

嘉实同舟债券型证券投资基金 2026 年中期报告

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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.11 本报告期投资基金情况	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
§ 12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实同舟债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实同舟债券	
基金主代码	018562	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 7 月 24 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	1, 295, 486, 816. 60 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	嘉实同舟债券 A	嘉实同舟债券 C
下属分级基金的交 易代码	018562	018563
报告期末下属分级 基金的份额总额	263, 076, 110. 34 份	1, 032, 410, 706. 26 份

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,通过债券及股票主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	资产配置策略: 本基金将根据对宏观经济周期的分析研究, 结合基本面、政策面、资金面等多种因素综合考量, 研判所处经济周期的位置及未来发展方向, 在控制风险的前提下, 确定组合中股票、债券、基金、货币市场工具及其他金融工具的比例, 并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 债券等固定收益类资产投资策略: 本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素, 并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征, 在符合本基金相关投资比例规定的前提下, 决定组合的久期水平、期限结构和类属配置, 并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理, 力争获取较高的投资收益。 可转换债券与可交换债券投资策略: 本基金将借鉴信用债的基本面研究, 从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、盈利能力、治理结构等方面进行考察, 精选信用违约风险小的可转换债券/可交换债券进行投资。本基金将在定量分析与主动研究相结合的基础上, 结合可转换债券/可交换债券的交易价格、转换条件以及转股价值, 制定相应的投资策略以及选择合适的转换时机。 股票投资策略: 本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合, 精选行业和个股的策略。以公司行业研究员的基本分析为基础, 同时结合数量化的系统选股方法, 精选价值被低估的投资品种。 基金投资策略: 按管理模式分类, 主要包括主动管理型基金和被动

	管理型基金两大类。主动管理型基金筛选流程包括初选和精选两个阶段，本基金首先根据基金历史业绩、基金风险调整后的收益（信息比率、Sharpe 比率）、基金的规模和流动性等一系列量化指标对基金进行初步筛选并确定适选基金。之后通过对适选基金的定性及定量分析再次精选基金，力求寻找到投资风格稳定、业绩持续优秀并具有良好的风险管理能力的投资品种。对于指数基金及指数增强基金等被动管理的产品，本基金将根据基金的指数标的、基金的规模和流动性、跟踪误差等量化指标筛选，并结合本基金的投资目标及基金投资策略进行投资，作为基金投资策略的有效补充。 衍生品投资策略：本基金的衍生品投资将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用国债期货、信用衍生品等衍生工具，将根据风险管理的原则，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。
业绩比较基准	中债总财富（总值）指数收益率 $\times 90\%$ +中证 800 指数收益率 $\times 7\%$ +恒生指数收益率 $\times 3\%$ （人民币计价）
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的的股票，一旦投资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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	林盛
	联系电话	(010)65215588	010-58560666
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95568
传真		(010)65215588	010-57093382
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	北京市西城区复兴门内大街 2 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	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100020	100031
法定代表人		经雷	高迎欣

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	嘉实同舟债券 A	嘉实同舟债券 C
本期已实现收益	4,801,665.23	13,576,387.42
本期利润	5,525,576.64	21,082,075.09
加权平均基金份 额本期利润	0.0239	0.0197
本期加权平均净 值利润率	2.19%	1.82%
本期基金份额净 值增长率	2.43%	2.24%
3.1.2 期 末 数 据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	23,932,179.08	80,746,625.35
期末可供分配基 金份额利润	0.0910	0.0782
期末基金资产净 值	290,915,846.01	1,128,300,293.66
期末基金份额净 值	1.1058	1.0929
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净 值增长率	10.58%	9.29%

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

嘉实同舟债券 A

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
过去三个月	2.30%	0.21%	1.71%	0.13%	0.59%	0.08%
过去六个月	2.43%	0.20%	2.15%	0.13%	0.28%	0.07%
过去一年	6.64%	0.17%	3.08%	0.12%	3.56%	0.05%
自基金合同生效起至今	10.58%	0.13%	14.53%	0.12%	-3.95%	0.01%

嘉实同舟债券 C

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
过去三个月	2.21%	0.21%	1.71%	0.13%	0.50%	0.08%
过去六个月	2.24%	0.20%	2.15%	0.13%	0.09%	0.07%
过去一年	6.23%	0.17%	3.08%	0.12%	3.15%	0.05%
自基金合同生效起至今	9.29%	0.13%	14.53%	0.12%	-5.24%	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：

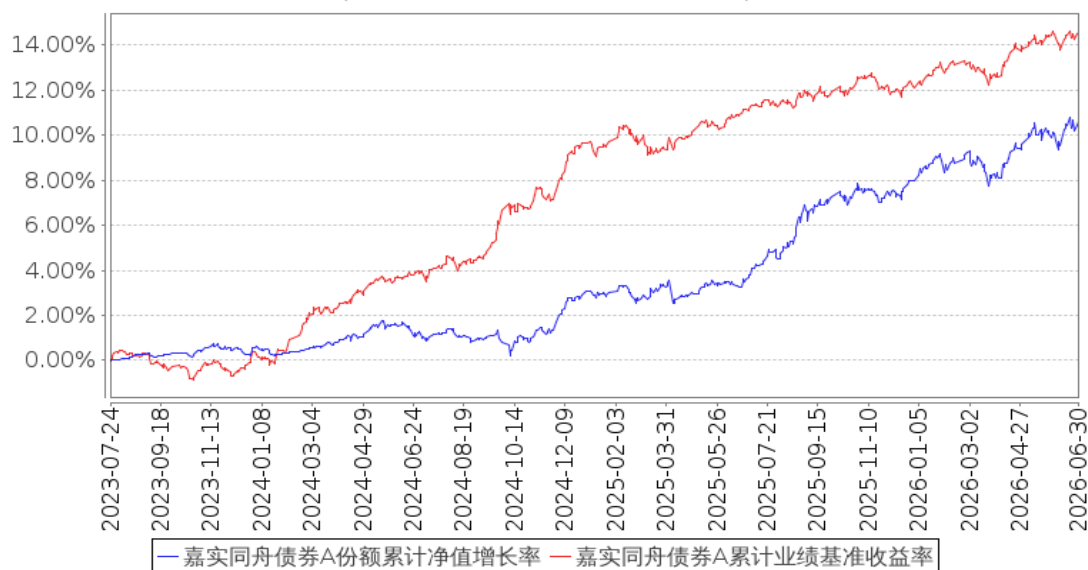
$$\text{Return}(t) = 90\% \times (\text{中债总财富(总值)指数}(t) / \text{中债总财富(总值)指数}(t-1) - 1) + 7\% \times (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 3\% \times (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

