

# 嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起 式证券投资基金 2021 年中期报告

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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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                                | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 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             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 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 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 16        |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 6.4 报表附注                                | 19        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 39        |
| 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       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 39        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 39        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 39        |
| 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 ..... | 40        |
| 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 ..... | 40        |
| 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 .....    | 40        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 40        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 40        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>41</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 41        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 41        |
| 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 .....      | 41        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                   | 42        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>42</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>42</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 42        |
| 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 .....      | 42        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 43        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 43        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 43        |
| 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 .....         | 43        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 43        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 45        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>46</b> |
| 11.1 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 .....    | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 错误!未定义书签。 |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 46        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 47        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 47        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                             |
|------------|-----------------------------|
| 基金名称       | 嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 嘉实致禄 3 个月定期纯债债券             |
| 基金主代码      | 007986                      |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                      |
| 基金合同生效日    | 2019 年 12 月 4 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              |
| 报告期末基金份额总额 | 1,100,839,854.98 份          |
| 基金合同存续期    | 不定期                         |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 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</p> <p>1、债券投资策略：本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。具体包括：利率策略、信用债券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略。</p> <p>2、资产支持证券投资策略：本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>(二) 开放期投资策略</p> <p>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  |
| 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。   |

### 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 | 上海浦东发展银行股份有限公司 |
| 信息披露 姓名 | 胡勇钦        | 胡波             |

|        |      |   |                  |
|--------|------|---|------------------|
| 负责人    | 联系电话 | (010)65215588                               | 021-61618888     |
|        | 电子邮箱 | service@jsfund.cn                           | Hub5@spdb.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 400-600-8800                                | 95528            |
| 传真     |      | (010)65215588                               | 021-63602540     |
| 注册地址   |      | 中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元 | 上海市中山东一路 12 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       | 上海市北京东路 689 号    |
| 邮政编码   |      | 100005                                      | 200001           |
| 法定代表人  |      | 经雷  | 郑杨               |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》   |
| 登载基金中期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(2021年1月1日-2021年6月30日) |
|---------------|---------------------------|
| 本期已实现收益       | 18,763,823.15             |
| 本期利润          | 18,240,698.82             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0148                    |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.47%                     |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.50%                     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日)          |
| 期末可供分配利润      | 1,936,140.13              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0018                    |
| 期末基金资产净值      | 1,103,035,807.19          |
| 期末基金份额净值      | 1.0020                    |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年6月30日)          |
| 基金份额累计净值增长率   | 4.35%                     |

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) 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

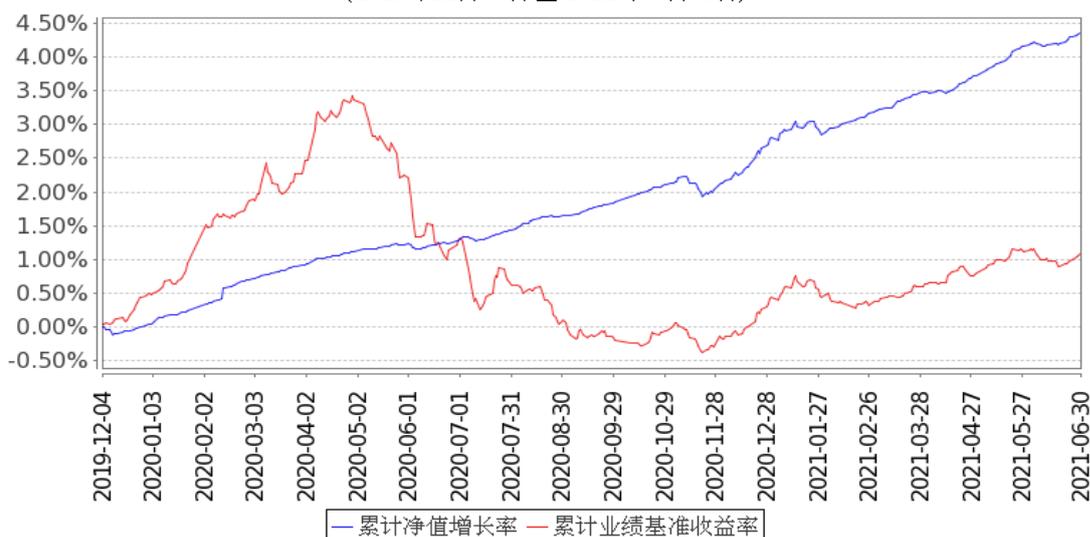
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 0.17%    | 0.02%       | -0.04%     | 0.03%         | 0.21% | -0.01% |
| 过去三个月      | 0.84%    | 0.02%       | 0.45%      | 0.03%         | 0.39% | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.50%    | 0.03%       | 0.65%      | 0.04%         | 0.85% | -0.01% |
| 过去一年       | 3.03%    | 0.02%       | -0.20%     | 0.06%         | 3.23% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.35%    | 0.02%       | 1.09%      | 0.08%         | 3.26% | -0.06% |

