

嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证
券投资基金
2025 年中期报告

2025 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：2025 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
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	12
§ 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 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	37
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	37
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	37
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	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
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	39
§ 9 开放式基金份额变动	39
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
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	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件	42
§ 11 备查文件目录	43
11.1 备查文件目录	43
11.2 存放地点	43
11.3 查阅方式	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金
基金简称	嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期
基金主代码	015861
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 6 月 9 日
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	3,344,725,952.94 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

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 负责人	姓名	郭松	朱萍
	联系电话	(010) 65215588	021-31888888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhup02@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）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 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	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	100020	200126
法定代表人	经雷	张为忠

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	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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	31,720,365.63
本期利润	22,511,712.27
加权平均基金份额本期利润	0.0057
本期加权平均净值利润率	0.53%
本期基金份额净值增长率	0.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	218,078,248.50
期末可供分配基金份额利润	0.0652
期末基金资产净值	3,564,878,155.53
期末基金份额净值	1.0658
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.58%

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	0.15%	0.01%	0.16%	0.01%	-0.01%	0.00%
过去三个月	0.51%	0.01%	0.52%	0.01%	-0.01%	0.00%
过去六个月	0.60%	0.02%	0.86%	0.01%	-0.26%	0.01%
过去一年	1.59%	0.02%	1.96%	0.01%	-0.37%	0.01%
过去三年	6.43%	0.02%	6.78%	0.01%	-0.35%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.58%	0.02%	6.97%	0.01%	-0.39%	0.01%

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：

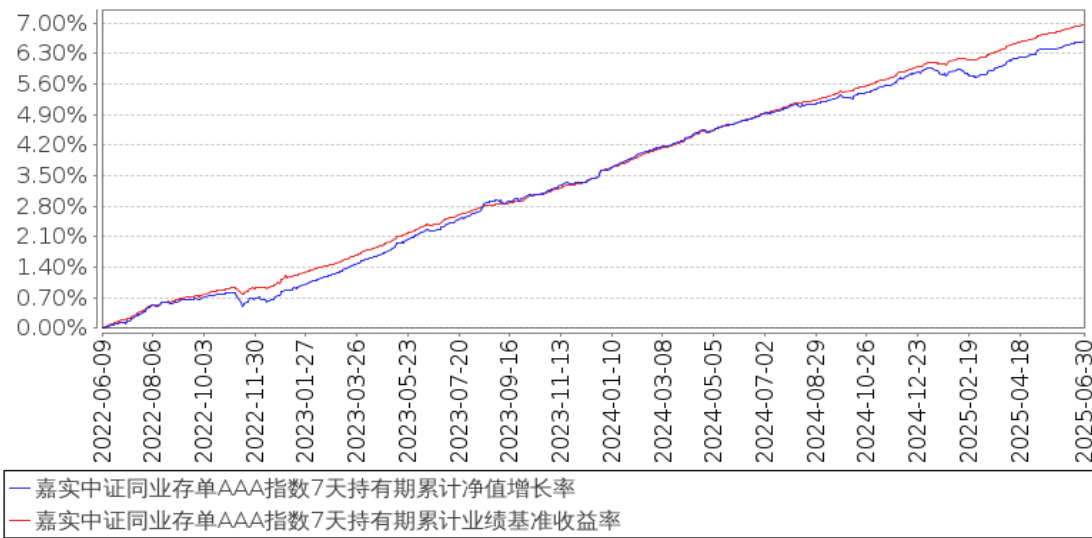
$$\text{Return}(t) = (\text{中证同业存单 AAA 指数}(t) / \text{中证同业存单 AAA 指数}(t-1) - 1) \times 95\% + ((1 + \text{一年期定期存款利率(税后)})^{(1/365)} - 1) \times 5\%$$

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

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

嘉实中证同业存单AAA指数7天持有期累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2022年06月09日至2025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。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 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 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、嘉实致享纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券、嘉实致裕纯债债券、嘉实中债	2022 年 6 月 14 日	—	21 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。