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

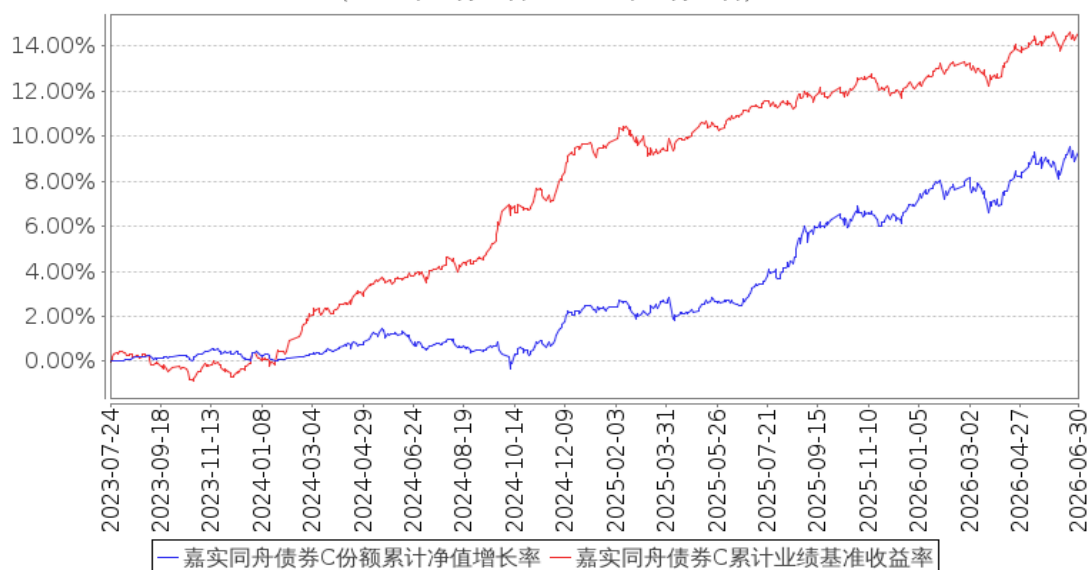
其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

嘉实同舟债券A份额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
(2023年07月24日至2026年06月30日)



嘉实同舟债券C份额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
(2023年07月24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金字[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 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 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、不动产基金等不同类别。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		
轩璇	本基金、嘉实债券、嘉实纯债债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新趋势混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发	2023 年 7 月 25 日	—	14 年	曾任易方达基金管理有限公司固定收益部高级研究员、基金经理助理。2019 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	起、嘉实年年红一年持有债券发起式、嘉实致泰一年定开纯债债券发起式基金经理				
李欣	本基金、嘉实新财富混合、嘉实稳盛债券、嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起基金经理	2025 年 2 月 6 日	-	15 年	曾任普华永道高级精算师、中国国际金融有限公司研究员、海通证券股份有限公司高级分析师。2014 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员。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、《嘉实同舟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 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 3 次，其中 2 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 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

2026 年上半年，A 股市场呈现“指数牛、个股熊”的强分化特征：1) 个股上涨 vs 下跌数量：1715vs3804；2) 板块表现：科创 50 为 64%的涨幅 vs 上证 50 获得 1.4%的跌幅；3) 行业分化：电子和通信获得 86%/73%的涨幅 vs 有 21 个一级行业半年获得了负收益；4) 全球表现：电子制造业占比高的日韩台市场显著跑赢。

2026 年上半年，嘉实同舟权益部分依然保持均衡风格，仓位相对较为稳定，权益结构上变化也不大，主要集中在电子、金融、周期（有色化工）、制造（电力设备、工程机械）这几个板块，相对低配消费、医药。

债券方面，实体经济资产回报率持续走低，推动“资产荒”格局进一步深化。商业银行在信贷投放受阻的背景下加速增配债券类资产，形成信贷需求不足、银行增配债券、收益率下行的核心传导链条，上半年债券市场震荡小幅向下。

操作上，纯债部分以高等级信用债作为底仓配置核心，贯穿上半年始终。在久期管理上，一季度维持中性久期中枢，根据资金面与利率波动进行灵活微调，兼顾票息收益与利率风险控制。进入二季度，基于对基本面修复节奏偏缓、货币政策维持宽松基调的判断，我们主动提升组合久期水平，积极捕捉利率下行带来的波段收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实同舟债券 A 基金份额净值为 1.1058 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.43%；截至本报告期末嘉实同舟债券 C 基金份额净值为 1.0929 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.24%；业绩比较基准收益率为 2.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为科技依然是基本面业绩确定性最高的板块，因此如果在其他领域没有明确政策出台之前，大概率下科技仍然是市场主线。但毕竟科技板块在过去一年当中涨幅过大，因此上半年被吸血较为明显的红利板块我们觉得下半年的机会也比较大。整体来看我们依然看好科技成长+低估值红利的哑铃两端行情。

展望下半年，债券市场的震荡格局较难打破。一方面，周期性修复力量正在积聚：上半年财政支出落后于预算序时进度，专项债发行放缓，为下半年留出了充足的存量政策空间，中央预算

内投资加快落地，三季度财政发力具有较高确定性，经济下行压力有望边际缓解。另一方面，趋势性下行力量依然深刻：居民资产负债表修复尚未完成，收入预期未见改善，耐用品消费在超前刺激后必然经历“还账”过程，消费回升基础不牢；同时“零基预算”试点、政府投资提级审批等财政纪律约束不断加强，中长期总需求中枢面临下移压力。从定价角度，收益率已充分隐含经济下行预期，货币宽松态度不明、缺乏进一步下行催化剂；通胀预期回落、风险偏好下降、配置资金力量持续显现，构成收益率上方的坚实压制。在此格局下，组合操作上计划保持中性的久期水平，同时通过骑乘、利差策略进行收益增厚。

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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开

