

嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证
券投资基金
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

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

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	8
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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	45
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	45
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	45
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	45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.11 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
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
报告期末基金份额总额	4,271,287,290.57 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：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。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	李帅帅
	联系电话	(010)65215588	0755-25878287
	电子邮箱	service@jsfund.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95511-3

传真	(010)65215588	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	100020	518001
法定代表人	经雷	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	117,153,884.95
本期利润	187,556,109.68
加权平均基金份额本期利润	0.0447
本期加权平均净值利润率	4.05%
本期基金份额净值增长率	4.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	527,517,502.76
期末可供分配基金份额利润	0.1235
期末基金资产净值	4,798,804,793.33
期末基金份额净值	1.1235
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	15.84%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.56%	0.09%	0.46%	0.15%	0.10%	-0.06%
过去三个月	2.06%	0.10%	-0.08%	0.13%	2.14%	-0.03%
过去六个月	4.15%	0.09%	0.82%	0.14%	3.33%	-0.05%
过去一年	3.64%	0.10%	-0.87%	0.17%	4.51%	-0.07%
过去三年	11.35%	0.14%	1.28%	0.18%	10.07%	-0.04%
自基金合同生效起至今	15.84%	0.14%	3.15%	0.18%	12.69%	-0.04%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 85\% \times (\text{中债综合全价指数}(t) / \text{中债综合全价指数}(t-1) - 1) + 10\% \times (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

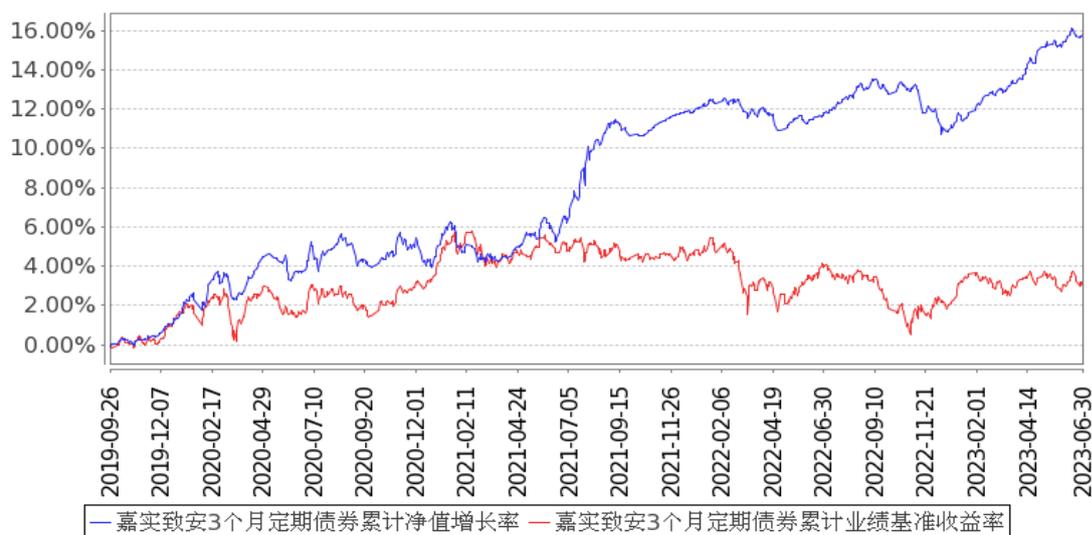
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

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

嘉实致安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2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券、嘉实中证同业存单AAA指数7天持有期基金经理	2022年5月6日	-	19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。

董福焱	本基金、嘉实策略混合、嘉实多元债券、嘉实精选平衡混合基金经理	2022 年 5 月 6 日	-	13 年	曾任英国德勤会计师事务所审计师，博时基金管理有限公司行业研究员，天弘基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司投资经理。2018 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任职于上海 GARP 投资策略组，现任基金经理。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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 6 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年经济开局良好，随着新冠感染高峰逐步回落，国内经济运行整体回升向好，市场需求稳步恢复，生产供给持续增加，但进入二季度后，经济增长斜率有所放缓，内生动力不强，需求驱动力减弱。从经济数据来看，4 月 PMI 读数回落至 50 以下，并在 5 月延续环比走弱，6 月边际改

