

嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证
券投资基金
2021 年第 2 季度报告

2021 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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 7 月 20 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 04 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 嘉实致安 3 个月定期债券 |
| 基金主代码 | 007879 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 9 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 506,467,522.94 份 |
| 投资目标 | 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）封闭期投资策略：运用大类资产配置策略，本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。本基金封闭期投资策略还包括：债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票，还将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带 |

| | |
|-------|------------|
| | 来的境外市场的风险。 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 平安银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 4 月 1 日-2021 年 6 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -900,766.13 |
| 2. 本期利润 | 10,720,316.50 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0212 |
| 4. 期末基金资产净值 | 523,306,199.33 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.0332 |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

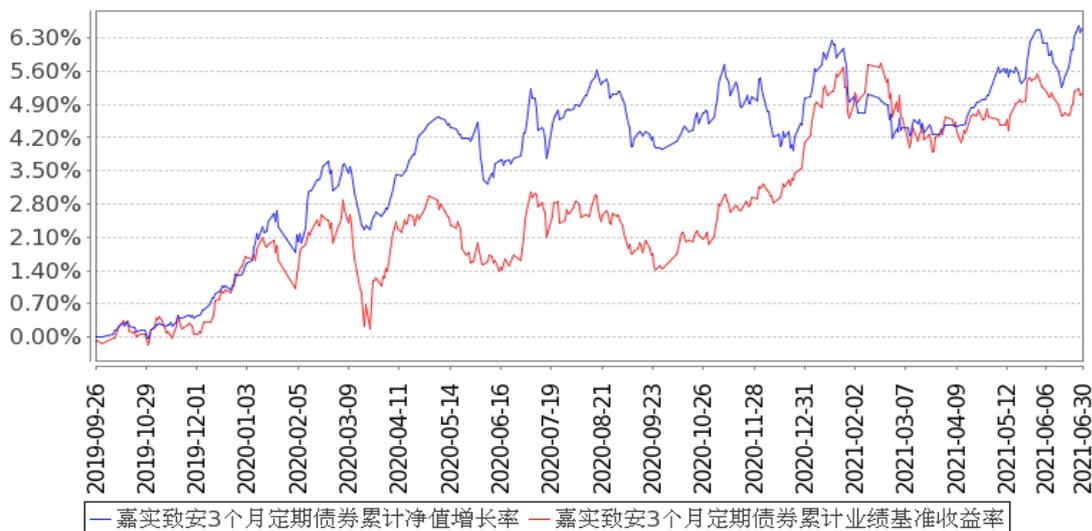
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 2.08% | 0.15% | 0.84% | 0.13% | 1.24% | 0.02% |
| 过去六个月 | 1.43% | 0.16% | 0.99% | 0.18% | 0.44% | -0.02% |
| 过去一年 | 2.40% | 0.17% | 3.24% | 0.17% | -0.84% | 0.00% |
| 自基金合同 生效起至今 | 6.53% | 0.16% | 5.15% | 0.18% | 1.38% | -0.02% |

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

嘉实致安3个月定期债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年09月26日至2021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 | | |
| 赖礼辉 | 本基金、嘉实安益混合、嘉实策略优选混合、嘉实稳宏债券基金经理 | 2020年10月19日 | - | 14年 | 曾任长城证券有限责任公司金融研究所股票行业研究员、瑞银证券有限责任公司财富管理部证券分析师，2012年2月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部，历任信用研究员、投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。 |

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉

实致安 3 个月定期开放债券型发起式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，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度国内经济维持平稳恢复趋势，工业部门数据较强，主要受出口和房地产投资持续偏强的影响，而消费恢复较缓慢；地方债和专项债发行缩量，导致基建投资维持低位。社融存量增速逐月回落，主要受地方债发行的影响，银行信贷无论是总量还是结构均较好。通胀分化，PPI 数据 4、5 连续超预期上行，国内政策抑制大宗商品价格上涨，5 月份之后国内通胀压力有所减小。欧美疫苗接种率快速上升，美国经济持续复苏，需求推动原油上涨，美联储暂未明确 Taper 进度，全球主要央行维持宽松，推动资本市场风险偏好继续回升。人民币汇率升值预期下，海外资金流入，叠加国内流动性宽松，4、5 月份国内股、债均上涨，6 月份债市调整，权益市场宽幅震荡。

整个二季度债券先涨后跌，震荡幅度不大，无明显趋势。组合债券资产投资以票息策略为主，并阶段性进行利率债交易，组合信用债久期控制在 2 年左右，二季度适当调整了信用债投资策略，减持流动性较差的弱资质债券，加仓高等级信用债和部分存单，维持中等杠杆。

权益方面，4 月份加仓成长和顺周期板块，以及部分低价转债作为配置；5 月份减持了顺周期板块，特别是大宗商品相关的钢铁板块，加仓消费板块；6 月份重点加仓了新能源汽车产业链相关的转债，适当加仓科创板股票。整个二季度权益仓位灵活调整，控制组合波动。

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 1.0332 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.08%，业绩比较基准收益率为 0.84%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金为发起式基金，不适用。