支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 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：嘉实同舟债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	754,852.85	1,114,732.30
结算备付金		6,711,380.93	437,958.92
存出保证金		187,942.83	23,591.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,458,022,448.09	479,970,961.22
其中：股票投资		221,244,748.87	80,600,425.33
基金投资		-	-
债券投资		1,236,777,699.22	399,370,535.89
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	-	34,970,236.31
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		41,899,128.43	4,997,204.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,507,575,753.13	521,514,684.90

负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		74,003,081.64	60,009,697.30
应付清算款		0.05	-
应付赎回款		12,836,302.29	6,103,292.02
应付管理人报酬		736,272.81	259,085.52
应付托管费		105,181.82	37,012.23
应付销售服务费		325,757.24	119,303.56
应付投资顾问费		-	-
应交税费		47,267.52	11,925.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	305,750.09	227,017.33
负债合计		88,359,613.46	66,767,333.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,295,486,816.60	424,432,799.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	123,729,323.07	30,314,552.59
净资产合计		1,419,216,139.67	454,747,351.62
负债和净资产总计		1,507,575,753.13	521,514,684.90

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实同舟债券 A 基金份额净值 1.1058 元，基金份额总额 263,076,110.34 份，嘉实同舟债券 C 基金份额净值 1.0929 元，基金份额总额 1,032,410,706.26 份，基金份额总额合计为 1,295,486,816.60 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实同舟债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		35,965,574.01	1,885,575.57
1. 利息收入		76,274.80	4,606.60
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,488.89	4,606.60
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		54,785.91	-

收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		27,580,011.40	3,094,962.12
其中：股票投资收益	6.4.7.14	12,992,895.97	-166,844.06
基金投资收益	6.4.7.15	-15,809.81	-
债券投资收益	6.4.7.16	12,276,392.48	2,938,242.25
资产支持证券投资 收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	2,326,532.76	323,563.93
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	8,229,599.08	-1,214,381.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	79,688.73	388.17
减：二、营业总支出		9,357,922.28	1,136,346.93
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,922,638.01	526,030.90
2. 托管费	6.4.10.2.2	703,234.04	75,147.32
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,313,159.60	57,744.45
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,259,203.88	358,058.66
其中：卖出回购金融资产 支出		1,259,203.88	358,058.66
6. 信用减值损失	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		34,867.54	3,982.85
8. 其他费用	6.4.7.25	124,819.21	115,382.75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,607,651.73	749,228.64
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,607,651.73	749,228.64
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		26,607,651.73	749,228.64

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实同舟债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	424,432,799.03	-	30,314,552.59	454,747,351.62
二、本期期初净资产	424,432,799.03	-	30,314,552.59	454,747,351.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	871,054,017.57	-	93,414,770.48	964,468,788.05
(一)、综合收益总额	-	-	26,607,651.73	26,607,651.73
(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)	871,054,017.57	-	66,807,118.75	937,861,136.32
其中：1. 基金申购款	3,147,950,634.50	-	253,716,616.57	3,401,667,251.07
2. 基金赎回款	-2,276,896,616.93	-	-186,909,497.82	-2,463,806,114.75
(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	1,295,486,816.60	-	123,729,323.07	1,419,216,139.67
项目	上年度可比期间 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、上期期末净资产	177,991,795.75	-	5,226,375.26	183,218,171.01
二、本期期初净资产	177,991,795.75	-	5,226,375.26	183,218,171.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-51,596,651.35	-	-821,019.26	-52,417,670.61
(一)、综合收益总额	-	-	749,228.64	749,228.64

（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）	-51,596,651.35	-	-1,570,247.90	-53,166,899.25
其中：1. 基金申购款	11,144,899.27	-	271,164.39	11,416,063.66
2. 基金赎回款	-62,741,550.62	-	-1,841,412.29	-64,582,962.91
（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	126,395,144.40	-	4,405,356.00	130,800,500.40

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

嘉实同舟债券型证券投资基金(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[2023]1047 号《关于准予嘉实同舟债券型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《嘉实同舟债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实同舟债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 7 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,868,319,082.19 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

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、应用指南、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”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信

息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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《财政部国家税务总局证监会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[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会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[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(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、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

(2)对证券投资基金取得的自 2025 年 8 月 8 日之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；取得的在 2025 年 8 月 8 日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

(3)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；

(4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。对基金通过港股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。基金通过港股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；

(5)对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；对于基金通过深港通买卖、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；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

(6)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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	754,852.85
等于：本金	754,777.22
加：应计利息	75.63

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	754,852.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	213,907,731.61	-	221,244,748.87	7,337,017.26
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	1,220,534,043.57	12,931,699.22	1,236,777,699.22
	合计	1,220,534,043.57	12,931,699.22	1,236,777,699.22
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,434,441,775.18	12,931,699.22	1,458,022,448.09	10,648,973.69

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 2026 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	226,406.93

其中：交易所市场	198,233.25
银行间市场	28,173.68
应付利息	—
预提费用	79,343.16
合计	305,750.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实同舟债券 A

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,846,041.72	96,846,041.72
本期申购	264,293,581.25	264,293,581.25
本期赎回（以“-”号填列）	-98,063,512.63	-98,063,512.63
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	263,076,110.34	263,076,110.34

嘉实同舟债券 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	327,586,757.31	327,586,757.31
本期申购	2,883,657,053.25	2,883,657,053.25
本期赎回（以“-”号填列）	-2,178,833,104.30	-2,178,833,104.30
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	1,032,410,706.26	1,032,410,706.26

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

嘉实同舟债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,589,524.77	1,114,781.53	7,704,306.30
本期期初	6,589,524.77	1,114,781.53	7,704,306.30
本期利润	4,801,665.23	723,911.41	5,525,576.64

本期基金份额交易产生的变动数	12,540,989.08	2,068,863.65	14,609,852.73
其中：基金申购款	20,375,400.82	3,687,574.93	24,062,975.75
基金赎回款	-7,834,411.74	-1,618,711.28	-9,453,123.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,932,179.08	3,907,556.59	27,839,735.67

嘉实同舟债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,877,841.15	3,732,405.14	22,610,246.29
本期期初	18,877,841.15	3,732,405.14	22,610,246.29
本期利润	13,576,387.42	7,505,687.67	21,082,075.09
本期基金份额交易产生的变动数	48,292,396.78	3,904,869.24	52,197,266.02
其中：基金申购款	190,281,917.16	39,371,723.66	229,653,640.82
基金赎回款	-141,989,520.38	-35,466,854.42	-177,456,374.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,746,625.35	15,142,962.05	95,889,587.40