善但仍处于荣枯线下水平，其他月度经济数据、金融数据和高频数据也逐步走弱，特别是地产销售在一季度的小阳春后也出现了显著遇冷态势；商品价格也随之调整，通胀压力显著降温。

债券市场，一季度市场出现分化行情，由于宏观基本面复苏和资金面收紧，利率债曲线呈现熊平态势，信用债由于理财赎回潮逐渐平息，信用利差修复明显，收益率整体下行。二季度伴随经济增速环比动能放缓，银行信贷投放缩量，流动性环境更加宽松，收益率出现快速下行，10 年国开收益率突破历史低点。

上半年，权益市场呈现出缺乏主线下的快速轮动行情。转债资产在纯债偏强运行和流动性宽松环境下，主要跟随权益市场波动，且表现出较强的抗跌性。转债交易热度较一季度有明显抬升，数据上体现为罕见的平价中枢、溢价率中枢双上行。

报告期内，本基金一季度积极加仓二永债和高等级信用债，提升组合杠杆和久期。6 月份降息后，及时降低仓位止盈。转债方面，报告期内组合积极参与可转债交易，转债仓位主要依据转债估值进行逆向调整，配置行业偏均衡，重点关注顺周期板块、汽车和 TMT 等板块的投资机会，积极参与转债个券交易。

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 1.1235 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.15%，业绩比较基准收益率为 0.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，政策面可能会是短期市场博弈的焦点。7 月下旬政治局会议上对地产、消费等政策的表述一定程度提振了市场信心，市场期待后续需求端政策的推出。但另一方面，“调结构”、“防风险”的整体基调延续，政策定力依然较足，短期内大规模刺激政策出台概率不大。债券市场方面，受制于利率点位较低赔率空间不足及政策预期带来的情绪冲击，收益率或面临小幅调整压力，但政策实际落地效果仍待时间验证，短期经济内生动能偏弱态势难以快速扭转，经济修复仍是曲折式前进的过程，保持流动性合理充裕仍是货币政策主基调，利率大幅上行空间有限。

转债市场，考虑到转债估值中性偏高，后期走势主要跟随权益，但下行风险小于股票，存在一定的期权价值。考虑到偏大盘价值的风格和缩量的转债市场，小票型转债配置中性偏空，若后期进一步回调，组合再择机配置平衡型转债，结构均衡。

权益市场，政治局会议对地产、城投债、资本市场的关注，宏观数据回升，以及场内机构的配置偏离，使得在这个位置开展顺周期资产的逼空行情。看好此前预期最差、分歧最大的金融地产行业，以及 PPI 见底、美联储加息见顶下的大宗商品的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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：嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	170,844,478.68	331,606,031.09
结算备付金		40,345,710.03	47,490,813.99
存出保证金		408,340.11	472,041.06
交易性金融资产	6.4.7.2	5,931,657,406.07	6,169,731,042.89
其中：股票投资		269,802,364.48	321,394,514.31
基金投资		-	-
债券投资		5,661,855,041.59	5,848,336,528.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		21,607,846.44	25,099,657.34
应收股利		620,570.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		6,165,484,351.33	6,574,399,586.37
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		1,364,057,566.86	2,022,848,255.70
应付清算款		-	37,846,394.62
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,177,624.10	1,149,707.90
应付托管费		392,541.35	328,742.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		298,481.24	211,113.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	753,344.45	765,686.65
负债合计		1,366,679,558.00	2,063,149,900.82
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,271,287,290.57	4,181,962,593.83
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	527,517,502.76	329,287,091.72
净资产合计		4,798,804,793.33	4,511,249,685.55
负债和净资产总计		6,165,484,351.33	6,574,399,586.37

