

嘉实稳宏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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	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	10
§ 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	13
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	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.11 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
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	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 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	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	52
10.8 其他重大事件	58
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§ 12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳宏债券型证券投资基金		
基金简称	嘉实稳宏债券		
基金主代码	003458		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2017 年 6 月 2 日		
基金管理人	嘉实基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份 额总额	1,737,931,961.32 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基 金简称	嘉实稳宏债券 A	嘉实稳宏债券 C	嘉实稳宏债券 D
下属分级基金的交 易代码	003458	003459	024213
报告期末下属分级 基金的份额总额	578,016,715.06 份	188,539,373.96 份	971,375,872.30 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	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，以获取较高的投资收益。具体策略包括：利率策略、信用债券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、中小企业私募债券投资策略。 其他投资策略包括：股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率*90%+沪深 300 指数收益率*10%
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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588
传真		(010)65215588	(010)66105798
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 55 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 55 号
邮政编码		100020	100140
法定代表人		经雷	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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)		
	嘉实稳宏债券 A	嘉实稳宏债券 C	嘉实稳宏债券 D
本期已实现收益	-14,495,227.54	-5,433,230.79	-14,894,655.73
本期利润	170,034,696.62	29,190,351.58	102,311,472.07
加权平均基金份额本期利润	0.2447	0.1206	0.1291
本期加权平	12.84%	6.52%	6.75%

均净值利润率			
本期基金份额净值增长率	17.51%	17.31%	17.51%
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	53,445,575.36	9,620,336.38	90,257,948.47
期末可供分配基金份额利润	0.0925	0.0510	0.0929
期末基金资产净值	1,191,327,116.03	376,468,069.81	2,002,367,105.48
期末基金份额净值	2.0611	1.9968	2.0614
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	106.11%	99.68%	43.96%

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

嘉实稳宏债券 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	16.11%	1.33%	1.62%	0.14%	14.49%	1.19%

过去六个月	17.51%	1.31%	1.37%	0.13%	16.14%	1.18%
过去一年	39.60%	1.16%	1.51%	0.11%	38.09%	1.05%
过去三年	36.32%	0.97%	7.18%	0.12%	29.14%	0.85%
过去五年	47.31%	0.90%	7.15%	0.12%	40.16%	0.78%
过去七年	103.89%	0.87%	12.52%	0.13%	91.37%	0.74%
自基金合同生效起 至今	106.11%	0.81%	18.80%	0.13%	87.31%	0.68%

嘉实稳宏债券 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	16.01%	1.33%	1.62%	0.14%	14.39%	1.19%
过去六个月	17.31%	1.31%	1.37%	0.13%	15.94%	1.18%
过去一年	39.12%	1.16%	1.51%	0.11%	37.61%	1.05%
过去三年	34.89%	0.97%	7.18%	0.12%	27.71%	0.85%
过去五年	44.75%	0.90%	7.15%	0.12%	37.60%	0.78%
过去七年	98.94%	0.87%	12.52%	0.13%	86.42%	0.74%
自基金合同生效起 至今	99.68%	0.81%	18.80%	0.13%	80.88%	0.68%

嘉实稳宏债券 D

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	16.10%	1.33%	1.62%	0.14%	14.48%	1.19%
过去六个月	17.51%	1.31%	1.37%	0.13%	16.14%	1.18%
过去一年	39.60%	1.16%	1.51%	0.11%	38.09%	1.05%
自基金合同生效起 至今	43.96%	1.10%	1.49%	0.11%	42.47%	0.99%

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：

$$\text{Return}(t) = 90\% \times (\text{中债总全价指数}(t) / \text{中债总全价指数}(t-1) - 1) + 10\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1)$$