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,061.99
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,642.67
其他	6,784.23
合计	21,488.89

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	12,992,895.97
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	12,992,895.97

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	562,523,777.36
减：卖出股票成本总额	548,627,869.60
减：交易费用	903,011.79
买卖股票差价收入	12,992,895.97

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	63,396,801.37
减：卖出/赎回基金成本总额	63,407,538.90
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	5,072.28
基金投资收益	-15,809.81

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	12,823,633.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-547,240.76
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	12,276,392.48

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	728,595,255.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	722,637,922.50
减：应计利息总额	6,486,600.85
减：交易费用	17,972.86
买卖债券差价收入	-547,240.76

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

股票投资产生的股利收益	2,326,532.76
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	2,326,532.76

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,229,599.08
股票投资	4,823,240.80
债券投资	3,406,358.28
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	8,229,599.08

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	79,534.54
基金转出费收入	154.19
合计	79,688.73

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	26,836.69
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
存托服务费	39.36

合计	124,819.21
----	------------

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、关联关系

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
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,922,638.01	526,030.90
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,258,832.37	258,184.25
应支付基金管理人的净管理费	2,663,805.64	267,846.65

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 0.70%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×0.70%/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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	703,234.04	75,147.32

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。

6.4.10.2.3 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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实同舟债券 A	嘉实同舟债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	24,963.97	24,963.97
民生银行	-	2,288,179.23	2,288,179.23
合计	-	2,313,143.20	2,313,143.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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		
	嘉实同舟债券 A	嘉实同舟债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	5,172.61	5,172.61
民生银行	-	52,570.50	52,570.50
合计	-	57,743.11	57,743.11

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，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：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。
(2) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
中国民生银行股份有限公司	-	70,418,787.95	-	-	358,000,000.00	14,845.04
上年度可比期间 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
-	-	-	-	-	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国民生银行股份有限公司_活期	754,852.85	9,061.99	1,256,376.30	2,011.01

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	400	144,597.07	351,812.00	

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 2026 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 74,003,081.64 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
250423	25 农发 23	2026 年 7 月 1 日	101.88	590,000	60,107,308.77
260010	26 付息国债 10	2026 年 7 月 1 日	100.17	189,000	18,932,068.37
合计				779,000	79,039,377.14

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 risk 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，还有董事会合规与风险控制委员会、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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	10,035,931.51
A-1 以下	-	-

未评级	217,173,855.06	45,199,739.17
合计	217,173,855.06	55,235,670.68

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	306,044,618.64	111,560,945.21
AAA 以下	31,086,657.53	—
未评级	682,472,567.99	232,573,920.00
合计	1,019,603,844.16	344,134,865.21

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

无。

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时间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 2026 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	754,852.85	-	-	-	754,852.85
结算备付金	6,711,380.93	-	-	-	6,711,380.93
存出保证金	187,942.83	-	-	-	187,942.83
交易性金融资产	626,780,435.61	346,033,326.03	263,963,937.58	221,244,748.87	1,458,022,448.09
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	-	-	-	41,899,128.43	41,899,128.43
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	634,434,612.22	346,033,326.03	263,963,937.58	263,143,877.30	1,507,575,753.13
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	74,003,081.64	-	-	-	74,003,081.64
应付清算款	-	-	-	0.05	0.05
应付赎回款	-	-	-	12,836,302.29	12,836,302.29
应付管理人报酬	-	-	-	736,272.81	736,272.81
应付托管费	-	-	-	105,181.82	105,181.82
应付销售服务费	-	-	-	325,757.24	325,757.24
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	47,267.52	47,267.52
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	305,750.09	305,750.09
负债总计	74,003,081.64	-	-	14,356,531.82	88,359,613.46
利率敏感度缺口	560,431,530.58	346,033,326.03	263,963,937.58	248,787,345.48	1,419,216,139.67
上年度末 2025 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	1,114,732.30	-	-	-	1,114,732.30
结算备付金	437,958.92	-	-	-	437,958.92
存出保证金	23,591.65	-	-	-	23,591.65
交易性金融资产	197,950,852.60	180,991,164.93	20,428,518.36	80,600,425.33	479,970,961.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	34,970,236.31	-	-	-	34,970,236.31
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,997,204.50	4,997,204.50
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	234,497,371.78	180,991,164.93	20,428,518.36	85,597,629.83	521,514,684.90
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	60,009,697.30	-	-	-	60,009,697.30
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,103,292.02	6,103,292.02
应付管理人报酬	-	-	-	259,085.52	259,085.52
应付托管费	-	-	-	37,012.23	37,012.23
应付销售服务费	-	-	-	119,303.56	119,303.56
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,925.32	11,925.32
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	227,017.33	227,017.33
负债总计	60,009,697.30	-	-	6,757,635.98	66,767,333.28
利率敏感度缺口	174,487,674.48	180,991,164.93	20,428,518.36	78,839,993.85	454,747,351.62

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	9,267,800.83	1,953,454.05
	市场利率上升 25 个基点	-8,939,843.47	-1,932,534.17

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	221, 244, 748. 87	15. 59	80, 600, 425. 33	17. 72
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	221, 244, 748. 87	15. 59	80, 600, 425. 33	17. 72

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月

			31 日)
	业绩比较基准上升 5%	99,268,637.67	18,624,593.92
	业绩比较基准下降 5%	-99,268,637.67	-18,624,593.92

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	220,892,936.87	80,259,925.33
第二层次	1,237,129,511.22	399,711,035.89
第三层次	-	-
合计	1,458,022,448.09	479,970,961.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本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

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	221,244,748.87	14.68
	其中：股票	221,244,748.87	14.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,236,777,699.22	82.04
	其中：债券	1,236,777,699.22	82.04
	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	7,466,233.78	0.50
8	其他各项资产	42,087,071.26	2.79
9	合计	1,507,575,753.13	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