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1235 元，基金份额总额 4,271,287,290.57 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		218,833,100.45	38,582,275.13
1. 利息收入		1,667,658.75	944,916.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,635,903.96	189,691.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		31,754.79	755,225.39
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		146,763,216.97	37,177,192.86
其中：股票投资收益	6.4.7.14	45,304,598.44	-8,915,979.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	98,703,756.31	45,343,256.01
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,754,862.22	749,916.46
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	70,402,224.73	460,165.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		31,276,990.77	10,178,711.79
1. 管理人报酬		6,882,490.91	4,641,074.94
2. 托管费		2,294,163.55	1,017,716.77
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		21,820,955.22	4,374,196.94
其中：卖出回购金融资产支出		21,820,955.22	4,374,196.94
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-26,809.09	-
7. 税金及附加		177,651.02	40,642.69
8. 其他费用	6.4.7.23	128,539.16	105,080.45
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		187,556,109.68	28,403,563.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		187,556,109.68	28,403,563.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		187,556,109.68	28,403,563.34

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	4,181,962,593.83	-	329,287,091.72	4,511,249,685.55

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	4,181,962,593.83	-	329,287,091.72	4,511,249,685.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	89,324,696.74	-	198,230,411.04	287,555,107.78
(一)、综合收益总额	-	-	187,556,109.68	187,556,109.68
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	89,324,696.74	-	10,674,301.36	99,998,998.10
其中:1.基金申购款	89,324,737.69	-	10,674,306.31	99,999,044.00
2.基金赎回款	-40.95	-	-4.95	-45.90
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,271,287,290.57	-	527,517,502.76	4,798,804,793.33
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	458,353,589.14	-	39,553,990.45	497,907,579.59
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	458,353,589.14	-	39,553,990.45	497,907,579.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,733,918,853.27	-	312,656,129.44	4,046,574,982.71
(一)、综合收益总额	-	-	28,403,563.34	28,403,563.34
(二)、本期基金份额交易产	3,733,918,853.27	-	284,252,566.10	4,018,171,419.37

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	4,181,961,981.66	-	318,035,017.98	4,499,996,999.64
2. 基金赎回款	-448,043,128.39	-	-33,782,451.88	-481,825,580.27
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	4,192,272,442.41	-	352,210,119.89	4,544,482,562.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实致安 3 个月定期开放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]1463 号《关于准予嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册,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《嘉实致安 3 个月定期开放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,《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 26 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》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》和在财务报表附注 6.4.4 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。

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净资产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[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	826,404.41
等于：本金	823,535.62
加：应计利息	2,868.79
减：坏账准备	-
定期存款	170,018,074.27
等于：本金	170,000,000.00
加：应计利息	31,166.67
减：坏账准备	13,092.40
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	170,018,074.27
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	170,844,478.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	310,669,753.49	-	269,802,364.48	-40,867,389.01

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,011,270,695.38	11,128,874.40	1,018,766,827.63	-3,632,742.15
	银行间市场	4,565,700,627.08	60,889,213.96	4,643,088,213.96	16,498,372.92
	合计	5,576,971,322.46	72,018,088.36	5,661,855,041.59	12,865,630.77
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	5,887,641,075.95	72,018,088.36	5,931,657,406.07	-28,001,758.24	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	652,677.68
其中：交易所市场	563,927.59
银行间市场	88,750.09
应付利息	-
预提费用	100,666.77
合计	753,344.45