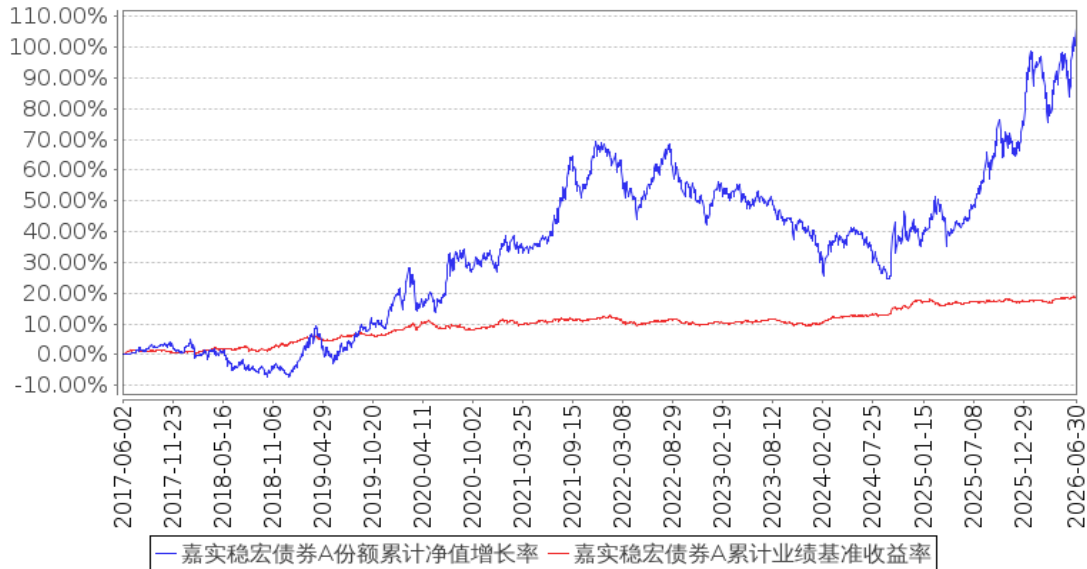
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

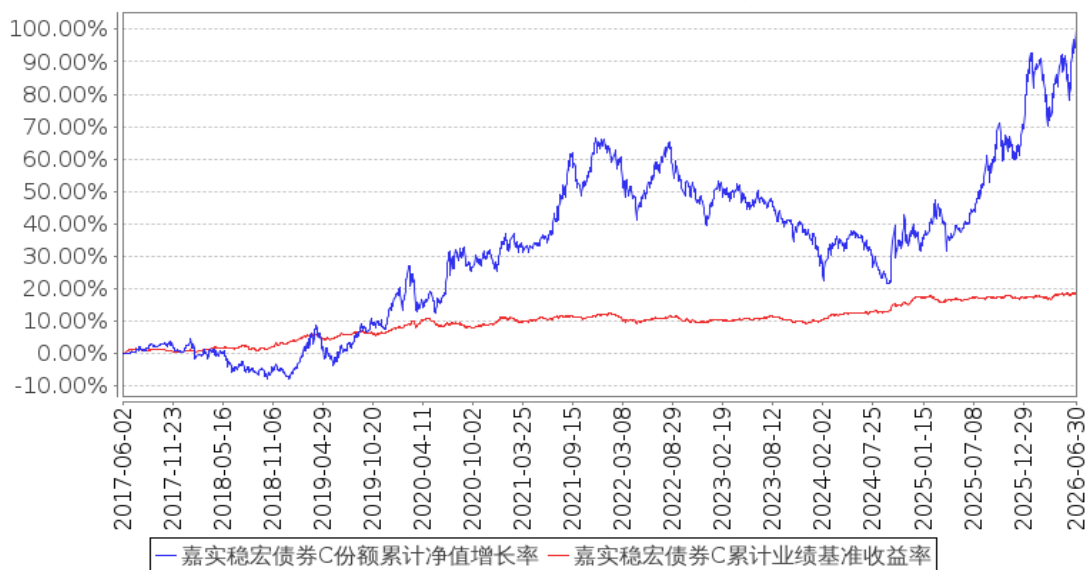
嘉实稳宏债券A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年06月02日至2026年06月30日)

