

嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证  
券投资基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

## §1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 嘉实致安 3 个月定期债券                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 基金主代码      | 007879                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 基金合同生效日    | 2019 年 9 月 26 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 报告期末基金份额总额 | 5,073,438,054.06 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| 投资目标       | 本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 投资策略       | <p>（一）封闭期投资策略：运用大类资产配置策略，本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。本基金封闭期投资策略还包括：债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p> |
| 业绩比较基准     | 中债综合全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票，还将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 44,178,993.57                         |
| 2. 本期利润         | 27,523,523.03                         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0048                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 6,083,031,708.20                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.1990                                |

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

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

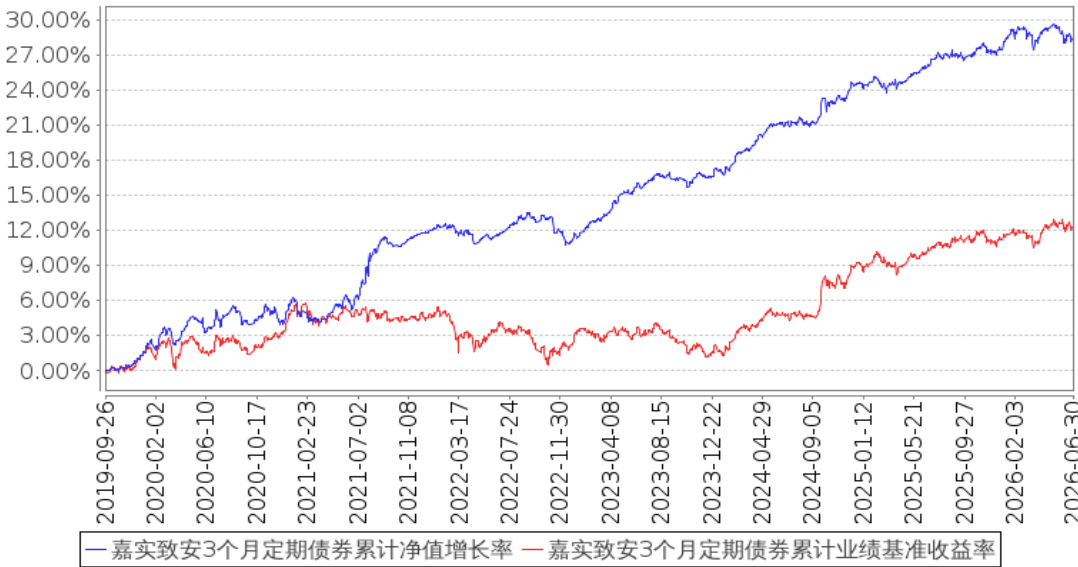
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 0.38%      | 0.16%         | 1.32%          | 0.17%                 | -0.94% | -0.01% |
| 过去六个月          | 0.87%      | 0.17%         | 1.04%          | 0.17%                 | -0.17% | 0.00%  |
| 过去一年           | 1.92%      | 0.14%         | 1.82%          | 0.15%                 | 0.10%  | -0.01% |
| 过去三年           | 10.99%     | 0.12%         | 8.91%          | 0.16%                 | 2.08%  | -0.04% |
| 过去五年           | 20.69%     | 0.12%         | 6.84%          | 0.17%                 | 13.85% | -0.05% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 28.57%     | 0.13%         | 12.34%         | 0.17%                 | 16.23% | -0.04% |