	绿色普惠主题金融债券优选指数、嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债基金经理				
陈硕	本基金、嘉实汇达中短债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实致远 3 个月定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券基金经理	2023 年 9 月 26 日	-	11 年	曾任中国民生银行股份有限公司金融市场部投资经理。2021 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司固收与配置组，任投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

（3）2025 年 8 月 6 日，本基金管理人发布《关于嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金经理变更的公告》，赵国英女士不再担任本基金基金经理，增聘张文佳女士担任本基金基金经理，本基金将由陈硕先生、张文佳女士共同管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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 5 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 3 次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

2025 年上半年，债券收益率呈现先上后下的走势，10 年期国债收益率从年初 1.60% 附近震荡上行至 3 月中旬 1.89% 的年内高点，随后受关税冲击与宽松政策驱动回落，最终收于 1.65%。一年期同业存单收益率从年初 1.57% 附近震荡上行至 3 月初 2.02% 的年内高点，随后跟随利率品种快速下行并收于 1.63%。宏观层面，一季度经济基本较强，外贸出口数据强势，内需方面消费、生产领域都较为亮眼，投资数据略偏弱，GDP 增速 5.4% 开局经济数据交出满意答卷；二季度经济呈现温和回落态势，制造业 PMI 连续三月低于荣枯线，工业生产增速有所放缓，但新能源、高端装备等“硬科技”领域维持韧性增长，有效对冲传统行业下行压力。消费主要依赖政策驱动，以旧换新政策对汽车、家电拉动明显。出口受美国关税冲击出现显著回落，贸易顺差收窄。投资领域延续分化态势，地产投资降幅扩大，基建增速回落，但高技术制造业投资保持高增长。物价持续低迷，通缩压力尚未缓解。在政策环境方面，上半年财政政策积极发力，超长期特别国债与专项债加速落地，重点支持设备更新、消费刺激及特定领域发展。货币政策方向转向“灵活把握力度与节奏”的调控思路，5 月降准降息后进入观察期。

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

本报告期内，本基金日均跟踪偏离为 0.01%，年化跟踪误差为 0.14%，符合基金合同约定的日均跟踪偏离度不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2% 的限制。

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 1.0658 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.60%，业绩比较基准收益率为 0.86%。

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，短期市场风险偏好回暖，债券仍处在弱势情绪之中，反内卷相关行业的消息面扰动及风险资产的强势行情冲击下债市不排除进一步承压。中期维度来看，当前市场对反内卷带动的价格回升、名义经济修复的交易仍集中在预期层面，基本面回暖缺少微观证据的支持。此外，央行对流动性延续呵护态度，预计下半年期资金面呈现较为宽松的格局。综上所述，在基本面偏弱和货币政策宽松的环境下，下半年收益率有望呈现区间震荡中枢小幅下行。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场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”）在对嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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，对嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期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、基金费用开支以及利润分配等

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。

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、财务会计报告相关内容、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：嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	786,938.71	101,629,534.08
结算备付金		-	-
存出保证金		2,306.84	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,486,587,800.96	9,222,114,241.35
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,486,587,800.96	9,222,114,241.35
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		60,353,876.47	275,991,185.18
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,547,730,922.98	9,599,734,960.61
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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		981,154,002.74	2,303,486,091.59
应付清算款		-	-
应付赎回款		70,811.14	327,580.33
应付管理人报酬		590,167.38	970,895.80
应付托管费		147,541.85	242,723.94
应付销售服务费		590,167.38	970,895.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		51,089.61	62,485.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	248,987.35	284,422.03
负债合计		982,852,767.45	2,306,345,095.06
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	3,344,725,952.94	6,884,569,689.25
未分配利润	6.4.7.12	220,152,202.59	408,820,176.30
净资产合计		3,564,878,155.53	7,293,389,865.55
负债和净资产总计		4,547,730,922.98	9,599,734,960.61