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	223,936.00	0.02
B	采矿业	8,532,451.00	0.60
C	制造业	147,809,329.90	10.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,242,708.00	0.44
E	建筑业	5,910,450.00	0.42
F	批发和零售业	3,608,018.70	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	8,599,756.00	0.61
H	住宿和餐饮业	45,864.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,956,520.25	0.84

J	金融业	21,571,306.66	1.52
K	房地产业	344,950.36	0.02
L	租赁和商务服务业	2,997,832.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	2,715,614.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	151,680.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	77,644.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	456,688.00	0.03
	合计	221,244,748.87	15.59

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

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	300308	中际旭创	3,400	4,318,000.00	0.30
2	603986	兆易创新	5,100	4,156,500.00	0.29
3	600519	贵州茅台	3,400	4,030,666.00	0.28
4	300750	宁德时代	8,800	3,458,488.00	0.24
5	300502	新易盛	5,340	3,241,380.00	0.23
6	600900	长江电力	110,200	2,916,994.00	0.21
7	600183	生益科技	13,800	2,392,920.00	0.17
8	002352	顺丰控股	74,300	2,322,618.00	0.16
9	600020	中原高速	622,300	2,296,287.00	0.16
10	600690	海尔智家	110,000	2,245,100.00	0.16
11	002916	深南电路	4,800	2,197,920.00	0.15
12	600050	中国联通	545,400	2,181,600.00	0.15
13	601668	中国建筑	489,500	2,124,430.00	0.15
14	600019	宝钢股份	383,200	2,080,776.00	0.15
15	601225	陕西煤业	101,600	2,067,560.00	0.15
16	002003	伟星股份	244,400	2,057,848.00	0.14
17	000999	华润三九	89,190	2,005,883.10	0.14
18	000708	中信特钢	158,500	2,000,270.00	0.14
19	601800	中国交建	330,000	1,884,300.00	0.13
20	600008	首创环保	689,800	1,876,256.00	0.13
21	000333	美的集团	24,400	1,842,932.00	0.13
22	601899	紫金矿业	72,400	1,820,136.00	0.13
23	605117	德业股份	16,860	1,790,194.80	0.13
24	002027	分众传媒	364,600	1,764,664.00	0.12
25	300037	新宙邦	18,860	1,751,151.00	0.12

26	300604	长川科技	5,000	1,707,100.00	0.12
27	600132	重庆啤酒	41,200	1,701,560.00	0.12
28	000988	华工科技	8,900	1,643,029.00	0.12
29	600036	招商银行	45,600	1,618,800.00	0.11
30	600150	中国船舶	47,800	1,615,162.00	0.11
31	300408	三环集团	9,600	1,602,240.00	0.11
32	600970	中材国际	224,600	1,601,398.00	0.11
33	002961	瑞达期货	81,397	1,593,753.26	0.11
34	300666	江丰电子	4,200	1,548,120.00	0.11
35	300223	北京君正	6,200	1,543,180.00	0.11
36	688498	源杰科技	815	1,537,090.00	0.11
37	300054	鼎龙股份	14,200	1,504,774.00	0.11
38	688627	精智达	2,100	1,501,500.00	0.11
39	688610	埃科光电	5,700	1,501,380.00	0.11
40	300373	扬杰科技	9,400	1,477,962.00	0.10
41	601398	工商银行	208,500	1,474,095.00	0.10
42	688409	富创精密	4,800	1,470,000.00	0.10
43	601869	长飞光纤	2,600	1,419,340.00	0.10
44	002384	东山精密	5,400	1,416,690.00	0.10
45	002028	思源电气	8,000	1,384,000.00	0.10
46	603115	海星股份	11,300	1,383,911.00	0.10
47	688256	寒武纪	835	1,332,284.25	0.09
48	601318	中国平安	27,200	1,298,528.00	0.09
49	002475	立讯精密	18,000	1,267,200.00	0.09
50	000657	中钨高新	13,200	1,263,504.00	0.09
51	601328	交通银行	195,800	1,258,994.00	0.09
52	688525	佰维存储	2,500	1,236,825.00	0.09
53	300438	鹏辉能源	14,900	1,234,465.00	0.09
54	688041	海光信息	3,329	1,232,728.70	0.09
55	600549	厦门钨业	14,100	1,201,320.00	0.08
56	688668	鼎通科技	3,200	1,194,560.00	0.08
57	688388	嘉元科技	25,985	1,143,340.00	0.08
58	601077	渝农商行	186,900	1,141,959.00	0.08
59	688531	日联科技	6,400	1,138,176.00	0.08
60	688322	奥比中光	8,700	1,135,785.00	0.08
61	001309	德明利	1,200	1,131,480.00	0.08
62	002407	多氟多	22,400	1,125,152.00	0.08
63	001389	广合科技	4,700	1,115,075.00	0.08
64	688017	绿的谐波	2,600	1,086,436.00	0.08
65	300475	香农芯创	3,600	1,080,000.00	0.08
66	300661	圣邦股份	7,400	1,061,752.00	0.07
67	688059	华锐精密	5,300	1,058,463.00	0.07
68	688235	百济神州	4,100	1,043,901.00	0.07