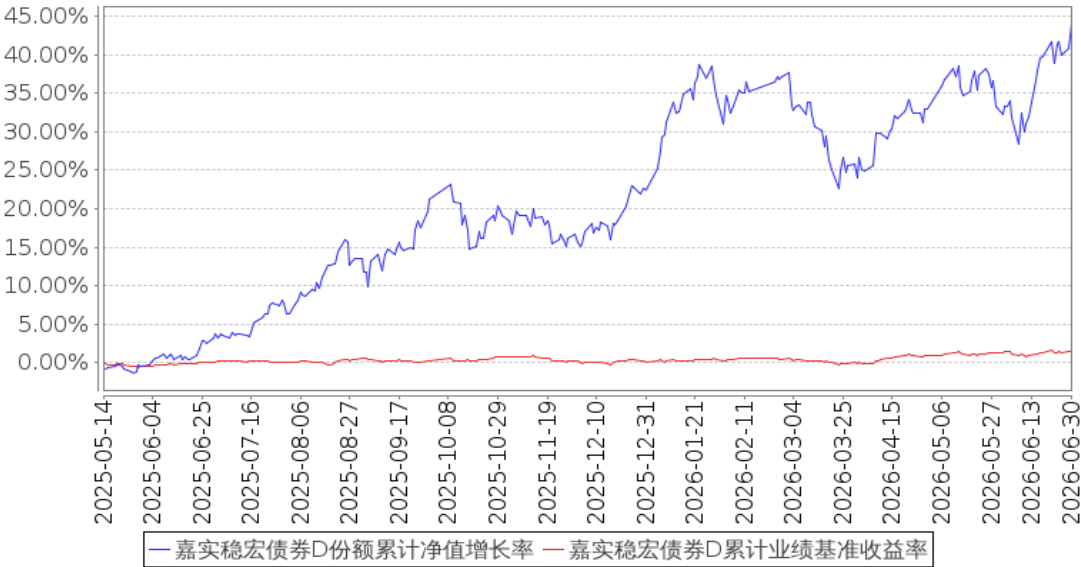


嘉实稳宏债券C份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年06月02日至2026年06月30日)



嘉实稳宏债券D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
(2025年05月14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		
赖礼辉	本基金、嘉实新起	2020 年 12 月 4 日	-	19 年	曾任长城证券有限责任公司金融研究所股票行业研究员、瑞银证券有限责任公司财

	点混合、嘉实新趋势混合、嘉实安益混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实润泽量化定期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实多盈债券、嘉实稳健添翼一年持有混合、嘉实稳健增利 6 个月持有混合基金经理				富管理部证券分析师，2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部，历任信用研究员、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。

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、《嘉实稳宏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

上半年全球金融市场在美伊战争冲突、通胀上行和 AI 产业叙事等多重因素的影响下，出现了大幅波动和极致分化，油价一度大涨导致海外无风险利率上行，传统产业受冲击较大，而 AI 则由于应用加速落地、算力硬件需求增长带动产业链众多环节短期供给不足、价格大涨，产业景气度上行，投资机会凸显。本组合上半年根据宏观经济变化和产业趋势发展，适时调整资产配置结构，取得了相对较好的收益。

回顾整个上半年，国内资本市场将短期确定性和长期叙事逻辑演绎得淋漓尽致，其中有错杀也有过度定价等不合理地方，作为资产管理人需要根据市场状况适当调整投资策略，也要时刻保持清醒。

在短短的半年时间里，贵金属、原油等大宗商品先后出现了历史级别的暴涨暴跌，对整个金融市场定价影响显著。一季度初贵金属快速上涨的趋势，在美联储新任主席人选公布之后戛然而止，黄金从避险资产进入风险资产的定价体系，之后带崩了国内贵金属和基本金属板块股票。国内金属板块的估值波动比海外大了很多，虽然行业的长期逻辑不一定完全改变，但基于组合净值回撤控制，一季度大幅降低了金属股票仓位。

二季度影响金融市场定价的主要因素是油价和通胀，前期油价高位，欧洲和日本央行加息，美联储加息预期上升，美债利率上行，对利率敏感的传统经济受影响更大，相关行业股票表现弱。国债债市则明显强于海外，10 年国债利率先小幅上行后明显回落，主要由于国内流动性宽松，以及经济基本面走弱。整个上半年债券市场收益率曲线牛陡，中短端收益率一度创新低，仅超长端利率相对克制。本组合上半年大幅增加了信用债的配置，但久期策略较为保守，且未参与长端利率债交易，低估了市场对短期经济走弱的极致定价及与全球债市的背离程度。

权益资产二季度行业分化的主要原因是传统行业基本面走弱，即使如化工等部分行业价格上涨，但下游需求不支撑；以及与之形成鲜明对比的科技相关产业链产品价格普涨、景气度上行，且 AI 大模型得到了应用场景数据支持。但到了 6 月份市场演绎过于极致，部分透支了中长期市场空间，而对部分业绩不错的传统产业明显是错杀。本组合二季度中前期顺应市场趋势，增加了科

