嘉实 6 个月理财债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。（注：2026 年 6 月 26 日至 2026 年 12 月 22 日为第十期运作期。）

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实 6 个月理财债券
基金主代码	003879
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 19 日
报告期末基金份额总额	5,001,498,721.21 份
投资目标	在力求本金安全的基础上，追求稳定收益。
投资策略	在运作期内，本基金将在坚持组合久期与运作期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要，在运作期之间的短暂开放期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。 本基金主要投资于利率市场化程度较高的货币市场工具，如：银行定期存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、超短期融资券、即将到期的中期票据等）等。在运作期，根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，主要采取持有到期的投资策略。 具体策略包括：资产配置策略、银行定期存款及大额存单投资策略、债券回购投资策略、短期信用债券投资策略、中小企业私募债投资策略。
业绩比较基准	-

风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实 6 个月理财债券 A	嘉实 6 个月理财债券 E
下属分级基金的交易代码	003879	004356
报告期末下属分级基金的份额总额	28,870.40 份	5,001,469,850.81 份

§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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	嘉实 6 个月理财债券 A	嘉实 6 个月理财债券 E
1.本期已实现收益	30.15	7,090,395.37
2.本期利润	30.15	7,090,395.37
3.加权平均基金份额本期利润	0.0010	0.0014
4.期末基金资产净值	28,981.22	5,078,770,832.56
5.期末基金份额净值	1.0038	1.0155

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）本基金以 2026 年 6 月 26 日至 2026 年 12 月 22 日为第十个运作期。

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

嘉实 6 个月理财债券 A

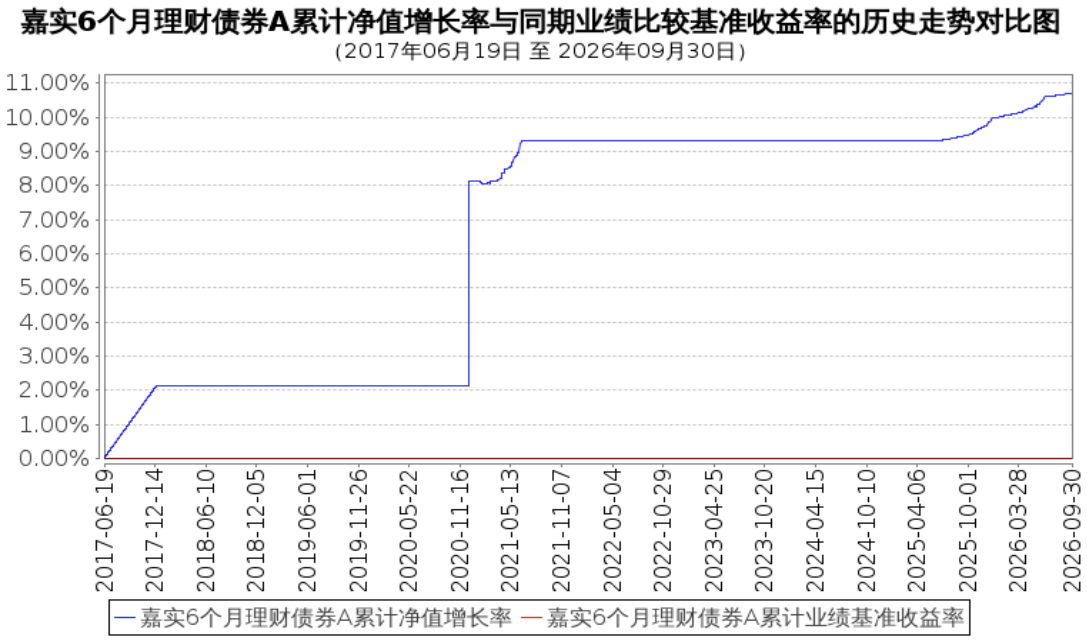
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.10%	0.00%	-	-	-	-
过去六个月	0.57%	0.01%	-	-	-	-
过去一年	1.22%	0.01%	-	-	-	-

