

嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放 式指数证券投资基金 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：兴业银行股份有限公司

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。

基金托管人兴业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	嘉实中证 AAA 科技创新公司债 ETF
场内简称	科创债 ETF 嘉实
基金主代码	159600
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 7 月 10 日
报告期末基金份额总额	354,778,913.00 份
投资目标	本基金进行指数化投资，争取获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。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%，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金为指数型基金，采用抽样复制和动态最优化的方法，选取标的指数成份券和备选成份券中流动性较好的债券，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标的指数的有效跟踪。 （一）债券指数化投资策略 基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要，本基金将投资于流动性较好的指数成份券，保证基金资产流动性，提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济、货币政策和市场结构的变化，判断利率走势，优化组合结构；结合信用风险的判断和债券定价技术，优选个券。 1、抽样复制策略 本基金主要采取债券指数化投资策略，在力求跟踪误差最小化的前提下，本基金通过对标的指数中各成份券的久期、信用资质、历史流动性及收益率等进行分析，构建与标的指数风险收益特征相似的投资组合，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。此外本基金在控制跟踪误差的前提下，可通过风险可控的积极管理获得超额收益，力争弥

	补基金费用等管理成本，尽量缩小与标的指数的偏离度。 2、替代性策略 当市场流动性不足或因法规规定等其他原因，导致标的指数成份券无法满足投资需求时，基金管理人将通过投资其他债券等方式进行替代。 (二) 衍生品投资策略 (三) 资产支持证券投资策略
业绩比较基准	中证 AAA 科技创新公司债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。 本基金为指数型基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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	102,537,652.93
2. 本期利润	210,835,023.93
3. 加权平均基金份额本期利润	0.8435
4. 期末基金资产净值	35,961,578,154.62
5. 期末基金份额净值	101.3633

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。

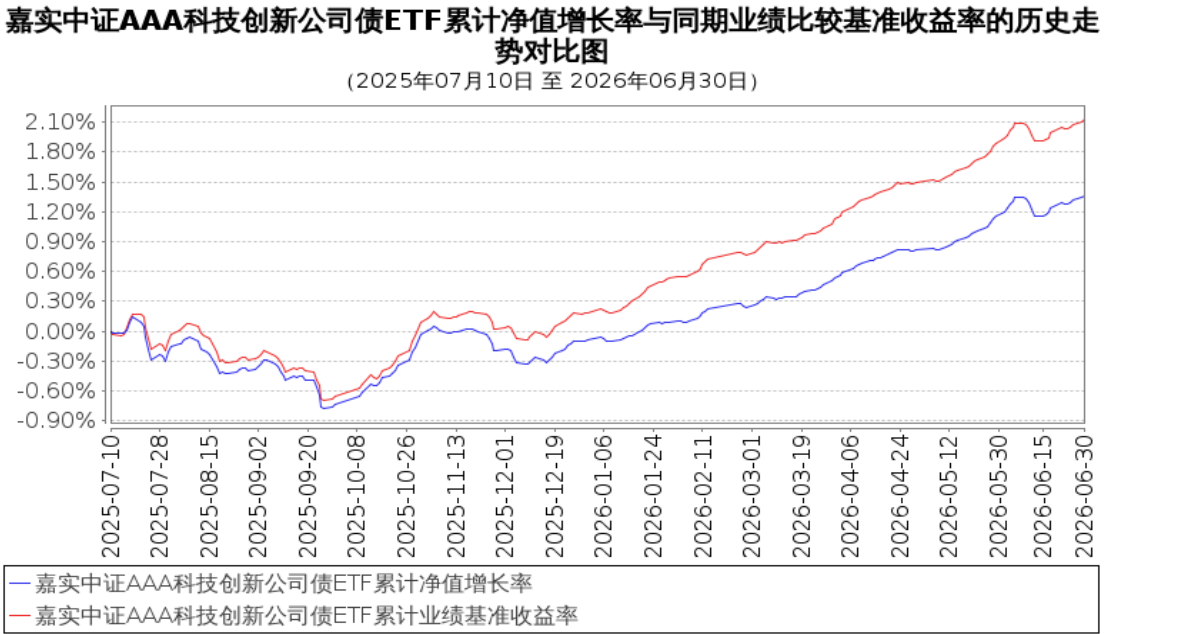
3.2 基金净值表现

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 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.82%	0.02%	0.99%	0.02%	-0.17%	0.00%
过去六个月	1.45%	0.02%	1.93%	0.02%	-0.48%	0.00%
自基金合同	1.36%	0.03%	2.12%	0.04%	-0.76%	-0.01%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



注：（1）本基金合同生效日 2025 年 07 月 10 日至报告期末未满 1 年。

（2）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		
王喆	本基金、嘉实稳福混合基金经理	2025 年 7 月 10 日	—	11 年	曾任普华永道会计师事务所审计部高级审计员、工银瑞信基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理。2021 年 2 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。
闵锐	本基金、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实	2025 年 7 月 19 日	—	10 年	2015 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益研究部，从事信用研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

稳荣债券、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实稳骏纯债债券、嘉实致诚纯债债券、嘉实汇享 30 天持有期纯债债券、嘉实稳恒 90 天持有期债券基金经理				
---	--	--	--	--

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、《嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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 年二季度，经济基本面延续 K 型分化，市场资金维持宽松，债市整体上涨。二季度债市的核心矛盾在于资金面。4 月以来央行加快资金回笼，5 月中旬流动性从极度充裕回归常态，6 月初理财预防性赎回对债市造成小幅扰动，随后债市再次进入震荡格局。

投资操作方面，本基金紧密跟踪基准指数，优选指数中有代表性和流动性较好的成分券和备选成分券，不断优化资产结构，提升组合流动性。本基金有效控制跟踪误差，2026 年二季度，日均跟踪误差 0.00%，年化跟踪误差 0.06%。

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 101.3633 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.82%，业绩比较基准收益率为 0.99%。

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	—	—
	其中：股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	32,205,884,467.04	82.46
	其中：债券	32,205,884,467.04	82.46
	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	2,700,000,000.00	6.91
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,146,921,374.81	10.62
8	其他资产	3,047,987.67	0.01

9	合计	39,055,853,829.52	100.00
---	----	-------------------	--------

注：债券投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

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

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,683,572.60	0.03
2	央行票据	—	—
3	金融债券	2,221,847,599.99	6.18
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	29,973,193,822.22	83.35
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	32,205,724,994.81	89.56

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	243667	25 管网 SK	5,300,000	537,263,178.09	1.49
2	245499	26 华电 K4	4,500,000	450,481,315.05	1.25
3	524541	25 诚通 K1	3,200,000	334,143,123.30	0.93
4	241598	24 中化 K1	3,000,000	314,410,273.98	0.87
5	241379	24 尧矿 K3	3,000,000	307,330,273.98	0.85

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**

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

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	3,047,987.67
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	3,047,987.67

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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	312,768,913.00
报告期期间基金总申购份额	172,970,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	130,960,000.00
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	354,778,913.00

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2026-04-08 至 2026-04-14, 2026-04-17 至 2026-04-21, 2026-06-11 至 2026-06-17	35,869,510.00	196,296,071.00	224,177,521.00	7,988,060.00	2.25
产品特有风险							
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。 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。

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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。

(2) 《嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

(3) 《嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

(4) 《嘉实中证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数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 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 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

2026 年 7 月 21 日