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

嘉实致安3个月定期债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2019年09月26日至2026年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名  | 职务                                      | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                             |
|-----|-----------------------------------------|----------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                         | 任职日期           | 离任日期 |        |                                                                                                                                |
| 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、嘉实同舟稳利债券基金经理 | 2022 年 5 月 6 日 | —    | 16 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。 |
| 赵国英 | 本基金、嘉实信用债券、嘉实稳怡债券、嘉实致享纯债                | 2022 年 5 月 6 日 | —    | 22 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。               |

|                                                                              |  |  |  |       |
|------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------|
| 债券、嘉实汇达中短债债券、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、嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数、嘉实汇明纯债债券基金经理 |  |  |  | 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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名  | 产品类型     | 产品数量（只） | 资产净值（元）           | 任职时间            |
|-----|----------|---------|-------------------|-----------------|
| 董福焱 | 公募基金     | 5       | 10,105,700,724.90 | 2019 年 8 月 23 日 |
|     | 私募资产管理计划 | 1       | 53,325,725.51     | 2025 年 7 月 4 日  |
|     | 其他组合     | -       | -                 | -               |
|     | 合计       | 6       | 10,159,026,450.41 | -               |

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持

有人利益的行为。

### 4.3 公平交易专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，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 2 次，其中 1 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，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年第二季度，我国经济内生动能偏弱底色持续，整体呈现出“外需强韧、内需承压、结构分化”的显著特征。生产方面，1-5 月规模以上工业增加值累计同比增长 5.4%，较第一季度的 6.1% 小幅回落。内需方面，1-5 月固定资产投资累计同比转负至 -4.1%，5 月社会消费品零售总额同比 -0.6%，反映社会终端需求仍在修复过程中。外需方面，1-5 月出口累计同比增长 15.5%，整体保持韧性。

货币政策方面，4 月政治局会议后总量加码预期降温；5 月央行重申“削峰填谷”；6 月陆家嘴论坛强调“稳中求进”，虽未调降 OMO 利率，但利率走廊收窄及隔夜逆回购新工具落地，有效化解季末资金偏紧担忧，凸显维稳意图并强化“宽货币”底色。但从资金利率来看，整体先下后上：4 月受实体融资弱与存款高增影响，资金极度宽松（DR001 多在 1.2% 附近）；5 月下半月价格收敛引发市场调整；6 月税期与季末压力致资金“明松暗紧”，随后央行大额净投放及新工具信号明确稳利率意图，促使资金预期由“价贵”切换至“价稳可期”。

债券市场方面，4 月流动性极度宽松，机构集中拉久期，30Y-10Y 期限利差显著收窄，1 年期国债下探至 1.13%，10 年期有效突破 1.75%，30 年期逼近 2.20%。5 月经济数据不及预期与供给担忧交织，长端在震荡中重心下移，牛平格局延续。6 月多头情绪再度集中释放，10 年期国债一度逼近 1.70%、30 年期下探至 2.204% 附近。直至季末，公开市场操作净回笼叠加 PMI 超预期，债市

迎来短暂回调。

二季度 A 股市场前 5% 个股成交额占比达历史高位，电子、通信行业成交额和市值占比达历史高位，场内资金趋同性配置显著，市场呈现“主线强势、但内部拥挤度上升”的特征。转债跟随权益市场极致分化，高价科技类转债大幅跑赢中低价转债。

报告期内，组合积极参与利率债和高等级信用债并及时止盈，杠杆维持中性水平，久期灵活调整。股票方面，组合采取了更灵敏的止盈止损操作和更分散的投资方式以应对市场潜在的风险。结构上，报告期内对消费做了减仓，加配了化工、制造业等板块。转债方面，组合整体仓位先升后降，重点配置平衡型转债和赎回风险可控的偏股型转债，对于低价转债亦有一定的配置。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1990 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.38%，业绩比较基准收益率为 1.32%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 751,260,911.69   | 9.02         |
|    | 其中：股票             | 751,260,911.69   | 9.02         |
| 2  | 基金投资              | —                | —            |
| 3  | 固定收益投资            | 7,312,052,582.01 | 87.74        |
|    | 其中：债券             | 7,312,052,582.01 | 87.74        |
|    | 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      | 205,559,535.96   | 2.47         |
| 8  | 其他资产              | 64,554,564.19    | 0.77         |
| 9  | 合计                | 8,333,427,593.85 | 100.00       |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 153,640,501.14 元，占基金资产净值的比例为 2.53%。