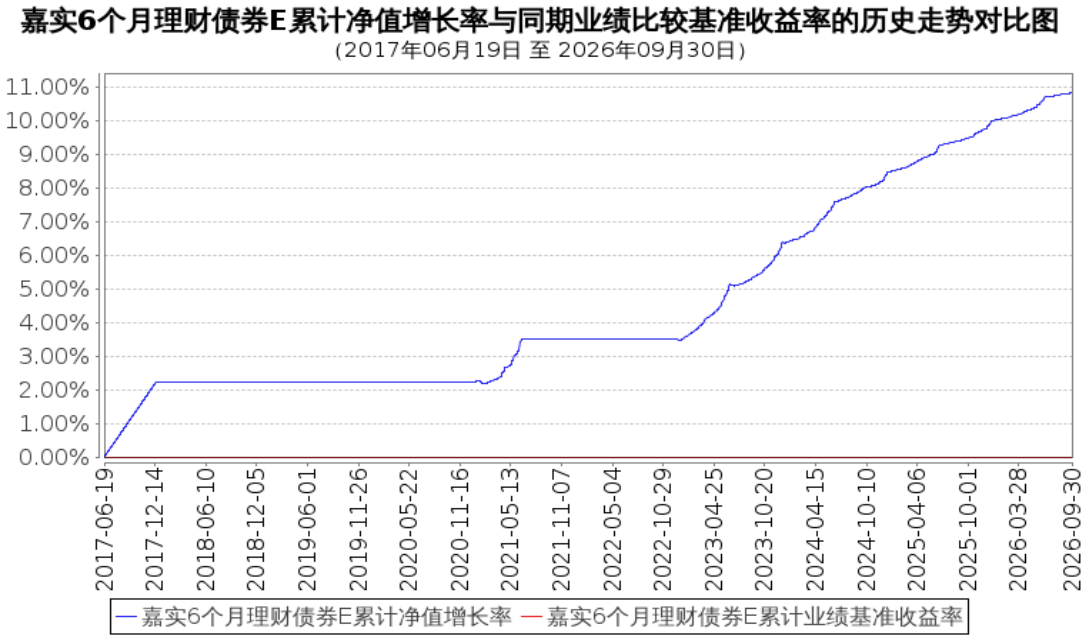
过去三年	1.38%	0.01%	-	-	-	-
过去五年	1.38%	0.01%	-	-	-	-
过去七年	8.59%	0.29%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.71%	0.24%	-	-	-	-

嘉实 6 个月理财债券 E

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	0.15%	0.00%	-	-	-	-
过去六个月	0.64%	0.01%	-	-	-	-
过去一年	1.36%	0.01%	-	-	-	-
过去三年	5.40%	0.01%	-	-	-	-
过去五年	7.33%	0.01%	-	-	-	-
过去七年	8.60%	0.02%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	10.83%	0.01%	-	-	-	-

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：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自每个运作期开始后的 15 个工作日内为建仓期，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		

李曈	本基金、嘉实活钱包货币、嘉实稳盛债券、嘉实现金添利货币、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实 60 天滚动持有短债、嘉实短债债券、嘉实 90 天滚动持有短债、嘉实鑫福一年持有期混合、嘉实 30 天持有期中短债债券、嘉实稳宁纯债债券、嘉实汇利 120 天滚动持有纯债基金经理	2026 年 1 月 28 日	-	17 年	曾任中国建设银行金融市场部、机构业务部业务经理。2014 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系策略投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
张琪	本基金、嘉实稳盛债券、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实短债债券、嘉实鑫福一年持有期混合、嘉实 30 天持有期中	2026 年 7 月 7 日	-	10 年	曾任嘉实基金管理有限公司交易部债券交易员，南方基金管理股份有限公司固定收益投资部账户投资助理，上海国泰君安证券资产管理有限公司固定收益投资部（北京）基金经理。2024 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	短债债券、嘉实稳宁纯债债券、嘉实汇利 120 天滚动持有纯债基金经理				