技板块仓位，主要包括电子半导体、光纤光缆、小金属、电子化工品等，减持了金融、传统化工、电力设备等板块，在二季度后期由于担心市场过于乐观，整体降低了权益仓位。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实稳宏债券 A 基金份额净值为 2.0611 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.51%；截至本报告期末嘉实稳宏债券 C 基金份额净值为 1.9968 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.31%；截至本报告期末嘉实稳宏债券 D 基金份额净值为 2.0614 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.51%；业绩比较基准收益率为 1.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

影响下半年金融市场走势的关键因素与上半年类似：原油价格以及通胀走势、国内内需情况、AI 科技中期产业趋势、金融条件。

我们预计布油以 80 美元为中枢宽幅震荡，原油经历上半年的冲击后，供求都有收缩，全球通胀压力不会强于上半年。当前美伊战争不确定性仍很大，短期若继续升级，原油价格突破前高，但双方都无法承受如俄乌一样的战争长期化，下半年真正缓和的可能很大。

下半年国内经济基本面下行趋势会有缓和，财政政策会适当加快落地，海外需求仍能支撑国内出口，内需若进一步回落，四季度可能会有增量政策出台。科技产业趋势短期还不会改变，从跟踪到的 AI 下游应用和收入数据可以得到验证，但也不支撑趋势进一步加速。

海外通胀高企，欧洲和日本等央行已确认在加息通道，美联储年内加息的概率在上升，目前金融市场也对此有所定价。但国内金融环境不会有变化，预计仍将维持宽松，主要应对国内偏弱的内需。

基于此，预计国内债券市场很难出现上半年类似的趋势行情，宽幅震荡为主。由于中短端债券已经处于历史低位，且已部分定价了央行降息预期，长债收益率也接近 25 年低点，下半年债券收益率可能仍较平坦，曲线下行或进一步平坦化需要看到经济加速下行，可能性不大。因此，本组合下半年债券投资将适当杠杆，控制久期，对长端利率保持谨慎。

权益方面，预计下半年市场风格分化会再平衡，AI 科技从中期产业趋势角度来看还不至于崩盘，但预计会去伪存真，有真正竞争优势和更长期需求量增的公司，也需要估值与业绩增长更为匹配，才值得中长期投资。传统产业中，供给出清得早，需求有来自海外的支撑或国内需求下行可能接近拐点的，且前期估值调整到位的板块，下半年可以关注机会了。本组合下半年权益投资围绕上述两方面，重点在科技、高端制造、周期等板块中合理分配仓位，择优投资。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：嘉实稳宏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	2,230,576.72	13,607,481.14
结算备付金		21,751,806.89	2,955,502.77
存出保证金		583,936.02	81,516.56
交易性金融资产	6.4.7.2	4,390,791,472.08	1,083,248,575.72
其中：股票投资		1,401,341,000.29	206,902,170.64
基金投资		-	-
债券投资		2,989,450,471.79	876,346,405.08
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		9,683,010.14	-
应收股利		-	-
应收申购款		17,190,145.04	403,703.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		4,442,230,946.89	1,100,296,779.99
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		795,080,997.81	4,999,340.70
应付清算款		11,530,721.63	19,273,310.59
应付赎回款		61,854,090.78	1,221,684.58
应付管理人报酬		2,192,182.67	624,088.71
应付托管费		411,034.27	117,016.65
应付销售服务费		106,523.37	38,965.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		57,003.02	10,295.01
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	836,102.02	235,665.99
负债合计		872,068,655.57	26,520,368.10
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,737,931,961.32	615,433,591.82
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,832,230,330.00	458,342,820.07
净资产合计		3,570,162,291.32	1,073,776,411.89
负债和净资产总计		4,442,230,946.89	1,100,296,779.99