§ 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 | 35,828,767.71 | 5.32 |
| | 其中：股票 | 35,828,767.71 | 5.32 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 617,013,986.83 | 91.56 |
| | 其中：债券 | 617,013,986.83 | 91.56 |
| | 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 | 4,689,784.39 | 0.70 |
| 8 | 其他资产 | 16,352,498.20 | 2.43 |
| 9 | 合计 | 673,885,037.13 | 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

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|---------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 18,799,917.50 | 3.59 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 203,520.00 | 0.04 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,997,530.21 | 0.38 |
| J | 金融业 | 14,827,800.00 | 2.83 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|------|
| K | 房地产业 | | - |
| L | 租赁和商务服务业 | | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | | - |
| P | 教育 | | - |
| Q | 卫生和社会工作 | | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | | - |
| S | 综合 | | - |
| | 合计 | 35,828,767.71 | 6.85 |

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

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 601166 | 兴业银行 | 300,000 | 6,165,000.00 | 1.18 |
| 2 | 300083 | 创世纪 | 489,700 | 5,362,215.00 | 1.02 |
| 3 | 601288 | 农业银行 | 1,500,000 | 4,545,000.00 | 0.87 |
| 4 | 603113 | 金能科技 | 200,000 | 3,612,000.00 | 0.69 |
| 5 | 688026 | 洁特生物 | 31,445 | 2,707,414.50 | 0.52 |
| 6 | 601939 | 建设银行 | 400,000 | 2,660,000.00 | 0.51 |
| 7 | 603160 | 汇顶科技 | 20,000 | 2,592,600.00 | 0.50 |
| 8 | 603987 | 康德莱 | 85,940 | 2,234,440.00 | 0.43 |
| 9 | 688229 | 博睿数据 | 26,377 | 1,997,530.21 | 0.38 |
| 10 | 603986 | 兆易创新 | 10,000 | 1,879,000.00 | 0.36 |

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 7,926,088.50 | 1.51 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 101,339,000.00 | 19.37 |
| | 其中：政策性金融债 | 91,527,000.00 | 17.49 |
| 4 | 企业债券 | 80,321,000.00 | 15.35 |

| | | | |
|----|-----------|----------------|--------|
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 300,903,000.00 | 57.50 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 68,230,898.33 | 13.04 |
| 8 | 同业存单 | 58,294,000.00 | 11.14 |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 617,013,986.83 | 117.91 |

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 | 101901748 | 19 海淀国资 MTN003 | 500,000 | 48,840,000.00 | 9.33 |
| 2 | 101901000 | 19 招商局 MTN007A | 400,000 | 40,612,000.00 | 7.76 |
| 3 | 155870 | 19 信保 Y1 | 400,000 | 40,248,000.00 | 7.69 |
| 4 | 112103019 | 21 农业银行 CD019 | 400,000 | 38,844,000.00 | 7.42 |
| 5 | 101751032 | 17 金隅 MTN001 | 300,000 | 30,978,000.00 | 5.92 |

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

5.10 投资组合报告附注

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

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

2020 年 7 月 13 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）36 号），对向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告、批量处置不良资产未向监管部门报告等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第（五）项，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。2021 年 1 月 19 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）1 号），对发生重要信息系统突发事件未报告等违法违规行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 420 万元的行政处罚。

本基金投资于“20 国开 19（200219）”、“21 农业银行 CD019（112103019）”的决策程序说明：基于对 20 国开 19、21 农业银行 CD019 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“20 国开 19”、“21 农业银行 CD019”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 113,706.82 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,491,760.38 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 11,747,031.00 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |

| | | |
|---|------|---------------|
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 16,352,498.20 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1 | 110059 | 浦发转债 | 11,270,372.90 | 2.15 |
| 2 | 123067 | 斯莱转债 | 6,570,000.00 | 1.26 |
| 3 | 110053 | 苏银转债 | 6,068,000.00 | 1.16 |
| 4 | 113534 | 鼎胜转债 | 5,698,136.40 | 1.09 |
| 5 | 128074 | 游族转债 | 4,659,600.00 | 0.89 |
| 6 | 113508 | 新风转债 | 3,894,300.00 | 0.74 |
| 7 | 123083 | 朗新转债 | 3,680,447.98 | 0.70 |
| 8 | 113548 | 石英转债 | 3,339,600.00 | 0.64 |
| 9 | 123077 | 汉得转债 | 2,047,683.06 | 0.39 |
| 10 | 113545 | 金能转债 | 1,686,500.90 | 0.32 |
| 11 | 123079 | 运达转债 | 648,390.98 | 0.12 |
| 12 | 113579 | 健友转债 | 607,807.20 | 0.12 |
| 13 | 113044 | 大秦转债 | 291,235.30 | 0.06 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 506,467,522.94 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - |
| 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 | 506,467,522.94 |

§ 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

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,310,460.75 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,310,460.75 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%) | 2.04 |

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|------------------|---------------|------------------|------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,310,460.75 | 2.04 | 10,310,460.75 | 2.04 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,310,460.75 | 2.04 | 10,310,460.75 | 2.04 | 3 年 |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 1 | 2021/04/01 | 496,157,062.19 | - | - | 496,157,062.19 | 97.96 |

| | | | | | | |
|--|--|------------|--|--|--|--|
| 构 | | 至 | | | | |
| | | 2021/06/30 | | | | |
| 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。</p> | | | | | | |

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

10.2 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

10.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 7 月 20 日