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遵规守信情况的说明

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 6 个月理财债券型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，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

国际层面，2026 年三季度海外通胀维持高位。其一，地缘冲突反复扰动市场，原油等能源供应链持续承压，油价运行于偏高区间。原油供给端的不确定性进一步推升汽柴油、化工原料等下

游品价格，成为支撑海外通胀高位运行的重要因素。其二，AI 技术持续迭代与产业渗透，强化了市场对中长期生产效率改善的预期。报告期内，依托 AI 产业链带动，美国经济保持景气，失业率维持低位，薪资与物价形成正向循环；美联储抗通胀立场坚定，美债为代表的发达经济体利率于三季度显著上行。

国内层面，2026 年三季度国内经济延续结构性分化特征，内外需强弱格局进一步凸显。出口、半导体、能源有色等上中游产业景气度相对较高；地产、内需消费板块仍有待提振。生产端，9 月制造业 PMI 录得 50.1，重返扩张区间。内需端，截至 8 月，全国一般公共预算支出累计同比增长 1.2%；8 月社会消费品零售总额累计同比增长 1.1%。投资端，1-8 月固定资产投资累计同比下降 7.2%，其中制造业投资累计同比下降 2.3%，房地产开发投资累计同比下降 21.5%。出口保持高增态势，1—8 月人民币计价出口金额累计同比上升 14.6%，进口金额累计同比上升 22%。物价温和修复，8 月 CPI 同比上涨 0.8%，PPI 同比上涨 3.8%，持续保持正增长。金融数据方面，8 月政府债券存量同比增长 13.4%，人民币贷款余额同比增长 4.9%。

债券市场方面，三季度央行保持流动性合理充裕，资金价格中枢小幅抬升，整体维持稳健偏宽松态势。受政府债券供给、信贷扩张速度、广义基金规模变动等因素共同影响，收益率曲线呈现短端上行、中长端下行的平坦化特征：1 年期国债收益率上行至 1.22%，10 年期国债收益率下行至 1.68%，10 年期与 1 年期国债期限利差明显收窄。

2026 年三季度，本产品深度研判国内外宏观经济形势，密切跟踪政策动态，审慎应对市场波动。在严守流动性安全底线的前提下，把握阶段性收益率高点优化资产配置组合，保障基金流动性安全，实现收益平稳增长。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实 6 个月理财债券 A 基金份额净值为 1.0038 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.10%；截至本报告期末嘉实 6 个月理财债券 E 基金份额净值为 1.0155 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.15%。

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	6,193,084,946.56	88.13
	其中：债券	6,193,084,946.56	88.13
	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	834,436,523.85	11.87
8	其他资产	-	-
9	合计	7,027,521,470.41	100.00

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	838,108,638.53	16.50
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	183,156,302.32	3.61
5	企业短期融资券	4,612,364,205.44	90.82
6	中期票据	509,635,616.19	10.03
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,820,184.08	0.98
9	其他	-	-
10	合计	6,193,084,946.56	121.94

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

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	012680545	26 江西交投 SCP003	1,500,000	151,109,177.59	2.98
2	2322019	23 招银金租债 02	1,200,000	122,734,217.25	2.42
3	240408	23 中证 30	1,000,000	102,354,273.27	2.02
4	252380005	23 交银金租债 01	1,000,000	102,263,324.90	2.01
5	012681686	26 中石化 SCP001	1,020,000	102,240,504.95	2.01

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，交银金融租赁有限责任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，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

无。

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

项目	嘉实 6 个月理财债券 A	嘉实 6 个月理财债券 E
报告期期初基金份额总额	28,870.40	5,001,469,850.81
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	-	-
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	28,870.40	5,001,469,850.81

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 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§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 6 个月理财债券型证券投资基金注册的批复文件；

（2）《嘉实 6 个月理财债券型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实 6 个月理财债券型证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实 6 个月理财债券型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 6 个月理财债券型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 10 月 27 日