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实稳宏债券 A 基金份额净值 2.0611 元，基金份额总额 578,016,715.06 份，嘉实稳宏债券 C 基金份额净值 1.9968 元，基金份额总额 188,539,373.96 份，嘉实稳宏债券 D 基金份额净值 2.0614 元，基金份额总额 971,375,872.30 份，基金份额总额合计为 1,737,931,961.32 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实稳宏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		322,430,269.29	41,247,943.53
1. 利息收入		223,908.27	23,495.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	223,908.27	19,682.33
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		-	3,813.05
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,716,254.49	18,127,080.59
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-65,106,115.91	-2,012,636.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	44,407,036.11	18,930,837.20
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	5,982,825.31	1,208,879.61
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	336, 359, 634. 33	23, 036, 509. 16
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	562, 981. 18	60, 858. 40
减：二、营业总支出		20, 893, 749. 02	3, 821, 325. 75
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	13, 053, 874. 09	2, 625, 189. 59
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	2, 447, 601. 45	492, 223. 03
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	780, 706. 41	185, 950. 75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4, 463, 481. 54	401, 707. 68
其中：卖出回购金融资产支出		4, 463, 481. 54	401, 707. 68
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		24, 650. 51	3, 632. 95
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	123, 435. 02	112, 621. 75
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		301, 536, 520. 27	37, 426, 617. 78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		301, 536, 520. 27	37, 426, 617. 78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		301, 536, 520. 27	37, 426, 617. 78

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实稳宏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	615, 433, 591. 82	-	458, 342, 820. 07	1, 073, 776, 411. 89
二、本期期初净资产	615, 433, 591. 82	-	458, 342, 820. 07	1, 073, 776, 411. 89
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1, 122, 498, 369. 50	-	1, 373, 887, 509. 93	2, 496, 385, 879. 43
（一）、综合收益总额	-	-	301, 536, 520. 27	301, 536, 520. 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)	1,122,498,369.50	-	1,072,350,989.66	2,194,849,359.16
其中：1. 基金申购款	3,221,249,878.34	-	2,961,350,287.90	6,182,600,166.24
2. 基金赎回款	-2,098,751,508.84	-	-1,888,999,298.24	-3,987,750,807.08
(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	1,737,931,961.32	-	1,832,230,330.00	3,570,162,291.32
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	563,262,572.05	-	213,765,895.66	777,028,467.71
二、本期期初净资产	563,262,572.05	-	213,765,895.66	777,028,467.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-99,825,083.20	-	4,194,677.46	-95,630,405.74
(一)、综合收益总额	-	-	37,426,617.78	37,426,617.78
(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)	-99,825,083.20	-	-33,231,940.32	-133,057,023.52
其中：1. 基金申购款	125,429,543.49	-	55,642,289.66	181,071,833.15
2. 基金赎回款	-225,254,626.69	-	-88,874,229.98	-314,128,856.67
(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	463,437,488.85	-	217,960,573.12	681,398,061.97

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

梁凯

李袁

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

嘉实稳宏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[2016]1991 号《关于准予嘉实稳宏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《嘉实稳宏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，《嘉实稳宏债券型证券投资基金基金合同》于 2017 年 6 月 2 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 329,306,843.04 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《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[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[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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 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 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。2027 年 12 月 31 日前，资管产品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，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(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。对在该日期之前已发行的国债、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，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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	2,230,576.72
等于：本金	2,229,880.32
加：应计利息	696.40
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	2,230,576.72

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		1,144,655,076.62	-	1,401,341,000.29	256,685,923.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,212,285,033.13	5,125,093.46	1,437,588,176.49	220,178,049.90
	银行间市场	1,530,694,700.60	22,942,495.30	1,551,862,295.30	-1,774,900.60
	合计	2,742,979,733.73	28,067,588.76	2,989,450,471.79	218,403,149.30
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,887,634,810.35	28,067,588.76	4,390,791,472.08	475,089,072.97

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	34,886.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	722,863.78
其中：交易所市场	690,263.48
银行间市场	32,600.30
应付利息	-
预提费用	78,351.28
合计	836,102.02

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实稳宏债券 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	470,947,581.58	470,947,581.58
本期申购	718,621,415.23	718,621,415.23
本期赎回（以“-”号填列）	-611,552,281.75	-611,552,281.75
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	578,016,715.06	578,016,715.06
-----	----------------	----------------

嘉实稳宏债券 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	110,257,606.88	110,257,606.88
本期申购	399,611,647.88	399,611,647.88
本期赎回（以“-”号填列）	-321,329,880.80	-321,329,880.80
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	188,539,373.96	188,539,373.96

