9 月 26 日



14	嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金关于第十期运作期实际年化收益率的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 11 日
15	关于嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金第十一期运作期投资组合构建情况说明的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 10 月 27 日

## § 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	2023-03-30 至 2023-03-30, 2023-07-04 至 2023-12-31	-	1,289,587,374.46	-	1,289,587,374.46	38.52
	2	2023-07-10 至 2023-10-09	-	692,863,505.89	300,000,000.00	392,863,505.89	11.73
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>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实 3 个月理财债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实 3 个月理财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 3 个月理财债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 13.2 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

### 13.3 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

2024 年 3 月 28 日