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0658 元，基金份额总额 3,344,725,952.94 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		47,160,940.44	109,924,567.02
1. 利息收入		429,317.98	819,128.86
其中：存款利息收入	6.4.7.13	429,317.98	810,323.39
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		-	8,805.47
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		55,940,275.82	107,745,361.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	55,940,275.82	107,745,361.94
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	-	-
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	-9,208,653.36	1,360,076.22
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		24,649,228.17	36,544,601.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,216,666.26	6,131,423.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,054,166.61	1,532,855.82
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,216,666.26	6,131,423.43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		14,960,760.58	22,448,242.20
其中：卖出回购金融资产 支出		14,960,760.58	22,448,242.20
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		53,483.16	134,486.73
8. 其他费用	6.4.7.23	147,485.30	166,169.96
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		22,511,712.27	73,379,965.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		22,511,712.27	73,379,965.45
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		22,511,712.27	73,379,965.45

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	6,884,569,689.	-	408,820,176.30	7,293,389,865.5

资产	25			5
二、本期期初净资产	6,884,569,689. 25	-	408,820,176.30	7,293,389,865.5 5
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,539,843,736 .31	-	-188,667,973.7 1	-3,728,511,710. 02
(一)、综合收益总额	-	-	22,511,712.27	22,511,712.27
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,539,843,736 .31	-	-211,179,685.9 8	-3,751,023,422. 29
其中：1. 基金申购款	5,576,555,920. 89	-	341,266,327.91	5,917,822,248.8 0
2. 基金赎回款	-9,116,399,657 .20	-	-552,446,013.8 9	-9,668,845,671. 09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	3,344,725,952. 94	-	220,152,202.59	3,564,878,155.5 3
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	9,098,172,104. 44	-	330,258,259.97	9,428,430,364.4 1
二、本期期初净资产	9,098,172,104. 44	-	330,258,259.97	9,428,430,364.4 1
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,884,570,423 .20	-	-25,378,630.92	-2,909,949,054. 12
(一)、综合收益总额	-	-	73,379,965.45	73,379,965.45

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-2,884,570,423.20	-	-98,758,596.37	-2,983,329,019.57
其中：1. 基金申购款	12,972,911,609.96	-	556,864,753.40	13,529,776,363.36
2. 基金赎回款	-15,857,482,033.16	-	-655,623,349.77	-16,513,105,382.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,213,601,681.24	-	304,879,629.05	6,518,481,310.29

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2022]1033 号《关于准予嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于 2022 年 5 月 30 日至 2022 年 6 月 7 日向社会公开募集，基金合同于 2022 年 6 月 9 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 10,001,664,375.99 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体

会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.2 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	786,938.71
等于：本金	786,890.12
加：应计利息	48.59
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
合计	786,938.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	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	30,675,771.23	656,013.15	30,960,013.15	-371,771.23
	银行间市场	4,422,018,969.37	32,341,787.81	4,455,627,787.81	1,267,030.63
	合计	4,452,694,740.60	32,997,800.96	4,486,587,800.96	895,259.40
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,452,694,740.60	32,997,800.96	4,486,587,800.96	895,259.40

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 2025 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	92,247.50

其中：交易所市场	-
银行间市场	92,247.50
应付利息	-
预提费用	156,739.85
合计	248,987.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,884,569,689.25	6,884,569,689.25
本期申购	5,576,555,920.89	5,576,555,920.89
本期赎回（以“-”号填列）	-9,116,399,657.20	-9,116,399,657.20
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,344,725,952.94	3,344,725,952.94

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	394,887,032.27	13,933,144.03	408,820,176.30
本期期初	394,887,032.27	13,933,144.03	408,820,176.30
本期利润	31,720,365.63	-9,208,653.36	22,511,712.27
本期基金份额交易产生的变动数	-208,529,149.40	-2,650,536.58	-211,179,685.98
其中：基金申购款	340,815,701.41	450,626.50	341,266,327.91
基金赎回款	-549,344,850.81	-3,101,163.08	-552,446,013.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	218,078,248.50	2,073,954.09	220,152,202.59

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,187.14
定期存款利息收入	414,166.30

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	44.26
其他	1,920.28
合计	429,317.98