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | —              | —            |
| B  | 采矿业              | 22,626,000.00  | 0.37         |
| C  | 制造业              | 446,299,729.22 | 7.34         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | —              | —            |
| F  | 批发和零售业           | 906,651.90     | 0.01         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 26,476,834.00  | 0.44         |
| J  | 金融业              | 42,195,684.00  | 0.69         |
| K  | 房地产业             | 14,702,470.75  | 0.24         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 9,646,316.00   | 0.16         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 16,077,120.00  | 0.26         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 3,689,046.80   | 0.06         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | —              | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 886,095.00     | 0.01         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 2,361,462.88   | 0.04         |
| S  | 综合               | 11,753,000.00  | 0.19         |
|    | 合计               | 597,620,410.55 | 9.82         |

## 5.2.2 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   | 10,377,817.56  | 0.17         |
| 非必需消费品 | 45,141,850.94  | 0.74         |
| 必需消费品  | 3,721,054.94   | 0.06         |
| 能源     | 13,896,800.00  | 0.23         |
| 金融     | —              | —            |
| 医疗保健   | 18,998,662.70  | 0.31         |
| 工业     | 21,031,483.13  | 0.35         |
| 信息技术   | 18,795,422.00  | 0.31         |
| 原材料    | 9,276,114.00   | 0.15         |
| 房地产    | 12,401,295.87  | 0.20         |
| 公用事业   | —              | —            |
| 合计     | 153,640,501.14 | 2.53         |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称   | 数量（股）     | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创   | 20,000    | 25,400,000.00 | 0.42         |
| 2  | 09988  | 阿里巴巴-W | 300,000   | 24,193,460.25 | 0.40         |
| 3  | 601899 | 紫金矿业   | 900,000   | 22,626,000.00 | 0.37         |
| 4  | 002532 | 天山铝业   | 2,000,000 | 21,460,000.00 | 0.35         |
| 5  | 002475 | 立讯精密   | 299,936   | 21,115,494.40 | 0.35         |
| 6  | 06936  | 顺丰控股   | 803,400   | 21,031,483.13 | 0.35         |
| 7  | 600031 | 三一重工   | 1,107,400 | 19,135,872.00 | 0.31         |
| 8  | 688981 | 中芯国际   | 120,079   | 19,070,946.78 | 0.31         |
| 9  | 601878 | 浙商证券   | 2,000,000 | 19,000,000.00 | 0.31         |
| 10 | 01810  | 小米集团-W | 1,000,000 | 18,795,422.00 | 0.31         |

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 50,773,480.66    | 0.83         |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,628,282,286.02 | 43.21        |
|    | 其中：政策性金融债 | 319,956,605.48   | 5.26         |
| 4  | 企业债券      | 512,271,481.62   | 8.42         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 3,515,601,069.08 | 57.79        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 307,096,697.37   | 5.05         |
| 8  | 同业存单      | 298,027,567.26   | 4.90         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 7,312,052,582.01 | 120.20       |

## 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称                | 数量（张）     | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 250220    | 25 国开 20            | 3,000,000 | 306,665,589.04 | 5.04         |
| 2  | 242680014 | 26 招商银行永续<br>债 02BC | 2,500,000 | 251,099,465.75 | 4.13         |
| 3  | 242580022 | 25 民生银行永续<br>债 01   | 2,300,000 | 233,335,756.16 | 3.84         |
| 4  | 242480003 | 24 广州农商行永<br>续债 01  | 2,000,000 | 205,934,334.25 | 3.39         |
| 5  | 102485584 | 24 中电投<br>MTN034    | 1,600,000 | 162,729,161.64 | 2.68         |

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

无。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.9.1 本期国债期货投资政策**

无。

**5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**5.9.3 本期国债期货投资评价**

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，华夏银行股份有限公司、国家开发银行、中国民生银行股份有限公司、招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