### 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

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

(2019年12月04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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的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，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 223 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联

接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉

实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合、嘉实民安添岁稳健养老一年持有期混合 (FOF)、嘉实港股优势混合、嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证软件服务 ETF、嘉实品质回报混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实浦盈一年持有期混合、嘉实中证稀土产业 ETF、嘉实阿尔法优选混合、嘉实中证大农业 ETF、嘉实匠心回报混合、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实价值臻选混合、嘉实品质优选股票、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实领先优势混合、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合 (FOF)、嘉实优势精选混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 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 |        |  |
| 常道遥 | 本基金、嘉实稳泽纯债债券、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实致益纯债债券基金 | 2021 年 1 月 23 日 | -    | 12 年   | 曾任易方达基金管理有限公司固定收益部研究助理、固定收益交易部交易员、高级债券交易员，2020 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于固收投研体系，中国国籍。 |

|     |  |                  |                 |      |   |
|-----|--|------------------|-----------------|------|---|
|     | 经理   |                  |                 |      |   |
| 张文佳 | 本基金、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实稳泽纯债债券、嘉实稳荣债券、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实稳熙纯债债券、嘉实致兴定期纯债债券基金经理助理。 | 2021 年 4 月 20 日  | -               | 4 年  | 曾任中欧基金管理有限公司宏观及债券策略研究助理、债券投资基金经理助理。现任嘉实基金管理有限公司债券投资基金经理助理。硕士研究生。中国国籍。 |
| 尹页  | 本基金基金经理  | 2019 年 12 月 11 日 | 2021 年 1 月 23 日 | 12 年 | 曾任英大证券咨询分析师、债券交易员；金鹰基金债券交易员；2014 年 4 月加入                              |

|  |  |   |  |  |   |
|--|--|---|--|--|---|
|  |  | 日 |  |  | 嘉实基金管理有限公司，历任债券交易员、投资经理，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。 |
|--|--|---|--|--|---|

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、《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债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 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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

## 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

回顾我国上半年经济形势，总量上显示出韧性，主要是由于出口和地产的高景气度对经济形成支持，但经济结构分化问题比较突出，消费修复缓慢、基建和制造业投资偏弱，大学生、农民工等就业压力升温，经济增长的环比动能也呈现一定的下行势头。同时社融增速快速下行，一方面与地方债发行不及预期有关，另一方面随着对地产监管进一步收紧和地方隐性债务的压降，上半年展现出紧信用的格局。

就债券市场而言，虽然经济数据显示出韧性，大宗商品价格持续上涨，通胀预期快速升温，但债市整体情绪保持乐观，并未显著交易通胀因素，原因主要是两点：一是，国内货币政策始终传递出“稳定”的信号，政治局和央行都明确表态，经济复苏基础不牢固，政策不会急转弯，资金面也维持宽松环境。二是，信用风险偏好回落，非标资产严监管，地方债发行不及预期，整体形成了对安全债券资产，如利率债、银行永续债、优质区域城投债的追捧，产生了“安全资产荒”的现象。

回顾上半年，资金面除了 1 月下旬超预期紧张外，整体维持稳定略偏宽松的局面，短端利率也随之震荡下行 5bp 左右。长端利率交易情绪则比较焦灼，1 月中旬到 2 月初，在通胀预期和货币紧缩预期的不断升温下，10 年国债冲高至 3.3% 以上，后续随着情绪修复，逐渐震荡下行至 3.10% 附近。信用债方面，一季度信用债情绪较差，弱资质城投、过剩产能产业债遭到市场抛售，市场风险偏好延续极低的水平；后续随着 3、4 月份信用债到期高峰安全度过，情绪有一定的修复，但由于弱资质主体直接融资未见显著修复，信用分化格局仍未根本扭转。

