

嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
券投资基金
2024 年第 2 季度报告

2024 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：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	015861
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 9 日
报告期末基金份额总额	6,213,601,681.24 份
投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。 在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。
投资策略	本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 具体投资策略包括：同业存单投资组合的构建策略、同业存单投资组合的调整策略、久期策略、信用债券投资策略、资产支持证券的投资策略、杠杆投资策略
业绩比较基准	中证同业存单 AAA 指数收益率×95%+银行人民币一年定期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，主要投资于同业存单，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票型基金、偏股混合型基金。 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券市场相

	似的风险收益特征。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	33,488,698.41
2. 本期利润	35,240,765.84
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0060
4. 期末基金资产净值	6,518,481,310.29
5. 期末基金份额净值	1.0491

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。

3.2 基金净值表现

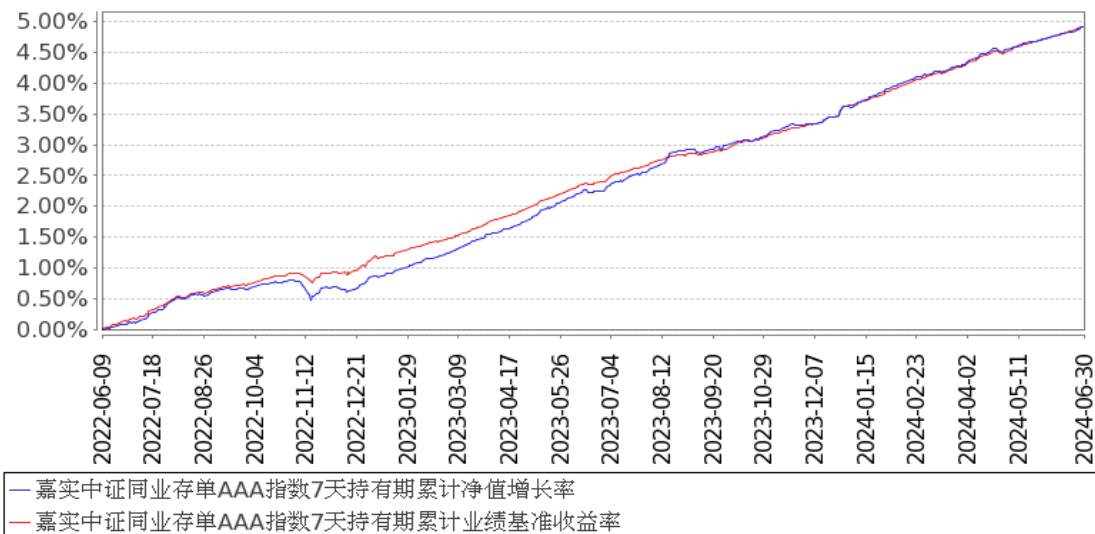
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.58%	0.01%	0.62%	0.01%	-0.04%	0.00%
过去六个月	1.24%	0.01%	1.25%	0.01%	-0.01%	0.00%
过去一年	2.53%	0.01%	2.42%	0.01%	0.11%	0.00%
自基金合同 生效起至今	4.91%	0.02%	4.91%	0.01%	0.00%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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09日至2024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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵国英	本基金、嘉实信用债券、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、	2022 年 6 月 14 日	-	20 年	曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司。现任投资总监（纯债）。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券、嘉实致裕纯债债券基金经理				
陈硕	本基金、嘉实汇达中短债债券、嘉实致远 3 个月定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券基金经理	2023 年 9 月 26 日	-	10 年	曾任中国民生银行股份有限公司金融市场部投资经理。2021 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司固收与配置组，任投资经理。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、《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 3 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债券收益率整体呈震荡下行趋势。基本面来看，经济弱修复态势延续，通胀同比温和回升，结构上依旧体现出外需偏强，内需偏弱的特征。政策面更多聚焦“稳经济，化风险”，出台设备更新和消费升级政策拉动总需求，同时通过财政手段如发行超长期特别国债和房地产政策来稳定房地产市场。4 月底政治局会议提出“统筹研究消化存量房产和优化增量住房的政策措施”。5 月 17 日，全国切实做好保交房工作视频会议召开，提出对于商品房库存较多城市，政府可以需定购，酌情以合理价格收购部分商品房用作保障性住房。央行设立 3000 亿元保障性住房再贷款，支持地方国有企业以合理价格收购已建成未出售商品房，用作配售型或配租型保障性住房。同日，央行还宣布了一系列住房贷款政策调整，包括下调个人住房公积金贷款利率，取消首套和二套房商业性个人住房贷款利率政策下限，以及调整最低首付比例等。资金方面，资金利率整体平稳，基本围绕公开市场操作利率波动，受禁止手工补息政策影响，非银流动性相对充裕，流动性分层现象基本消失，R-DR 利差收窄甚至出现阶段性倒挂，信用利差收窄 15-20bp 至较低位置。从收益率曲线变动来看，整体呈陡峭化下行，1 年国债下行约 18bp，10 年国债下行约 9bp

4-6 月 DR001 的均值分别为 1.76，1.76，1.81，DR007 的均值分别为 1.88，1.85，1.90，资金市场整体表现为供给较为充足，价格整体适中，季度维度来看 DR007 仍在政策利率上方运行。

报告期内，本基金秉承稳健投资原则操作，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中证同业存单 AAA 指数中成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，以实现对标指数的有效跟踪，组合整体运行状况良好。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0491 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.58%，业绩比较基准收益率为 0.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,637,322,564.73	95.85
	其中：债券	8,637,322,564.73	95.85
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	101,654,829.09	1.13
8	其他资产	272,017,736.58	3.02
9	合计	9,010,995,130.40	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	458,001,459.62	7.03
	其中：政策性金融债	366,382,258.67	5.62
4	企业债券	75,780,910.85	1.16
5	企业短期融资券	980,122,979.58	15.04
6	中期票据	133,835,420.78	2.05
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	6,989,581,793.90	107.23
9	其他	-	-

10	合计	8,637,322,564.73	132.51
----	----	------------------	--------

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	112415069	24 民生银行 CD069	4,000,000	397,024,905.11	6.09
2	230306	23 进出 06	2,000,000	203,314,480.87	3.12
3	112310234	23 兴业银行 CD234	2,000,000	199,708,026.23	3.06
4	112304035	23 中国银行 CD035	2,000,000	199,474,608.74	3.06
5	112306227	23 交通银行 CD227	2,000,000	199,240,401.64	3.06

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，兴业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、广西北部湾银行股份有限公司、哈尔滨银行股份有限公司、平安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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	25,399.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	271,992,336.70
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	272,017,736.58

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	5,995,484,732.54
-------------	------------------

报告期期间基金总申购份额	5,556,189,552.46
减：报告期期间基金总赎回份额	5,338,072,603.76
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	6,213,601,681.24

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复文件。
- （2）《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》；
- （3）《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》；
- （4）《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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）报告期内嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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 7 月 18 日