嘉实稳宏债券 D

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	34,228,403.36	34,228,403.36
本期申购	2,103,016,815.23	2,103,016,815.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,165,869,346.29	-1,165,869,346.29
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	971,375,872.30	971,375,872.30

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

嘉实稳宏债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	51,863,500.30	303,233,979.42	355,097,479.72
本期期初	51,863,500.30	303,233,979.42	355,097,479.72
本期利润	-14,495,227.54	184,529,924.16	170,034,696.62
本期基金份额交易产生的变动数	16,077,302.60	72,100,922.03	88,178,224.63
其中：基金申购款	75,427,285.34	582,009,570.77	657,436,856.11
基金赎回款	-59,349,982.74	-509,908,648.74	-569,258,631.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	53,445,575.36	559,864,825.61	613,310,400.97

嘉实稳宏债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,867,042.44	69,559,919.61	77,426,962.05
本期期初	7,867,042.44	69,559,919.61	77,426,962.05
本期利润	-5,433,230.79	34,623,582.37	29,190,351.58
本期基金份额交易产生的变动数	7,186,524.73	74,124,857.49	81,311,382.22
其中：基金申购款	26,659,242.45	321,197,610.47	347,856,852.92
基金赎回款	-19,472,717.72	-247,072,752.98	-266,545,470.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,620,336.38	178,308,359.47	187,928,695.85

嘉实稳宏债券 D

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,777,811.22	22,040,567.08	25,818,378.30
本期期初	3,777,811.22	22,040,567.08	25,818,378.30
本期利润	-14,894,655.73	117,206,127.80	102,311,472.07
本期基金份额交易产生的变动数	101,374,792.98	801,486,589.83	902,861,382.81
其中：基金申购款	218,057,359.19	1,737,999,219.68	1,956,056,578.87
基金赎回款	-116,682,566.21	-936,512,629.85	-1,053,195,196.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	90,257,948.47	940,733,284.71	1,030,991,233.18

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	42,125.68
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	27,634.27
其他	154,148.32
合计	223,908.27

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	-65,106,115.91
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	-65,106,115.91
----	----------------

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	997,553,740.59
减：卖出股票成本总额	1,060,705,140.35
减：交易费用	1,954,716.15
买卖股票差价收入	-65,106,115.91

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	27,159,156.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,247,879.86
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	44,407,036.11

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 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	1,618,103,529.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,589,932,507.72
减：应计利息总额	10,801,569.46
减：交易费用	121,572.81
买卖债券差价收入	17,247,879.86

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

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	5,982,825.31
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	5,982,825.31

6.4.7.20 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	336,359,634.33
股票投资	209,177,004.51
债券投资	127,182,629.82
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	336,359,634.33

6.4.7.21 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	516,043.00
基金转出费收入	46,938.18
合计	562,981.18

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
银行划款手续费	26,483.74
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	123,435.02

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
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 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	13,053,874.09	2,625,189.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,642,931.92	462,993.84
应支付基金管理人的净管理费	11,410,942.17	2,162,195.75

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 0.80%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×0.80%/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	2,447,601.45	492,223.03

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%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×0.15%/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			
	嘉实稳宏债券 A	嘉实稳宏债券 C	嘉实稳宏债券 D	合计
嘉实基金管理有限公司	-	387,831.82	-	387,831.82
中国工商银行	-	43,500.89	-	43,500.89
嘉实财富	-	273.96	-	273.96
合计	-	431,606.67	-	431,606.67
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			
	嘉实稳宏债券 A	嘉实稳宏债券 C	嘉实稳宏债券 D	合计
嘉实基金管理有限公司	-	80,070.99	-	80,070.99
中国工商银行	-	18,154.15	-	18,154.15
嘉实财富	-	117.93	-	117.93
合计	-	98,343.07	-	98,343.07

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%，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×0.35%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额和 D 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

无。

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
中国工商银行股份有限公司_活期	2,230,576.72	42,125.68	24,191,945.01	3,894.66

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(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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值总	备注

代码	券名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	额	
001248	华润新能源	2026年6月25日	1个月内(含)	新发未上市	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别: 债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
111025	圣泉转债	2026年6月26日	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	6,880	688,000.00	688,009.05	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