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,181,962,593.83	4,181,962,593.83
本期申购	89,324,737.69	89,324,737.69
本期赎回（以“-”号填列）	-40.95	-40.95
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	4,271,287,290.57	4,271,287,290.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	427,129,170.55	-97,842,078.83	329,287,091.72
本期利润	117,153,884.95	70,402,224.73	187,556,109.68
本期基金份额交易产生的变动数	11,262,953.81	-588,652.45	10,674,301.36
其中：基金申购款	11,262,959.03	-588,652.72	10,674,306.31
基金赎回款	-5.22	0.27	-4.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	555,546,009.31	-28,028,506.55	527,517,502.76

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	42,213.73
定期存款利息收入	1,267,833.30
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	320,610.11
其他	5,246.82
合计	1,635,903.96

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,304,598.44
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	45,304,598.44

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	885,159,076.29
减：卖出股票成本总额	837,377,354.50
减：交易费用	2,477,123.35
买卖股票差价收入	45,304,598.44

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	102,653,351.61
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,949,595.30
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	98,703,756.31

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,747,649,792.62
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,686,095,148.21
减：应计利息总额	65,383,672.76
减：交易费用	120,566.95
买卖债券差价收入	-3,949,595.30

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,754,862.22
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,754,862.22

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	70,402,224.73
股票投资	-14,420,307.45
债券投资	84,822,532.18
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	70,402,224.73

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 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 6 月 30 日
银行存款	-26,809.09
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
合计	-26,809.09

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	41,159.40
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	6,600.00
深港通证券组合费	3,272.39
合计	128,539.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,882,490.91	4,641,074.94
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 0.30%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×0.30%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,294,163.55	1,017,716.77

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行股份有限公司	100,031,847.95	220,113,275.89	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行股份有限公司	-	502,544,432.75	-	-	100,000,000.00	3,966.99

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	10,310,460.75
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.25%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司 活期	826,404.41	42,213.73	52,345,960.41	17,476.53

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2023 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 995,184,054.57 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
1928031	19 广发银行 永续债	2023 年 7 月 5 日	105.57	1,100,000	116,129,260.27
2028006	20 邮储银行 永续债	2023 年 7 月 5 日	102.57	1,689,000	173,235,469.18
2028048	20 中国银行	2023 年 7 月 5	106.51	137,000	14,592,391.73

	永续债 02	日			
101900778	19 华能集 MTN003B	2023 年 7 月 6 日	102.03	500,000	51,015,103.83
102002109	20 川能投 MTN003	2023 年 7 月 6 日	103.88	1,100,000	114,264,184.66
102100004	21 华发集团 MTN001	2023 年 7 月 6 日	102.81	490,000	50,376,980.55
102102165	21 诚通控股 MTN006	2023 年 7 月 6 日	103.44	700,000	72,410,309.04
102300314	23 大唐集 MTN002B(能 源保供特别 债)	2023 年 7 月 6 日	101.80	600,000	61,082,163.93
012283935	22 津城建 SCP040	2023 年 7 月 7 日	102.65	500,000	51,324,027.40
012284158	22 津城建 SCP041	2023 年 7 月 7 日	103.14	200,000	20,628,964.38
012382241	23 津城建 SCP037	2023 年 7 月 7 日	100.31	300,000	30,091,967.21
012382259	23 津城建 SCP038	2023 年 7 月 7 日	100.28	500,000	50,140,573.77
101900084	19 津城建 MTN002B	2023 年 7 月 7 日	100.83	27,000	2,722,497.58
102103181	21 河钢集 MTN007	2023 年 7 月 7 日	103.74	500,000	51,870,082.19
102280484	22 河钢集 MTN004	2023 年 7 月 7 日	101.66	300,000	30,498,580.33
1928014	19 华夏银行 永续债	2023 年 7 月 7 日	102.17	1,900,000	194,128,710.38
1928018	19 工商银行 永续债	2023 年 7 月 7 日	106.00	195,000	20,669,444.38
合计				10,738,000	1,105,180,710.81

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 368,873,512.29 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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。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风险。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风险管理制度，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。

新金融工具会计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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	303,324,410.20	242,284,829.59
合计	303,324,410.20	242,284,829.59