报告期内组合积极运用久期策略，参与利率债交易机会，为组合净值提供一定的正贡献。信用债择机减持风险个券，择机加仓高等级信用债，提升组合抗风险能力。

#### 4.4.2 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 1.0020 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.50%，业绩比较基准收益率为 0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后期，短期内经济基本面在总量上仍有望维持韧性，但随着大宗商品涨价对中下游和中小微企业成本的推升，经济中结构性问题也愈加严峻。7 月的普遍降准政策也主要是为了支持中小微企业，并对经济潜在的下行压力进行对冲。考虑到降准后债券市场快速下行 15bp-20bp，债券市场对经济的下行压力和货币政策的放松有较为充分的定价，短期内利率进一步快速下行的空间和动力有限。拉长期限来看，随着海外疫苗接种推进，供给能力恢复，我国出口的高增速也将有所回落；社融增速回落的环境下，内需大概率也会逐显疲态。但考虑到我国仍面临较高的债务压力，难以承受融资利率的大幅上行，因此债券利率也不具备显著的上行空间；在经济基本面给出更加明确的走弱信号后，利率债有望进一步打开下行空间。

信用债市场方面，我们认为 2021 年仍是长期渐进的债务出清过程，信用风险释放节奏与融资环境波动密切相关，二季度高收益债情绪虽有边际转好，但若干弱资质主体一级债券发行尚未恢复正常，近期出台的银保监会 15 号文对弱资质城投再融资边际影响较大，信用风险点状爆发仍将持续，信用利差有再次走扩的可能。

#### 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“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

本基金为发起式基金，不适用。

### § 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内进行了 2 次利润分配，分红金额为 17,818,713.93 元、6,824,809.84 元。

#### 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

本报告期内，由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的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”部分未在托管人

复核范围内)、投资组合报告等内容真实、准确、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：嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 646,834.52                     | 640,049.06                       |
| 结算备付金           |            | -                              | 12,640.65                        |
| 存出保证金           |            | 3.29                           | 10,081.08                        |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,460,030,951.20               | 1,624,727,838.40                 |
| 其中：股票投资         |            | -                              | -                                |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 1,460,030,951.20               | 1,624,727,838.40                 |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | -                              | 21,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | -                              | 2,012,623.84                     |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 19,112,562.27                  | 29,475,731.31                    |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 1,479,790,351.28               | 1,677,878,964.34                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 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       |            | 376,068,715.89                 | 367,200,729.19                   |
| 应付证券清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 273,022.27                     | 331,387.70                       |
| 应付托管费           |            | 91,007.41                      | 110,462.58                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 27,052.60                      | 22,425.78                        |

|               |          |                  |                  |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应交税费          |          | 81,800.46        | 144,567.08       |
| 应付利息          |          | 108,807.11       | 264,810.19       |
| 应付利润          |          | -                | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 104,138.35       | 210,000.00       |
| 负债合计          |          | 376,754,544.09   | 368,284,382.52   |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 1,100,839,854.98 | 1,300,636,054.48 |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 2,195,952.21     | 8,958,527.34     |
| 所有者权益合计       |          | 1,103,035,807.19 | 1,309,594,581.82 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 1,479,790,351.28 | 1,677,878,964.34 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0020 元，基金份额总额 1,100,839,854.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                | 附注号        | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|-------------------|------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                   |            | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 一、收入              |            | 22,878,281.68                   | 8,853,135.13                    |
| 1. 利息收入           |            | 27,850,136.03                   | 18,820,118.56                   |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.11   | 71,008.65                       | 117,345.06                      |
| 债券利息收入            |            | 26,804,806.41                   | 17,904,353.13                   |
| 资产支持证券利息收入        |            | -                               | -                               |
| 买入返售金融资产收入        |            | 974,320.97                      | 798,420.37                      |
| 证券出借利息收入          |            | -                               | -                               |
| 其他利息收入            |            | -                               | -                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |            | -4,448,730.02                   | -9,176,021.58                   |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.12   | -                               | -                               |
| 基金投资收益            | -          | -                               | -                               |
| 债券投资收益            | 6.4.7.13   | -4,448,730.02                   | -9,176,021.58                   |
| 资产支持证券投资收益        | 6.4.7.13.5 | -                               | -                               |
| 贵金属投资收益           | 6.4.7.14   | -                               | -                               |
| 衍生工具收益            | 6.4.7.15   | -                               | -                               |
| 股利收益              | 6.4.7.16   | -                               | -                               |
| 3. 公允价值变动收益（损失    | 6.4.7.17   | -523,124.33                     | -790,961.85                     |