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 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 576,080,997.81 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
09240202	24 国开清发 02	2026 年 7 月 1 日	100.97	450,000	45,435,760.27
09250402	25 农发清发 02	2026 年 7 月 1 日	100.63	300,000	30,188,515.07
09250412	25 农发清发 12	2026 年 7 月 1 日	100.55	16,000	1,608,850.41
092280083	22 建行永续债 01	2026 年 7 月 2 日	104.59	100,000	10,459,216.44
092280086	22 农行永续债 02	2026 年 7 月 2 日	104.52	600,000	62,710,461.37
092280098	22 杭州银行二级资	2026 年 7 月 2 日	104.38	658,000	68,681,138.63

	本债 01				
092280105	22 南京银行永续债 01	2026 年 7 月 2 日	104.52	258,000	26,965,947.95
232580006	25 民生银行二级资本债 01	2026 年 7 月 2 日	102.30	43,000	4,398,689.12
242300001	23 宁波银行永续债 01	2026 年 7 月 2 日	106.92	211,000	22,560,530.44
242580026	25 浦发银行永续债 02	2026 年 7 月 2 日	102.46	100,000	10,245,504.11
312510012	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	2026 年 7 月 2 日	102.30	136,000	13,912,354.37
2220017	22 西安银行二级 01	2026 年 7 月 3 日	102.64	224,000	22,992,364.01
092200008	22 农行二级资本债 02A	2026 年 7 月 6 日	104.16	300,000	31,246,844.38
092280069	22 华夏银行二级资本债 01	2026 年 7 月 6 日	104.43	100,000	10,442,630.14
092280131	22 建行二级资本债 02A	2026 年 7 月 6 日	103.89	100,000	10,389,178.08
092280139	22 交行二级资本债 02A	2026 年 7 月 6 日	103.91	300,000	31,174,250.96
2228001	22 邮储银行永续债 01	2026 年 7 月 6 日	102.62	1,053,000	108,062,760.43
232380076	23 建行二级资本债 03A	2026 年 7 月 6 日	105.99	200,000	21,198,372.60
242380019	23 邮储永续债 01	2026 年 7 月 6 日	106.43	300,000	31,927,933.15
242380033	23 招行永续债 01	2026 年 7 月 6 日	106.09	200,000	21,218,896.44
242580002	25 邮储永续债 01BC	2026 年 7 月 6 日	101.56	80,000	8,124,561.10
312510009	25 农行	2026 年 7 月 6 日	102.25	200,000	20,449,616.44

	TLAC 非资 本债 02A (BC)	日			
312510012	25 中行 TLAC 非资 本债 02 (BC)	2026 年 7 月 6 日	102. 30	220, 000	22, 505, 279. 12
合计				6, 149, 000	636, 899, 655. 03

6. 4. 12. 3. 2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 219,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	21,012,970.08
合计	-	21,012,970.08

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	1,301,848,506.91	148,310,226.57
AAA 以下	1,226,027,630.56	551,363,673.40
未评级	461,574,334.32	155,659,535.03
合计	2,989,450,471.79	855,333,435.00

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期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	2,230,576.72	-	-	-	2,230,576.72
结算备付金	21,751,806.89	-	-	-	21,751,806.89
存出保证金	583,936.02	-	-	-	583,936.02
交易性金融资产	533,706,168.07	1,579,620,256.41	876,124,047.31	1,401,341,000.29	4,390,791,472.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	9,683,010.14	9,683,010.14
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	17,190,145.04	17,190,145.04
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	558,272,487.70	1,579,620,256.41	876,124,047.31	1,428,214,155.47	4,442,230,946.89
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	795,080,997.81	-	-	-	795,080,997.81
应付清算款	-	-	-	11,530,721.63	11,530,721.63
应付赎回款	-	-	-	61,854,090.78	61,854,090.78
应付管理人报酬	-	-	-	2,192,182.67	2,192,182.67
应付托管费	-	-	-	411,034.27	411,034.27
应付销售服务费	-	-	-	106,523.37	106,523.37
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	57,003.02	57,003.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	836,102.02	836,102.02