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	3,806,008,001.71	4,184,922,983.57
AAA 以下	561,964,823.06	601,437,410.27
未评级	683,244,366.86	651,458,877.27
合计	5,051,217,191.63	5,437,819,271.11

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	307,313,439.76	168,232,427.88
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	307,313,439.76	168,232,427.88

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约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 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	170,844,478.68	-	-	-	170,844,478.68
结算备付金	40,345,710.03	-	-	-	40,345,710.03
存出保证金	408,340.11	-	-	-	408,340.11
交易性金融资产	1,596,893,249.80	3,458,247,313.24	606,714,478.55	269,802,364.48	5,931,657,406.07
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	21,607,846.44	21,607,846.44
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	620,570.00	620,570.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,808,491,778.62	3,458,247,313.24	606,714,478.55	292,030,780.92	6,165,484,351.33
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	1,364,057,566.86	-	-	-	1,364,057,566.86
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,177,624.10	1,177,624.10
应付托管费	-	-	-	392,541.35	392,541.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	298,481.24	298,481.24
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	753,344.45	753,344.45
负债总计	1,364,057,566.86	-	-	2,621,991.14	1,366,679,558.00

利率敏感度缺口	444,434,211.76	3,458,247,313.24	606,714,478.55	289,408,789.78	4,798,804,793.33
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	331,606,031.09	-	-	-	331,606,031.09
结算备付金	47,490,813.99	-	-	-	47,490,813.99
存出保证金	472,041.06	-	-	-	472,041.06
交易性金融资产	1,555,818,449.46	3,485,406,776.91	807,111,302.21	321,394,514.31	6,169,731,042.89
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	25,099,657.34	25,099,657.34
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,935,387,335.60	3,485,406,776.91	807,111,302.21	346,494,171.65	6,574,399,586.37
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	2,022,848,255.70	-	-	-	2,022,848,255.70
应付清算款	-	-	-	37,846,394.62	37,846,394.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,149,707.90	1,149,707.90
应付托管费	-	-	-	328,742.25	328,742.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	211,113.70	211,113.70
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	765,686.65	765,686.65
负债总计	2,022,848,255.70	-	-	40,301,645.12	2,063,149,900.82
利率敏感度缺口	-87,460,920.10	3,485,406,776.91	807,111,302.21	306,192,526.53	4,511,249,685.55

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-26,213,523.39	-28,306,003.66
	市场利率下降 25 个基点	26,482,847.67	28,594,784.77

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	88,766,563.78	-	88,766,563.78
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	88,766,563.78	-	88,766,563.78
以外币计价的负债				

应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	88,766,563.78	-	88,766,563.78
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	21,970,940.38	-	21,970,940.38
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	21,970,940.38	-	21,970,940.38
以外币计价的负债				

应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	21,970,940.38	-	21,970,940.38

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	4,438,328.19	1,098,547.02
	所有外币相对人民币贬值 5%	-4,438,328.19	-1,098,547.02

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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	269,802,364.48	5.62	321,394,514.31	7.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	269,802,364.48	5.62	321,394,514.31	7.12

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	116,514,286.70	61,103,213.63
	业绩比较基准下降5%	-116,514,286.70	-61,103,213.63

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	539,999,539.49	511,417,759.85
第二层次	5,391,657,866.58	5,658,313,283.04
第三层次	-	-
合计	5,931,657,406.07	6,169,731,042.89

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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。

6.4.14.3 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）。

6.4.14.4 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，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	269,802,364.48	4.38
	其中：股票	269,802,364.48	4.38

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,661,855,041.59	91.83
	其中：债券	5,661,855,041.59	91.83
	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	211,190,188.71	3.43
8	其他各项资产	22,636,756.55	0.37
9	合计	6,165,484,351.33	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 88,766,563.78 元，占基金资产净值的比例为 1.85%。