|                     |          |               |              |
|---------------------|----------|---------------|--------------|
| 以“-”号填列)            |          |               |              |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)  |          |               | -            |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)  | 6.4.7.18 |               | -            |
| 减: 二、费用             |          | 4,637,582.86  | 1,805,951.54 |
| 1. 管理人报酬            | -        | 1,846,968.53  | 1,102,777.10 |
| 2. 托管费              | -        | 615,656.19    | 367,592.35   |
| 3. 销售服务费            | -        | -             | -            |
| 4. 交易费用             | 6.4.7.19 | 17,603.04     | 25,180.76    |
| 5. 利息支出             |          | 1,944,713.40  | 128,161.41   |
| 其中: 卖出回购金融资产支出      |          | 1,944,713.40  | 128,161.41   |
| 6. 税金及附加            |          | 75,721.80     | 63,407.41    |
| 7. 其他费用             | 6.4.7.20 | 136,919.90    | 118,832.51   |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |          | 18,240,698.82 | 7,047,183.59 |
| 减: 所得税费用            |          | -             | -            |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |          | 18,240,698.82 | 7,047,183.59 |

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

| 项目                                | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |               |                  |
|-----------------------------------|---------------------------------------|---------------|------------------|
|                                   | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益(基金净值)                   | 1,300,636,054.48                      | 8,958,527.34  | 1,309,594,581.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)          | -                                     | 18,240,698.82 | 18,240,698.82    |
| 三、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) | -199,796,199.50                       | -359,750.18   | -200,155,949.68  |
| 其中: 1. 基金申购款                      | 203,800.50                            | 249.82        | 204,050.32       |
| 2. 基金赎回款                          | -200,000,000.00                       | -360,000.00   | -200,360,000.00  |

|  |  |                |                  |
|--|--|----------------|------------------|
| 四、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） | -  | -24,643,523.77 | -24,643,523.77   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,100,839,854.98                           | 2,195,952.21   | 1,103,035,807.19 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 210,008,000.00                             | 79,573.61      | 210,087,573.61   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 7,047,183.59   | 7,047,183.59     |
| 三、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）      | 1,090,417,802.18                           | 9,580,197.82   | 1,099,998,000.00 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 1,090,417,802.18                           | 9,580,197.82   | 1,099,998,000.00 |
| 2. 基金赎回款                               | -  | -              | -                |
| 四、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） | -  | -              | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,300,425,802.18                           | 16,706,955.02  | 1,317,132,757.20 |

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

黄志泉

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金(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[2019]1663 号《关于准予嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复》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《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式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,《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,008,000.00 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,基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

### 6.4.2 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》、《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》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。

### 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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 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

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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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股票、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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(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。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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。

## 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 646,834.52             |
| 定期存款           | -                      |
| 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           | -                      |
| 合计             | 646,834.52             |

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                  |
|---------------|------------------------|------------------|------------------|
|               | 成本                     | 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                  | 22,883,773.24    | 22,370,951.20    |
|               | 银行间市场                  | 1,437,348,571.90 | 1,437,660,000.00 |
|               | 合计                     | 1,460,232,345.14 | 1,460,030,951.20 |
| 资产支持证券        | -                      | -                | -                |
| 基金            | -                      | -                | -                |
| 其他            | -                      | -                | -                |
| 合计            | 1,460,232,345.14       | 1,460,030,951.20 | -201,393.94      |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

|            | 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|-----------------|
| 应收活期存款利息   | 1,386.83        |
| 应收定期存款利息   | -               |
| 应收其他存款利息   | -               |
| 应收结算备付金利息  | -               |
| 应收债券利息     | 19,111,175.44   |
| 应收资产支持证券利息 | -               |
| 应收买入返售证券利息 | -               |
| 应收申购款利息    | -               |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -               |
| 应收出借证券利息   | -               |
| 其他         | -               |
| 合计         | 19,112,562.27   |

#### 6.4.7.6 其他资产

无。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                      |
| 银行间市场应付交易费用 | 27,052.60              |
| 合计          | 27,052.60              |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 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   | -                      |
| 预提费用        | 104,138.35             |
| 合计          | 104,138.35             |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,300,636,054.48                      | 1,300,636,054.48 |
| 本期申购          | 203,800.50                            | 203,800.50       |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -200,000,000.00                       | -200,000,000.00  |
| - 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           | 1,100,839,854.98 | 1,100,839,854.98 |