69	002602	世纪华通	73,600	1,037,760.00	0.07
70	688690	纳微科技	23,500	1,036,350.00	0.07
71	301308	江波龙	1,400	985,320.00	0.07
72	605589	圣泉集团	15,400	978,978.00	0.07
73	688372	伟测科技	5,200	967,200.00	0.07
74	301358	湖南裕能	12,500	948,375.00	0.07
75	688536	思瑞浦	2,600	946,634.00	0.07
76	688628	优利德	9,500	939,930.00	0.07
77	300836	佰奥智能	12,400	917,476.00	0.06
78	300593	新雷能	30,400	913,824.00	0.06
79	301080	百普赛斯	19,000	912,000.00	0.06
80	600176	中国巨石	12,500	911,000.00	0.06
81	688012	中微公司	1,886	883,591.00	0.06
82	688692	达梦数据	3,600	879,444.00	0.06
83	605060	联德股份	15,200	862,448.00	0.06
84	000975	山金国际	50,700	861,900.00	0.06
85	688361	中科飞测	2,000	860,000.00	0.06
86	688390	固德威	7,900	857,229.00	0.06
87	002810	山东赫达	34,700	857,090.00	0.06
88	002938	鹏鼎控股	8,000	843,040.00	0.06
89	002345	潮宏基	91,200	836,304.00	0.06
90	301345	涛涛车业	3,600	831,600.00	0.06
91	688279	峰昭科技	3,700	830,428.00	0.06
92	300274	阳光电源	5,200	826,904.00	0.06
93	601988	中国银行	143,000	817,960.00	0.06
94	002294	信立泰	25,300	806,817.00	0.06
95	000426	兴业银锡	24,400	804,224.00	0.06
96	601658	邮储银行	162,800	802,604.00	0.06
97	002371	北方华创	900	796,104.00	0.06
98	688313	仕佳光子	4,300	793,995.00	0.06
99	688049	炬芯科技	16,900	792,779.00	0.06
100	601288	农业银行	129,900	788,493.00	0.06
101	001965	招商公路	86,000	787,760.00	0.06
102	002155	湖南黄金	32,700	780,549.00	0.05
103	002558	巨人网络	28,300	779,948.00	0.05
104	000066	中国长城	40,900	779,145.00	0.05
105	300277	汽轮科技	51,800	779,072.00	0.05
106	600018	上港集团	164,700	777,384.00	0.05
107	688188	柏楚电子	7,280	776,776.00	0.05
108	000938	紫光股份	26,800	773,448.00	0.05
109	600919	江苏银行	71,000	765,380.00	0.05
110	002812	恩捷股份	11,400	762,774.00	0.05
111	002545	东方铁塔	47,000	762,340.00	0.05

112	002466	天齐锂业	12,300	754,236.00	0.05
113	601298	青岛港	93,400	751,870.00	0.05
114	600111	北方稀土	15,500	744,775.00	0.05
115	603268	松发股份	5,300	738,184.00	0.05
116	002444	巨星科技	23,600	733,960.00	0.05
117	002240	盛新锂能	16,300	730,729.00	0.05
118	300073	当升科技	15,100	725,404.00	0.05
119	000973	佛塑科技	50,300	721,805.00	0.05
120	000408	藏格矿业	10,400	720,928.00	0.05
121	601229	上海银行	82,400	715,232.00	0.05
122	688311	盟升电子	27,200	712,368.00	0.05
123	300432	富临精工	35,400	711,186.00	0.05
124	000893	亚钾国际	17,300	707,397.00	0.05
125	601166	兴业银行	42,700	707,112.00	0.05
126	000001	平安银行	70,200	705,510.00	0.05
127	601009	南京银行	71,100	703,179.00	0.05
128	002222	福晶科技	7,600	701,328.00	0.05
129	688981	中芯国际	4,415	701,190.30	0.05
130	601998	中信银行	101,100	700,623.00	0.05
131	002738	中矿资源	11,800	696,082.00	0.05
132	000538	云南白药	14,600	691,602.00	0.05
133	000921	海信家电	25,300	691,196.00	0.05
134	002008	大族激光	4,600	690,506.00	0.05
135	603993	洛阳钼业	39,300	689,715.00	0.05
136	603515	欧普照明	42,200	689,548.00	0.05
137	600926	杭州银行	47,600	687,820.00	0.05
138	600499	科达制造	49,700	685,860.00	0.05
139	002487	大金重工	11,800	684,046.00	0.05
140	002497	雅化集团	33,500	682,395.00	0.05
141	300919	中伟新材	15,500	678,125.00	0.05
142	688778	厦钨新能	12,415	675,376.00	0.05
143	603259	药明康德	5,400	672,354.00	0.05
144	600389	江山股份	34,300	669,536.00	0.05
145	600489	中金黄金	36,700	662,435.00	0.05
146	002780	三夫户外	54,500	661,630.00	0.05
147	300972	万辰集团	3,800	658,958.00	0.05
148	300738	奥飞数据	32,500	657,150.00	0.05
149	601169	北京银行	133,900	656,110.00	0.05
150	000425	徐工机械	81,100	656,099.00	0.05
151	000949	新乡化纤	103,400	655,556.00	0.05
152	603369	今世缘	27,600	654,396.00	0.05
153	600023	浙能电力	124,100	652,766.00	0.05
154	600694	大商股份	49,190	650,783.70	0.05

155	601601	中国太保	22,600	644,552.00	0.05
156	688195	腾景科技	3,340	643,217.20	0.05
157	600276	恒瑞医药	12,300	640,092.00	0.05
158	601187	厦门银行	93,600	639,288.00	0.05
159	601006	大秦铁路	135,900	626,499.00	0.04
160	601963	重庆银行	61,800	622,944.00	0.04
161	002624	完美世界	49,100	609,822.00	0.04
162	600160	巨化股份	11,500	609,615.00	0.04
163	600809	山西汾酒	5,500	601,535.00	0.04
164	300979	华利集团	19,800	589,050.00	0.04
165	603277	银都股份	58,300	581,834.00	0.04
166	002966	苏州银行	83,265	579,524.40	0.04
167	601939	建设银行	59,900	576,837.00	0.04
168	601665	齐鲁银行	98,400	567,768.00	0.04
169	603059	倍加洁	23,400	567,450.00	0.04
170	300681	英搏尔	19,300	552,366.00	0.04
171	300394	天孚通信	1,820	550,877.60	0.04
172	688766	普冉股份	700	536,620.00	0.04
173	002463	沪电股份	3,500	534,800.00	0.04
174	002749	国光股份	66,940	534,181.20	0.04
175	688708	佳驰科技	10,370	526,796.00	0.04
176	002557	洽洽食品	29,300	526,228.00	0.04
177	603885	吉祥航空	50,500	519,645.00	0.04
178	600861	北京人力	41,500	506,300.00	0.04
179	603368	柳药集团	33,900	497,313.00	0.04
180	688548	广钢气体	9,344	486,822.40	0.03
181	002142	宁波银行	15,700	466,133.00	0.03
182	600673	东阳光	13,600	456,688.00	0.03
183	000338	潍柴动力	16,700	455,075.00	0.03
184	000807	云铝股份	19,800	438,372.00	0.03
185	600285	羚锐制药	22,300	432,174.00	0.03
186	000786	北新建材	23,000	416,070.00	0.03
187	000977	浪潮信息	5,900	413,000.00	0.03
188	000415	渤海租赁	99,900	406,593.00	0.03
189	603556	海兴电力	18,300	402,600.00	0.03
190	002594	比亚迪	4,800	382,560.00	0.03
191	601233	桐昆股份	16,800	363,720.00	0.03
192	601100	恒立液压	3,300	354,948.00	0.03
193	002460	赣锋锂业	5,400	353,160.00	0.02
194	688072	拓荆科技	400	351,812.00	0.02
195	000831	中国稀土	6,300	349,587.00	0.02
196	601211	国泰海通	19,200	349,440.00	0.02
197	600958	东方证券	36,700	346,448.00	0.02