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

金额单位：人民币元

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	6,244,505.00	0.13
B	采矿业	8,132,016.00	0.17
C	制造业	52,124,311.80	1.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,402,000.00	0.53
E	建筑业	8,545,824.00	0.18
F	批发和零售业	6,744,000.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	9,079,685.10	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,192,000.00	0.15
J	金融业	27,652,688.80	0.58
K	房地产业	29,918,770.00	0.62
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	181,035,800.70	3.77

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	34,272,172.47	0.71
非必需消费品	13,753,277.08	0.29
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	1,646,361.25	0.03
信息技术	-	-
原材料	30,080,288.99	0.63
房地产	9,014,463.99	0.19
公用事业	-	-
合计	88,766,563.78	1.85

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

金额单位：人民币元

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	700 HK	腾讯控股	112,100	34,272,172.47	0.71
2	000002	万科A	1,510,000	21,170,200.00	0.44
2	2202 HK	万科企业	929,400	9,014,463.99	0.19
3	600900	长江电力	1,000,000	22,060,000.00	0.46
4	300750	宁德时代	90,000	20,591,100.00	0.43
5	600030	中信证券	1,000,000	19,780,000.00	0.41
6	2600 HK	中国铝业	6,000,000	18,642,435.60	0.39
7	2333 HK	长城汽车	1,663,000	13,753,277.08	0.29
8	1787 HK	山东黄金	868,750	11,437,853.39	0.24
9	600009	上海机场	199,905	9,079,685.10	0.19
10	002443	金洲管道	1,300,000	8,658,000.00	0.18
11	000090	天健集团	1,695,600	8,545,824.00	0.18
12	002807	江阴银行	2,133,520	7,872,688.80	0.16
13	688521	芯原股份	100,000	7,192,000.00	0.15
14	603379	三美股份	300,000	7,053,000.00	0.15
15	300498	温氏股份	340,300	6,244,505.00	0.13
16	601088	中国神华	200,000	6,150,000.00	0.13
17	603939	益丰药房	150,000	5,550,000.00	0.12
18	002314	南山控股	1,430,500	4,720,650.00	0.10
19	600372	中航电子	299,410	4,545,043.80	0.09
20	600309	万华化学	50,000	4,392,000.00	0.09
21	603558	健盛集团	500,000	4,130,000.00	0.09
22	600376	首开股份	1,032,800	4,027,920.00	0.08
23	600236	桂冠电力	600,000	3,342,000.00	0.07
24	300390	天华新能	76,960	2,755,168.00	0.06
25	000426	兴业银锡	223,200	1,982,016.00	0.04

26	1055 HK	中国南方航空股份	404,000	1,646,361.25	0.03
27	603883	老百姓	40,000	1,194,000.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	700 HK	腾讯控股	61,014,027.55	1.35
2	600900	长江电力	51,703,330.00	1.15
3	600030	中信证券	42,615,805.15	0.94
4	000002	万科 A	28,069,301.82	0.62
4	2202 HK	万科企业	12,211,511.33	0.27
5	600266	城建发展	39,438,665.00	0.87
6	601225	陕西煤业	32,857,204.36	0.73
7	902 HK	华能国际电力股份	28,611,383.62	0.63
8	600029	南方航空	18,601,655.00	0.41
8	1055 HK	中国南方航空股份	9,553,948.36	0.21
9	601939	建设银行	26,155,780.00	0.58
10	2628 HK	中国人寿	18,349,957.81	0.41
10	601628	中国人寿	5,797,668.00	0.13
11	601668	中国建筑	22,010,000.00	0.49
12	2600 HK	中国铝业	21,468,208.97	0.48
13	601881	中国银河	21,306,155.85	0.47
14	603939	益丰药房	17,984,927.00	0.40
15	002129	TCL 中环	17,652,774.00	0.39
16	600276	恒瑞医药	15,584,000.00	0.35
17	2601 HK	中国太保	15,234,976.27	0.34
18	1186 HK	中国铁建	15,049,932.04	0.33
19	000617	中油资本	12,826,789.30	0.28
20	1787 HK	山东黄金	12,745,884.86	0.28