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分       | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|-------------|----------------|
| 上年度末           | 8,559,326.85   | 399,200.49  | 8,958,527.34   |
| 本期利润           | 18,763,823.15  | -523,124.33 | 18,240,698.82  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -743,486.10    | 383,735.92  | -359,750.18    |
| 其中：基金申购款       | 774.41         | -524.59     | 249.82         |
| 基金赎回款          | -744,260.51    | 384,260.51  | -360,000.00    |
| 本期已分配利润        | -24,643,523.77 | -           | -24,643,523.77 |
| 本期末            | 1,936,140.13   | 259,812.08  | 2,195,952.21   |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入  | 69,284.68                       |
| 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 | 1,690.82                        |
| 其他        | 33.15                           |
| 合计        | 71,008.65                       |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.13 债券投资收益

## 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -4,448,730.02              |
| 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                            | -4,448,730.02              |

## 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,846,720,952.10           |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,816,578,166.44           |
| 减：应收利息总额                | 34,591,515.68              |
| 买卖债券差价收入                | -4,448,730.02              |

## 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.14 贵金属投资收益

## 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

## 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

## 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.15 衍生工具收益

## 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.16 股利收益

无。

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -523,124.33                     |
| 股票投资                   | -                               |
| 债券投资                   | -523,124.33                     |
| 资产支持证券投资               | -                               |
| 基金投资                   | -                               |
| 贵金属投资                  | -                               |
| 其他                     | -                               |
| 2. 衍生工具                | -                               |
| 权证投资                   | -                               |
| 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                     | -523,124.33                     |

## 6.4.7.18 其他收入

无。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 53.04                                 |
| 银行间市场交易费用 | 17,550.00                             |
| 合计        | 17,603.04                             |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用      | 44,630.98                             |
| 信息披露费     | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金   | -                                     |
| 银行划款手续费   | 14,081.55                             |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00                             |
| 其他        | 700.00                                |
| 合计        | 136,919.90                            |

#### 6.4.7.21 分部报告

无。

#### 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

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 2021 年 7 月 21 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0200 元。

#### 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   |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 基金托管人   |

#### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>6 月 30 日 |
|-----------------|--|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,846,968.53                             | 1,102,777.10                                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -  | -   |

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 0.3% 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 × 0.3% / 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 |
|----|--------------------------------|-----------------------------------|
|----|--------------------------------|-----------------------------------|

|                | 月 30 日     | 6 月 30 日   |
|----------------|------------|------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 615,656.19 | 367,592.35 |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

#### 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<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                   |      |       |      |       |      |
|--|-------------------|------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场交易的<br>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 |
| -  | -                 | -    | -     | -    | -     | -    |
| 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                   |      |       |      |       |      |
| 银行间市场交易的<br>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 |
| 上海浦东发展银行<br>股份有限公司                         | 40,960,26<br>7.54 | -    | -     | -    | -     | -    |

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目           | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6<br>月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020<br>年 6 月 30 日 |
|--------------|--|---|
| 报告期初持有的基金份额  | 10,210,252.30                            | 10,000,000.00                                 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 203,800.50                               | -   |
| 报告期间因拆分变动份额  | -  | -   |

|                     |               |               |
|---------------------|---------------|---------------|
| 减：报告期内赎回/卖出总份额      | -             | -             |
| 报告期末持有的基金份额         | 10,414,052.80 | 10,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.95%         | 0.77%         |

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。

#### 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<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020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     |
| 上海浦东发展银行股份有限公司_活期 | 646,834.52                 | 69,284.68 | 2,571,216.68                    | 106,408.61 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司_定期 | -                          | -         | -                               | 3,530.44   |

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

单位：人民币元

| 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  | 2021年4月22日 | -   | 2021年4月22日 | 0.1370      | 17,678,833.48 | 139,880.45 | 17,818,713.93 | -  |
| 2  | 2021年6月25日 | -   | 2021年6月25日 | 0.0620      | 6,760,639.97  | 64,169.87  | 6,824,809.84  | -  |
| 合计 | -          | -   | -          | 0.1990      | 24,439,473.45 | 204,050.32 | 24,643,523.77 | -  |

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 2021 年 7 月 21 日登记在册的全体基金份额持有人进行利润分配，每 10 份基金份额派发红利 0.0200 元。