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	58,513,507.31
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,573,231.49
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	55,940,275.82

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,313,867,875.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,218,010,787.46
减：应计利息总额	98,384,994.92
减：交易费用	45,325.00
买卖债券差价收入	-2,573,231.49

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

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-9,208,653.36
股票投资	-
债券投资	-9,208,653.36

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	-9,208,653.36

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	37,145.45
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	147,485.30

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发”）	基金托管人

银行”)	
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,216,666.26	6,131,423.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,690,872.33	2,584,302.05
应支付基金管理人的净管理费	2,525,793.93	3,547,121.38

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 0.20%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×0.20%/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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,054,166.61	1,532,855.82

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期	
嘉实基金管理有限公司	142,455.23	
浦发银行	177,865.71	
嘉实财富	78,491.32	
合计	398,812.26	
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
	嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期	
嘉实基金管理有限公司	219,731.82	
浦发银行	592,673.38	
嘉实财富	7,226.75	
合计	819,631.95	

注：本基金销售服务费年费率为 0.20%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
上海浦东发展银行股份有限公司	—	10,247,830.68	—	—	410,000.00	18,015.96
上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
上海浦东发展银行股份有限公司	257,621,084.17	295,121,965.84	—	—	458,000.00	27,407.08

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

无。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	786,938.71	13,187.14	872,189.69	3,338.44

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

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2025 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 2025 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 981,154,002.74 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
112415388	24 民生银行 CD388	2025 年 7 月 1 日	99.40	2,000,000	198,791,735.89
112418383	24 华夏银行 CD383	2025 年 7 月 1 日	99.26	1,000,000	99,261,636.16
112503146	25 农业银行 CD146	2025 年 7 月 1 日	98.62	1,500,000	147,936,676.44
112504031	25 中国银行 CD031	2025 年 7 月 1 日	98.45	2,000,000	196,897,007.12
112508093	25 中信银行 CD093	2025 年 7 月 1 日	98.85	1,226,000	121,184,927.29
112508102	25 中信银行 CD102	2025 年 7 月 1 日	98.81	151,000	14,920,793.82
112518123	25 华夏银行 CD123	2025 年 7 月 1 日	98.69	705,000	69,578,949.37
210203	21 国开 03	2025 年 7 月 1 日	102.29	400,000	40,917,972.60
220412	22 农发 12	2025 年 7 月 1 日	101.98	300,000	30,594,041.10
240308	24 进出 08	2025 年 7 月 1 日	101.40	300,000	30,418,627.40
240314	24 进出 14	2025 年 7 月 1 日	100.89	500,000	50,443,109.59
250304	25 进出 04	2025 年 7 月 1 日	100.47	300,000	30,141,123.29
250401	25 农发 01	2025 年 7 月 1 日	100.39	133,000	13,352,405.64
合计				10,515,000	1,044,439,005.71

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—
未评级	323,915,053.16	867,841,501.17
合计	323,915,053.16	867,841,501.17

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	165,692,184.66	308,000,466.10
AAA 以下	—	—
未评级	285,365,942.46	545,871,765.09
合计	451,058,127.12	853,872,231.19

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	3,711,614,620.68	7,500,400,508.99
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	3,711,614,620.68	7,500,400,508.99