**5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**5.10.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 1,745,629.68  |
| 2  | 应收证券清算款 | 62,379,314.65 |
| 3  | 应收股利    | 429,619.86    |
| 4  | 应收利息    | —             |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 其他      | —             |

|   |    |               |
|---|----|---------------|
| 8 | 合计 | 64,554,564.19 |
|---|----|---------------|

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 113640 | 苏利转债    | 40,009,960.79 | 0.66         |
| 2  | 127067 | 恒逸转 2   | 25,328,795.09 | 0.42         |
| 3  | 127049 | 希望转 2   | 21,126,969.37 | 0.35         |
| 4  | 113058 | 友发转债    | 19,986,003.15 | 0.33         |
| 5  | 113671 | 武进转债    | 19,651,779.47 | 0.32         |
| 6  | 118031 | 天 23 转债 | 16,540,209.80 | 0.27         |
| 7  | 127108 | 太能转债    | 16,417,800.65 | 0.27         |
| 8  | 118034 | 晶能转债    | 16,383,046.20 | 0.27         |
| 9  | 113648 | 巨星转债    | 13,889,789.53 | 0.23         |
| 10 | 128121 | 宏川转债    | 12,959,485.34 | 0.21         |
| 11 | 128125 | 华阳转债    | 10,865,238.12 | 0.18         |
| 12 | 127098 | 欧晶转债    | 8,831,635.26  | 0.15         |
| 13 | 123142 | 申昊转债    | 7,991,813.37  | 0.13         |
| 14 | 113048 | 晶科转债    | 7,953,872.34  | 0.13         |
| 15 | 123216 | 科顺转债    | 7,656,928.77  | 0.13         |
| 16 | 127084 | 柳工转 2   | 7,478,930.48  | 0.12         |
| 17 | 123243 | 严牌转债    | 6,528,965.59  | 0.11         |
| 18 | 127041 | 弘亚转债    | 6,102,877.04  | 0.10         |
| 19 | 127096 | 泰坦转债    | 5,817,646.03  | 0.10         |
| 20 | 123220 | 易瑞转债    | 5,377,149.65  | 0.09         |
| 21 | 123237 | 佳禾转债    | 4,482,245.60  | 0.07         |
| 22 | 113691 | 和邦转债    | 4,255,487.67  | 0.07         |
| 23 | 123188 | 水羊转债    | 4,189,978.57  | 0.07         |
| 24 | 123171 | 共同转债    | 3,968,946.58  | 0.07         |
| 25 | 113686 | 泰瑞转债    | 3,764,959.99  | 0.06         |
| 26 | 113695 | 华辰转债    | 3,524,217.87  | 0.06         |
| 27 | 123180 | 浙矿转债    | 2,671,352.46  | 0.04         |
| 28 | 118018 | 瑞科转债    | 2,619,421.92  | 0.04         |
| 29 | 118012 | 微芯转债    | 718,931.47    | 0.01         |
| 30 | 123113 | 仙乐转债    | 2,259.20      | 0.00         |

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 5,846,739,016.94 |
| 报告期期间基金总申购份额              | —                |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 773,300,962.88   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —                |
| 报告期期末基金份额总额               | 5,073,438,054.06 |

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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无。

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别                                                                                                                                                                                                                                  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |      |                | 报告期末持有基金情况       |         |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|------------------|------|----------------|------------------|---------|
|                                                                                                                                                                                                                                        | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额 | 赎回份额           | 持有份额             | 份额占比(%) |
| 机构                                                                                                                                                                                                                                     | 1              | 2026-04-01 至 2026-06-30 | 5,155,124,589.47 | —    | 773,268,688.42 | 4,381,855,901.05 | 86.37   |
| 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> |                |                         |                  |      |                |                  |         |

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、

转换转出或份额合并等导致减少的份额。

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

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

### 10.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

### 10.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日