#### 6.4.12 期末(2021 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 2021 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 376,068,715.89 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         |
|-----------|---------------|----------------|--------|-----------|----------------|
| 190409    | 19 农发 09      | 2021 年 7 月 1 日 | 100.49 | 500,000   | 50,245,000.00  |
| 200203    | 20 国开 03      | 2021 年 7 月 1 日 | 100.33 | 500,000   | 50,165,000.00  |
| 180206    | 18 国开 06      | 2021 年 7 月 2 日 | 105.39 | 200,000   | 21,078,000.00  |
| 190207    | 19 国开 07      | 2021 年 7 月 2 日 | 100.60 | 800,000   | 80,480,000.00  |
| 200203    | 20 国开 03      | 2021 年 7 月 2 日 | 100.33 | 200,000   | 20,066,000.00  |
| 200212    | 20 国开 12      | 2021 年 7 月 2 日 | 100.50 | 300,000   | 30,150,000.00  |
| 210203    | 21 国开 03      | 2021 年 7 月 2 日 | 100.29 | 200,000   | 20,058,000.00  |
| 101900369 | 19 南电 MTN004  | 2021 年 7 月 5 日 | 100.73 | 74,000    | 7,454,020.00   |
| 012101655 | 21 京国资 SCP003 | 2021 年 7 月 6 日 | 100.12 | 346,000   | 34,641,520.00  |
| 101900369 | 19 南电 MTN004  | 2021 年 7 月 6 日 | 100.73 | 326,000   | 32,837,980.00  |
| 102000944 | 20 中石油 MTN004 | 2021 年 7 月 6 日 | 98.19  | 400,000   | 39,276,000.00  |
| 合计        |               |                |        | 3,846,000 | 386,451,520.00 |

#### 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

本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。基金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。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。

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。

#### 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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | 90,280,000.00          | 110,307,000.00           |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 430,662,000.00         | 399,488,000.00           |
| 合计     | 520,942,000.00         | 509,795,000.00           |

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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 342,123,000.00         | 331,619,000.00           |
| AAA 以下 | 185,538,951.20         | 420,519,838.40           |
| 未评级    | -                      | -                        |
| 合计     | 527,661,951.20         | 752,138,838.40           |

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<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
|--------|------------------------|--------------------------|

|        |               |   |
|--------|---------------|---|
| AAA    | 48,580,000.00 | - |
| AAA 以下 | -             | - |
| 未评级    | -             | - |
| 合计     | 48,580,000.00 | - |

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。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。

##### 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时间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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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 6.4.12 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。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021 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                   | 646,834.52     | -              | -             | -             | 646,834.52       |
| 结算备付金                  | -              | -              | -             | -             | -                |
| 存出保证金                  | 3.29           | -              | -             | -             | 3.29             |
| 交易性金融资产                | 923,376,951.20 | 496,154,000.00 | 40,500,000.00 | -             | 1,460,030,951.20 |
| 衍生金融资产                 | -              | -              | -             | -             | -                |
| 买入返售金融资产               | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应收证券清算款                | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应收利息                   | -              | -              | -             | 19,112,562.27 | 19,112,562.27    |
| 应收股利                   | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应收申购款                  | -              | -              | -             | -             | -                |
| 递延所得税资产                | -              | -              | -             | -             | -                |
| 其他资产                   | -              | -              | -             | -             | -                |
| 资产总计                   | 924,023,789.01 | 496,154,000.00 | 40,500,000.00 | 19,112,562.27 | 1,479,790,351.28 |
| 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              | 376,068,715.89 | -              | -             | -             | 376,068,715.89   |
| 应付证券清算款                | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应付赎回款                  | -              | -              | -             | -             | -                |
| 应付管理人报酬                | -              | -              | -             | 273,022.27    | 273,022.27       |