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交

易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	786,938.71	-	-	-	786,938.71
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	2,306.84	-	-	-	2,306.84
交易性金融资产	4,486,587,800.96	-	-	-	4,486,587,800.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	60,353,876.47	60,353,876.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,487,377,046.51	-	-	60,353,876.47	4,547,730,922.98
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	981,154,002.74	-	-	-	981,154,002.74
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	70,811.14	70,811.14
应付管理人报酬	-	-	-	590,167.38	590,167.38
应付托管费	-	-	-	147,541.85	147,541.85
应付销售服务费	-	-	-	590,167.38	590,167.38
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	51,089.61	51,089.61
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	248,987.35	248,987.35
负债总计	981,154,002.74	-	-	1,698,764.71	982,852,767.45
利率敏感度缺口	3,506,223,043.77	-	-	58,655,111.76	3,564,878,155.53
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
货币资金	101,629,534.08	-	-	-	101,629,534.08
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	9,169,959,536.43	52,154,704.92	-	-	9,222,114,241.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	275,991,185.18	275,991,185.18
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,271,589,070.51	52,154,704.92	-	275,991,185.18	9,599,734,960.61
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	2,303,486,091.59	-	-	-	2,303,486,091.59
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	327,580.33	327,580.33
应付管理人报酬	-	-	-	970,895.80	970,895.80
应付托管费	-	-	-	242,723.94	242,723.94
应付销售服务费	-	-	-	970,895.80	970,895.80
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	62,485.57	62,485.57
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	284,422.03	284,422.03
负债总计	2,303,486,091.59	-	-	2,859,003.47	2,306,345,095.06
利率敏感度缺口	6,968,102,978.92	52,154,704.92	-	-273,132,181.71	7,293,389,865.55

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-6,385,423.72	-12,659,921.42
	市场利率下降 25 个基点	6,407,004.13	12,702,725.31

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	-	-
	业绩比较基准下降 5%	-	-

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	—	—
第二层次	4,486,587,800.96	9,222,114,241.35
第三层次	—	—
合计	4,486,587,800.96	9,222,114,241.35

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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	—	—
	其中：股票	—	—

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,486,587,800.96	98.66
	其中：债券	4,486,587,800.96	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	786,938.71	0.02
8	其他各项资产	60,356,183.31	1.33
9	合计	4,547,730,922.98	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	202,593,679.46	5.68
	其中：政策性金融债	202,593,679.46	5.68
4	企业债券	30,960,013.15	0.87
5	企业短期融资券	212,912,192.88	5.97
6	中期票据	328,507,294.79	9.22

7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	3,711,614,620.68	104.12
9	其他	-	-
10	合计	4,486,587,800.96	125.86

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	112415388	24 民生银行 CD388	2,000,000	198,791,735.89	5.58
2	112508093	25 中信银行 CD093	2,000,000	197,691,561.64	5.55
3	112504031	25 中国银行 CD031	2,000,000	196,897,007.12	5.52
4	112502114	25 工商银行 CD114	1,900,000	187,811,016.77	5.27
5	112503146	25 农业银行 CD146	1,500,000	147,936,676.44	4.15

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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，兴业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	2,306.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	60,353,876.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,356,183.31

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 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（%）
381,201	8,774.18	1,025,257,584.50	30.65	2,319,468,368.44	69.35

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,310,644.27	0.04

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 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 6 月 9 日）基 金份额总额	10,001,664,375.99
本报告期期初基金份额总额	6,884,569,689.25
本报告期基金总申购份额	5,576,555,920.89
减：本报告期基金总赎回份额	9,116,399,657.20
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,344,725,952.94

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、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

本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，会计师事务所为安永华明会计师事务所（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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员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

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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	—	—	—	—	—
东吴证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
国泰海通证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
华泰证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
江海证券有限公司	1	—	—	—	—	—
申万宏源证券有限公司	2	—	—	—	—	—
招商证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
浙商证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
中国国际金融股份有限公司	1	—	—	—	—	—

中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	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) 合规风控能力较强；
- (4) 研究、交易等服务能力较强。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

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(%)
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国泰海 通证券 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	20,477,400. 00	100.00	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 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	关于嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金调整销售对象及申购业务限额并修改招募说明书的公告	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	2025 年 1 月 17 日
2	关于嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年春节前暂停申购（含转换转入及定期定额投	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	2025 年 1 月 22 日

	资)业务的公告		
3	关于嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年劳动节前暂停申购(含转换转入及定期定额投资)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	2025 年 4 月 25 日
4	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	2025 年 5 月 22 日
5	关于嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金 2025 年端午节前暂停申购(含转换转入及定期定额投资)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	2025 年 5 月 27 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 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

11.3 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

2025 年 8 月 29 日