198	300033	同花顺	1,420	342,220.00	0.02
199	688521	芯原股份	900	334,026.00	0.02
200	605305	中际联合	7,800	326,976.00	0.02
201	600803	新奥股份	20,100	317,580.00	0.02
202	000703	恒逸石化	23,400	317,538.00	0.02
203	002001	新 和 成	10,700	304,094.00	0.02
204	601886	江河集团	37,400	300,322.00	0.02
205	600166	福田汽车	100,300	291,873.00	0.02
206	300568	星源材质	15,200	284,544.00	0.02
207	600886	国投电力	21,000	279,510.00	0.02
208	002064	华峰化学	28,700	272,363.00	0.02
209	601088	中国神华	6,900	269,376.00	0.02
210	688543	国科军工	6,800	268,260.00	0.02
211	601600	中国铝业	31,900	262,218.00	0.02
212	000423	东阿阿胶	5,700	258,552.00	0.02
213	002156	通富微电	3,400	257,958.00	0.02
214	600938	中国海油	9,500	257,925.00	0.02
215	000568	泸州老窖	3,300	255,816.00	0.02
216	002317	众生药业	10,200	250,614.00	0.02
217	000063	中兴通讯	6,300	227,997.00	0.02
218	002714	牧原股份	6,400	223,936.00	0.02
219	000951	中国重汽	11,300	220,463.00	0.02
220	002230	科大讯飞	5,100	208,284.00	0.01
221	603019	中科曙光	1,900	203,737.00	0.01
222	601689	拓普集团	3,500	197,470.00	0.01
223	300772	运达股份	15,700	193,110.00	0.01
224	002080	中材科技	2,100	189,000.00	0.01
225	688008	澜起科技	600	185,940.00	0.01
226	600066	宇通客车	6,900	184,989.00	0.01
227	002851	麦格米特	1,100	183,898.00	0.01
228	002422	科伦药业	4,700	181,044.00	0.01
229	603129	春风动力	700	179,060.00	0.01
230	000651	格力电器	4,700	176,250.00	0.01
231	301607	富特科技	3,360	175,560.00	0.01
232	600482	中国动力	5,300	173,840.00	0.01
233	002928	华夏航空	23,800	166,362.00	0.01
234	002541	鸿路钢构	9,500	164,540.00	0.01
235	603090	宏盛股份	3,200	163,392.00	0.01
236	600388	龙净环保	11,200	162,960.00	0.01
237	603393	新天然气	7,300	156,293.00	0.01
238	603588	高能环境	7,900	151,680.00	0.01
239	603171	税友股份	3,800	151,430.00	0.01
240	688617	惠泰医疗	800	145,248.00	0.01

241	603198	迎驾贡酒	4,900	145,040.00	0.01
242	688382	益方生物	7,800	140,400.00	0.01
243	601888	中国中免	2,600	139,646.00	0.01
244	688615	合合信息	1,220	137,982.00	0.01
245	600941	中国移动	1,600	137,808.00	0.01
246	603606	东方电缆	3,300	136,983.00	0.01
247	603345	安井食品	1,700	136,323.00	0.01
248	600547	山东黄金	5,900	136,231.00	0.01
249	600153	建发股份	16,500	130,845.00	0.01
250	600115	中国东航	33,200	126,492.00	0.01
251	002271	东方雨虹	10,500	124,635.00	0.01
252	002468	申通快递	8,500	123,760.00	0.01
253	300893	松原安全	6,800	110,160.00	0.01
254	688099	晶晨股份	1,000	102,900.00	0.01
255	600535	天士力	7,700	101,871.00	0.01
256	601965	中国汽研	8,500	101,660.00	0.01
257	603871	嘉友国际	9,900	101,079.00	0.01
258	301068	大地海洋	4,100	97,580.00	0.01
259	001914	招商积余	10,621	86,667.36	0.01
260	601155	新城控股	8,200	84,132.00	0.01
261	300685	艾德生物	4,900	82,516.00	0.01
262	300015	爱尔眼科	9,400	77,644.00	0.01
263	688114	华大智造	1,500	76,620.00	0.01
264	605377	华旺科技	7,900	73,470.00	0.01
265	600845	宝信软件	4,400	73,172.00	0.01
266	603799	华友钴业	1,500	72,390.00	0.01
267	688510	航亚科技	3,000	71,640.00	0.01
268	688271	联影医疗	700	70,861.00	0.00
269	000932	华菱钢铁	20,300	70,441.00	0.00
270	300760	迈瑞医疗	500	67,915.00	0.00
271	002244	滨江集团	8,900	67,640.00	0.00
272	689009	九号公司	1,700	64,855.00	0.00
273	002128	电投能源	2,800	64,736.00	0.00
274	605499	东鹏饮料	520	64,183.60	0.00
275	300347	泰格医药	1,300	62,400.00	0.00
276	300003	乐普医疗	5,200	61,620.00	0.00
277	688084	晶品特装	1,200	60,336.00	0.00
278	002078	太阳纸业	4,800	59,952.00	0.00
279	603939	益丰药房	3,300	59,334.00	0.00
280	001203	大中矿业	1,900	56,905.00	0.00
281	001979	招商蛇口	8,500	54,655.00	0.00
282	002318	久立特材	2,200	52,580.00	0.00
283	600010	宝钢股份	23,400	52,182.00	0.00

284	600048	保利发展	11,200	51,856.00	0.00
285	688696	极米科技	800	51,632.00	0.00
286	603737	三棵树	2,140	51,574.00	0.00
287	600415	小商品城	4,900	49,784.00	0.00
288	600258	首旅酒店	4,200	45,864.00	0.00
289	601003	柳钢股份	13,300	44,821.00	0.00
290	601567	三星电气	3,000	44,820.00	0.00
291	600157	永泰能源	26,900	43,309.00	0.00
292	301087	可孚医疗	800	38,120.00	0.00
293	600398	海澜之家	6,900	36,087.00	0.00
294	603605	珀莱雅	600	35,952.00	0.00
295	601898	中煤能源	2,800	34,104.00	0.00
296	600188	兖矿能源	1,500	26,655.00	0.00