|                          |                  |                |                |               |                  |
|--------------------------|------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付托管费                    | -                | -              | -              | 91,007.41     | 91,007.41        |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -              | -             | -                |
| 应付交易费用                   | -                | -              | -              | 27,052.60     | 27,052.60        |
| 应付税费                     | -                | -              | -              | 81,800.46     | 81,800.46        |
| 应付利息                     | -                | -              | -              | 108,807.11    | 108,807.11       |
| 应付利润                     | -                | -              | -              | -             | -                |
| 递延所得税负债                  | -                | -              | -              | -             | -                |
| 其他负债                     | -                | -              | -              | 104,138.35    | 104,138.35       |
| 负债总计                     | 376,068,715.89   | -              | -              | 685,828.20    | 376,754,544.09   |
| 利率敏感度缺口                  | 547,955,073.12   | 496,154,000.00 | 40,500,000.00  | 18,426,734.07 | 1,103,035,807.19 |
| 上年度末<br>2020 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                     | 640,049.06       | -              | -              | -             | 640,049.06       |
| 结算备付金                    | 12,640.65        | -              | -              | -             | 12,640.65        |
| 存出保证金                    | 10,081.08        | -              | -              | -             | 10,081.08        |
| 交易性金融资产                  | 1,005,174,641.80 | 357,292,703.40 | 262,260,493.20 | -             | 1,624,727,838.40 |
| 衍生金融资产                   | -                | -              | -              | -             | -                |
| 买入返售金融资产                 | 21,000,000.00    | -              | -              | -             | 21,000,000.00    |
| 应收证券清算款                  | -                | -              | -              | 2,012,623.84  | 2,012,623.84     |
| 应收利息                     | -                | -              | -              | 29,475,731.31 | 29,475,731.31    |
| 应收股利                     | -                | -              | -              | -             | -                |
| 应收申购款                    | -                | -              | -              | -             | -                |
| 递延所得税资产                  | -                | -              | -              | -             | -                |
| 其他资产                     | -                | -              | -              | -             | -                |
| 资产总计                     | 1,026,837,412.59 | 357,292,703.40 | 262,260,493.20 | 31,488,355.15 | 1,677,878,964.34 |
| 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                | 367,200,729.19   | -              | -              | -             | 367,200,729.19   |
| 应付证券清算款                  | -                | -              | -              | -             | -                |
| 应付赎回款                    | -                | -              | -              | -             | -                |
| 应付管理人报酬                  | -                | -              | -              | 331,387.70    | 331,387.70       |
| 应付托管费                    | -                | -              | -              | 110,462.58    | 110,462.58       |
| 应付销售服务费                  | -                | -              | -              | -             | -                |
| 应付交易费用                   | -                | -              | -              | 22,425.78     | 22,425.78        |
| 应付税费                     | -                | -              | -              | 144,567.08    | 144,567.08       |
| 应付利息                     | -                | -              | -              | 264,810.19    | 264,810.19       |
| 应付利润                     | -                | -              | -              | -             | -                |
| 递延所得税负债                  | -                | -              | -              | -             | -                |
| 其他负债                     | -                | -              | -              | 210,000.00    | 210,000.00       |
| 负债总计                     | 367,200,729.19   | -              | -              | 1,083,653.33  | 368,284,382.52   |

|         |                |                |                |               |                  |
|---------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 利率敏感度缺口 | 659,636,683.40 | 357,292,703.40 | 262,260,493.20 | 30,404,701.82 | 1,309,594,581.82 |
|---------|----------------|----------------|----------------|---------------|------------------|

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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点      | -4,826,696.45               | -8,291,536.29     |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 4,877,071.43                | 8,443,948.10      |

#### 6.4.13.4.2 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。

##### 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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020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。

#### 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（2021年6月30日）             | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升<br>5%     | -                           | -                 |
|    | 业绩比较基准下降<br>5%     | -                           | -                 |

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为 1,460,030,951.20 元，无属于第三层次的余额（上年度末：无属于第一层次的余额，第二层次 1,624,727,838.40 元，无属于第三层次的余额）。

###### (ii) 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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            | 1,460,030,951.20 | 98.66         |
|    | 其中：债券             | 1,460,030,951.20 | 98.66         |
|    | 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      | 646,834.52       | 0.04          |
| 8  | 其他各项资产            | 19,112,565.56    | 1.29          |
| 9  | 合计                | 1,479,790,351.28 | 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      | -                | -             |
| 2  | 央行票据      | -                | -             |
| 3  | 金融债券      | 413,172,000.00   | 37.46         |
|    | 其中：政策性金融债 | 362,847,000.00   | 32.90         |
| 4  | 企业债券      | 66,638,951.20    | 6.04          |
| 5  | 企业短期融资券   | 520,942,000.00   | 47.23         |
| 6  | 中期票据      | 410,698,000.00   | 37.23         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -             |
| 8  | 同业存单      | 48,580,000.00    | 4.40          |
| 9  | 其他        | -                | -             |
| 10 | 合计        | 1,460,030,951.20 | 132.36        |

## 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  | 190207    | 19 国开 07          | 800,000 | 80,480,000.00 | 7.30          |
| 2  | 200203    | 20 国开 03          | 700,000 | 70,231,000.00 | 6.37          |
| 3  | 102002092 | 20 铜陵有色<br>MTN001 | 500,000 | 50,790,000.00 | 4.60          |

|   |           |                  |         |               |      |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 4 | 101901598 | 19 汇金<br>MTN019  | 500,000 | 50,410,000.00 | 4.57 |
| 5 | 102000043 | 20 申迪<br>MTN001  | 500,000 | 50,325,000.00 | 4.56 |
| 6 | 1822031   | 18 奇瑞徽银<br>汽车 01 | 500,000 | 50,325,000.00 | 4.56 |