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	45,070,836.32	1.00
2	600900	长江电力	43,564,925.00	0.97
3	600266	城建发展	42,946,564.80	0.95
4	902 HK	华能国际电力股份	36,382,125.73	0.81

5	600276	恒瑞医药	33,145,164.35	0.73
6	601225	陕西煤业	28,751,317.00	0.64
7	700 HK	腾讯控股	28,438,754.84	0.63
8	600863	内蒙华电	28,188,784.00	0.62
9	600029	南方航空	18,268,900.00	0.40
9	1055 HK	中国南方航空股份	8,817,183.32	0.20
10	2628 HK	中国人寿	20,649,053.90	0.46
10	601628	中国人寿	6,265,229.00	0.14
11	601939	建设银行	26,876,814.00	0.60
12	601668	中国建筑	24,086,804.00	0.53
13	601857	中国石油	15,451,909.92	0.34
13	857 HK	中国石油股份	7,618,808.20	0.17
14	601881	中国银河	21,459,923.39	0.48
15	601390	中国中铁	11,980,000.00	0.27
15	390 HK	中国中铁	8,321,572.36	0.18
16	002129	TCL 中环	19,493,094.00	0.43
17	2601 HK	中国太保	17,726,993.89	0.39
18	883 HK	中国海洋石油	11,092,231.99	0.25
18	600938	中国海油	5,489,790.00	0.12
19	1186 HK	中国铁建	16,388,501.76	0.36
20	601658	邮储银行	16,110,000.00	0.36

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	800,205,512.12
卖出股票收入（成交）总额	885,159,076.29

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	51,376,215.47	1.07
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,095,297,778.06	43.66
	其中：政策性金融债	32,513,701.30	0.68
4	企业债券	726,126,975.91	15.13
5	企业短期融资券	303,324,410.20	6.32
6	中期票据	1,908,219,047.18	39.76
7	可转债（可交换债）	270,197,175.01	5.63
8	同业存单	307,313,439.76	6.40
9	其他	-	-

10	合计	5,661,855,041.59	117.98
----	----	------------------	--------

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	2028017	20 农业银行永续债 01	2,400,000	244,032,786.89	5.09
2	242380008	23 中行永续债 01	2,000,000	199,794,426.23	4.16
3	1928014	19 华夏银行永续债	1,900,000	194,128,710.38	4.05
4	232380008	23 广州农商行二级资本债 01	1,800,000	186,867,245.90	3.89
5	2028006	20 邮储银行永续债	1,800,000	184,620,393.44	3.85

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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，哈尔滨银行股份有限公司、广州农村商业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	408,340.11
2	应收清算款	21,607,846.44
3	应收股利	620,570.00
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	22,636,756.55

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	8,137,045.48	0.17
2	123080	海波转债	6,862,065.98	0.14
3	118005	天奈转债	6,602,086.30	0.14
4	128037	岩土转债	6,162,938.36	0.13
5	113030	东风转债	6,125,565.71	0.13
6	113049	长汽转债	5,710,094.84	0.12
7	113653	永 22 转债	5,703,587.89	0.12
8	123115	捷捷转债	5,658,020.55	0.12
9	128072	翔鹭转债	5,651,490.89	0.12
10	127019	国城转债	5,403,582.57	0.11
11	127034	绿茵转债	5,370,866.11	0.11
12	123153	英力转债	5,144,265.70	0.11
13	111002	特纸转债	5,016,821.00	0.10
14	113649	丰山转债	4,981,459.62	0.10
15	113065	齐鲁转债	4,937,690.41	0.10
16	127075	百川转 2	4,855,576.14	0.10
17	113647	禾丰转债	4,705,868.49	0.10
18	128144	利民转债	4,685,526.15	0.10
19	123103	震安转债	4,672,630.63	0.10
20	123132	回盛转债	4,595,089.48	0.10
21	113532	海环转债	4,558,988.48	0.10
22	113640	苏利转债	4,493,180.19	0.09
23	127024	盈峰转债	4,325,280.62	0.09
24	118024	冠宇转债	4,313,195.56	0.09
25	127006	敖东转债	4,284,426.71	0.09
26	113610	灵康转债	4,221,386.30	0.09
27	113033	利群转债	4,181,967.12	0.09
28	113618	美诺转债	4,049,300.42	0.08