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	601318	中国平安	7,348,994.00	1.62
2	688636	智明达	7,315,334.33	1.61
3	601601	中国太保	7,060,904.00	1.55
4	601899	紫金矿业	6,091,143.00	1.34
5	600519	贵州茅台	5,224,595.00	1.15
6	601211	国泰海通	5,120,693.00	1.13
7	300750	宁德时代	5,086,539.00	1.12
8	603059	倍加洁	4,974,292.00	1.09
9	601377	兴业证券	4,626,887.00	1.02
10	300132	青松股份	4,285,833.00	0.94
11	600958	东方证券	4,049,320.00	0.89
12	300358	楚天科技	4,016,295.00	0.88
13	605117	德业股份	3,916,621.00	0.86
14	001283	豪鹏科技	3,909,062.00	0.86
15	688023	安恒信息	3,879,833.95	0.85
16	300308	中际旭创	3,838,941.00	0.84
17	600710	苏美达	3,734,063.00	0.82
18	600458	时代新材	3,675,935.00	0.81
19	002558	巨人网络	3,612,237.00	0.79
20	002352	顺丰控股	3,595,375.00	0.79

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	688636	智明达	7,304,150.98	1.61
2	601318	中国平安	6,488,662.00	1.43

3	601601	中国太保	5,904,199.00	1.30
4	601963	重庆银行	4,211,481.00	0.93
5	603059	倍加洁	4,164,397.00	0.92
6	601211	国泰海通	4,163,932.38	0.92
7	300132	青松股份	4,102,608.00	0.90
8	601377	兴业证券	4,097,083.00	0.90
9	300358	楚天科技	4,051,579.00	0.89
10	600496	精工钢构	4,049,655.00	0.89
11	688023	安恒信息	3,985,263.58	0.88
12	000422	湖北宜化	3,951,106.00	0.87
13	601899	紫金矿业	3,940,112.00	0.87
14	002396	星网锐捷	3,871,009.00	0.85
15	001283	豪鹏科技	3,841,451.82	0.84
16	600458	时代新材	3,808,714.00	0.84
17	300033	同花顺	3,773,547.00	0.83
18	600710	苏美达	3,755,695.00	0.83
19	002558	巨人网络	3,456,983.00	0.76
20	605117	德业股份	3,405,524.00	0.75

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	684,448,952.34
卖出股票收入（成交）总额	562,523,777.36

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	150,317,609.37	10.59
2	央行票据	-	-
3	金融债券	525,344,886.01	37.02
	其中：政策性金融债	198,452,843.82	13.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	156,477,904.38	11.03
6	中期票据	404,637,299.46	28.51
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,236,777,699.22	87.15

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	250423	25 农发 23	1,100,000	112,064,473.97	7.90
2	102280113	22 佛公用 MTN001	900,000	92,251,356.16	6.50
3	102102186	21 青岛地铁 MTN003	800,000	81,436,054.79	5.74
4	012680169	26 广州产投 SCP002	700,000	70,579,139.73	4.97
5	242680010	26 宁波银行永续债 01	700,000	70,235,763.84	4.95

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 本报告期投资基金情况

7.11.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细
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，国家开发银行、中国农业银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、中国农业发展银行、兴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。

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	187,942.83
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,899,128.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,087,071.26

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

份额级别	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 (%)
嘉实同舟债券 A	3,587	73,341.54	96,543,722.50	36.70	166,532,387.84	63.30
嘉实同舟债券 C	2,305	447,900.52	16,545,920.73	1.60	1,015,864,785.53	98.40
合计	5,858	221,148.31	113,089,643.23	8.73	1,182,397,173.37	91.27

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管	嘉实同舟债券 A	924.87	0.00

理人所有从业人员持有本基金	嘉实同舟债券 C	1.00	0.00
	合计	925.87	0.00

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	份额级别	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	嘉实同舟债券 A	0
	嘉实同舟债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实同舟债券 A	0
	嘉实同舟债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实同舟债券 A	嘉实同舟债券 C
基金合同生效日（2023 年 7 月 24 日）基金份额总额	1,370,916,983.14	497,402,099.05
本报告期期初基金份额总额	96,846,041.72	327,586,757.31
本报告期基金总申购份额	264,293,581.25	2,883,657,053.25
减：本报告期基金总赎回份额	98,063,512.63	2,178,833,104.30
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	263,076,110.34	1,032,410,706.26

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
- 2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。
- (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

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，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。

其他	-
----	---

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
国泰海通证券股份有限公司	2	451,136,364.56	36.28	196,667.75	36.28	-
华泰证券股份有限公司	4	375,187,872.22	30.17	163,559.65	30.17	-
广发证券股份有限公司	2	297,865,878.60	23.95	129,848.11	23.95	-
中信证券股份有限公司	2	119,249,524.23	9.59	51,980.96	9.59	-
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用或者通过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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
国泰海通证券股份有限公司	2,311,094.42	17.15	-	-	-	-	30,170,379.87	23.79
华泰证券股份有限公司	2,481,587.23	18.42	192,900,000.00	100.00	-	-	33,226,421.50	26.20
广发证券股份有限公司	3,180,263.12	23.60	-	-	-	-	63,407,538.90	50.00
中信	500,649.72	3.72	-	-	-	-	-	-

证 券 股 份 有 限 公 司								
东 兴 证 券 股 份 有 限 公 司	5,000,000.00	37.11	-	-	-	-	-	-

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	关于嘉实同舟债券型证券投资基金 2026年4月3日至4月7日暂停申购、 赎回、转换及定期定额投资业务的公 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	2026年4月1日
2	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	2026年6月26日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分 基金调整业绩比较基准并修订基金合 同等法律文件的公告	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	2026年6月26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

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。

§ 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同舟债券型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实同舟债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实同舟债券型证券投资基金托管协议》；

- (4) 《嘉实同舟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) 报告期内嘉实同舟债券型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

2026 年 8 月 31 日