**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**

无。

**7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**7.10.3 本期国债期货投资评价**

无。

**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**

(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。

本基金投资于“19 国开 07（190207）”、“20 国开 03（200203）”的决策程序说明：基于对 19 国开 07、20 国开 03 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“19 国开 07”、“20 国开 03”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。

**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   | 3.29          |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 19,112,562.27 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 19,112,565.56 |

## 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

| 持有人户数<br>(户) | 户均持有的基金<br>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<br>例 (%) | 持有份额  | 占总份额比<br>例 (%) |
| 2            | 550,419,927.49 | 1,100,839,854.98 | 100.00         | -     | -              |

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 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                                 | 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<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0                  |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                  |

## 8.4 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   | 10,414,052.80 | 0.95             | 10,414,052.80 | 0.95             | 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          | 10,414,052.80 | 0.95             | 10,414,052.80 | 0.95             | 3 年        |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                  |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 12 月 4 日）基金份额总额 | 210,008,000.00   |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 1,300,636,054.48 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 203,800.50       |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 200,000,000.00   |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）       | -                |
| 本报告期末基金份额总额                    | 1,100,839,854.98 |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

## § 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

2021 年 1 月 23 日本基金管理人发布《关于嘉实致禄 3 个月定期纯债债券基金经理变更的公告》，尹页先生不再担任本基金基金经理，聘请常逍遥女士管理本基金。

2021 年 5 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》，杨

竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

(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，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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(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

报告期内，本基金管理人、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。

### 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 |    |
| 渤海证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券股份有限公司   | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 江海证券有        | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 限公司                  |   |   |   |   |   |   |
| 申万宏源证<br>券有限公司       | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股<br>份有限公司       | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金<br>融股份有限<br>公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证<br>券股份有限<br>公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券华<br>南股份有限<br>公司 | 1 | - | - | - | - | - |

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 |
| 渤海证券股份有限<br>公司 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|              |               |        |                |         |   |   |
|--------------|---------------|--------|----------------|---------|---|---|
| 长江证券股份有限公司   | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 华泰证券股份有限公司   | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 江海证券有限公司     | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 申万宏源证券有限公司   | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | 34,938.00     | 0.07%  | 188,100,000.00 | 100.00% | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | -             | -      | -              | -       | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 52,999,000.00 | 99.93% | -              | -       | - | - |
| 中信证券华南股份有限公司 | -             | -      | -              | -       | - | - |

## 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  | 关于嘉实致禄 3 个月定期纯债债券第四个开放期开放申购、赎回业务的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 01 月 07 日 |
| 2  | 关于嘉实致禄 3 个月定期纯债债券基金经理变更的公告                  | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 01 月 23 日 |
| 3  | 关于嘉实致禄 3 个月定期纯债债券第五个开放期开放申购、赎回业务的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 14 日 |
| 4  | 嘉实基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告                     | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 20 日 |
| 5  | 嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年第一次收益分配公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 04 月 21 日 |
| 6  | 嘉实基金管理有限公司关于依据《公                            | 上海证券报、基金管理                  | 2021 年 04 月 28 日 |

|   |   |                             |                  |
|---|---|-----------------------------|------------------|
|   | 开募集证券投资基金侧袋机制指引(试行)》修订旗下部分基金基金合同及托管协议的公告    | 人网站及中国证监会基金电子披露网站           |                  |
| 7 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                        | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 05 月 29 日 |
| 8 | 嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金 2021 年第二次收益分配公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021 年 06 月 23 日 |

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |      |                | 报告期末持有基金情况       |          |
|--|----------------|-------------------------|------------------|------|----------------|------------------|----------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额           | 持有份额             | 份额占比 (%) |
| 机构   | 1              | 2021/01/01 至 2021/06/30 | 1,290,425,802.18 | -    | 200,000,000.00 | 1,090,425,802.18 | 99.05    |
| 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> |                |                         |                  |      |                |                  |          |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金注册的批复文件。

(2) 《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金基金合同》；

(3) 《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金托管协议》；

(4) 《嘉实致禄 3 个月定期开放纯债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) 报告期内嘉实致禄 3 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

## 12.2 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

## 12.3 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 8 月 27 日