29	123165	回天转债	4,045,813.52	0.08
30	111003	聚合转债	3,995,930.45	0.08
31	118018	瑞科转债	3,968,739.46	0.08
32	113657	再 22 转债	3,785,713.36	0.08
33	127044	蒙娜转债	3,780,685.62	0.08
34	118013	道通转债	3,762,461.92	0.08
35	128090	汽模转 2	3,752,814.05	0.08
36	113651	松霖转债	3,605,626.31	0.08
37	123171	共同转债	3,568,454.79	0.07
38	118023	广大转债	3,528,110.02	0.07
39	113638	台 21 转债	3,461,571.06	0.07
40	123151	康医转债	3,457,471.20	0.07
41	118004	博瑞转债	3,407,868.74	0.07
42	123155	中陆转债	3,395,273.61	0.07
43	113606	荣泰转债	3,315,778.45	0.07
44	113650	博 22 转债	3,315,504.80	0.07
45	113639	华正转债	3,162,713.01	0.07
46	123152	润禾转债	3,158,311.64	0.07
47	128127	文科转债	3,130,499.25	0.07
48	128105	长集转债	3,121,286.30	0.07
49	113604	多伦转债	3,098,060.19	0.06
50	123129	锦鸡转债	3,080,822.60	0.06
51	118026	利元转债	3,008,464.00	0.06
52	127035	濮耐转债	2,973,148.57	0.06
53	111000	起帆转债	2,595,465.75	0.05
54	123168	惠云转债	2,589,056.44	0.05
55	113577	春秋转债	2,472,168.09	0.05
56	118029	富淼转债	2,460,595.38	0.05
57	123100	朗科转债	2,425,679.77	0.05
58	113027	华钰转债	2,259,706.03	0.05
59	113652	伟 22 转债	2,237,476.65	0.05
60	118020	芳源转债	2,230,758.90	0.05
61	118015	芯海转债	2,220,537.21	0.05
62	132026	G 三峡 EB2	2,213,531.51	0.05
63	123106	正丹转债	2,140,123.54	0.04
64	118006	阿拉转债	1,841,858.93	0.04

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 (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 (%)
204	20,937,682.80	4,271,287,290.57	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、基金投资和研发部门 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

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年9月26日） 基金份额总额	210,008,000.00
本报告期期初基金份额总额	4,181,962,593.83
本报告期基金总申购份额	89,324,737.69
减：本报告期基金总赎回份额	40.95
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,271,287,290.57

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，

张峰先生任公司副总经理。

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

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

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信证券股份有限公司	3	1,678,361,309.21	100.00	1,077,112.83	100.00	-

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(%)
中信证券股份有限公司	2,163,627,993.55	100.00	42,451,620,000.00	100.00	-	-

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	关于嘉实致安 3 个月定期债券第十三个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 27 日
2	嘉实基金管理有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 16 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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 21 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
5	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 30 日
6	关于嘉实致安 3 个月定期债券第十四个开放期开放申购、赎回业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 5 月 31 日

7	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 20 日
---	----------------------	-----------------------------	-----------------

§ 11 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	2023-01-01 至 2023-06-30	3,719,545,285.48	-	-	3,719,545,285.48	87.08
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>							

§ 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。

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

2023 年 8 月 29 日