负债总计	795,080,997.81	-	-	76,987,657.76	872,068,655.57
利率敏感度缺口	-236,808,510.11	1,579,620,256.41	876,124,047.31	1,351,226,497.71	3,570,162,291.32
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	13,607,481.14	-	-	-	13,607,481.14
结算备付金	2,955,502.77	-	-	-	2,955,502.77
存出保证金	81,516.56	-	-	-	81,516.56
交易性金融资产	143,815,878.91	622,392,975.89	110,137,550.28	206,902,170.64	1,083,248,575.72
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	-	-	-	403,703.80	403,703.80
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	160,460,379.38	622,392,975.89	110,137,550.28	207,305,874.44	1,100,296,779.99
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	4,999,340.70	-	-	-	4,999,340.70
应付清算款	-	-	-	19,273,310.59	19,273,310.59
应付赎回款	-	-	-	1,221,684.58	1,221,684.58
应付管理人报酬	-	-	-	624,088.71	624,088.71
应付托管费	-	-	-	117,016.65	117,016.65
应付销售服务费	-	-	-	38,965.87	38,965.87
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	10,295.01	10,295.01
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	235,665.99	235,665.99
负债总计	4,999,340.70	-	-	21,521,027.40	26,520,368.10
利率敏感度缺口	155,461,038.68	622,392,975.89	110,137,550.28	185,784,847.04	1,073,776,411.89

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	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）

	动	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	20,280,542.15	7,662,670.72
	市场利率上升 25 个基点	-19,962,471.50	-7,514,293.00

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	1,401,341,000.29	39.25	206,902,170.64	19.27
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	1,401,341,000.29	39.25	206,902,170.64	19.27

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%	1,338,829,386.60	238,391,400.01
	业绩比较基准下降 5%	-1,338,829,386.60	-238,391,400.01

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	2,514,373,379.23	821,701,399.23
第二层次	1,876,418,092.85	261,547,176.49
第三层次	-	-
合计	4,390,791,472.08	1,083,248,575.72

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，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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	1,401,341,000.29	31.55
	其中：股票	1,401,341,000.29	31.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,989,450,471.79	67.30
	其中：债券	2,989,450,471.79	67.30
	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	23,982,383.61	0.54
8	其他各项资产	27,457,091.20	0.62
9	合计	4,442,230,946.89	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	-	-
B	采矿业	166,647,487.32	4.67
C	制造业	1,080,696,119.92	30.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,055.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	64,251,076.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,612,307.64	1.75
J	金融业	1,822,450.66	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,528,227.75	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	2,123,280.00	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	15,654,996.00	0.44
	合计	1,401,341,000.29	39.25

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	603986	兆易创新	127,400	103,831,000.00	2.91
2	002126	银轮股份	1,393,500	69,396,300.00	1.94
3	688008	澜起科技	216,702	67,155,949.80	1.88

4	600498	烽火通信	898,268	66,112,524.80	1.85
5	688012	中微公司	126,517	59,273,214.50	1.66
6	688368	晶丰明源	272,552	59,012,959.04	1.65
7	600141	兴发集团	1,003,158	47,118,331.26	1.32
8	002048	宁波华翔	2,046,600	47,071,800.00	1.32
9	600549	厦门钨业	502,100	42,778,920.00	1.20
10	688409	富创精密	135,076	41,367,025.00	1.16
11	600259	中稀有色	380,800	38,693,088.00	1.08
12	688361	中科飞测	87,346	37,558,780.00	1.05
13	601899	紫金矿业	1,480,188	37,211,926.32	1.04
14	002353	杰瑞股份	240,000	36,600,000.00	1.03
15	000338	潍柴动力	1,277,600	34,814,600.00	0.98
16	688041	海光信息	89,783	33,246,644.90	0.93
17	688785	恒运昌	62,859	30,425,641.77	0.85
18	300037	新宙邦	323,940	30,077,829.00	0.84
19	000831	中国稀土	501,700	27,839,333.00	0.78
20	002545	东方铁塔	1,709,300	27,724,846.00	0.78
21	601872	招商轮船	1,559,500	27,400,415.00	0.77
22	688766	普冉股份	34,257	26,261,416.20	0.74
23	600489	中金黄金	1,279,935	23,102,826.75	0.65
24	002484	江海股份	205,800	21,609,000.00	0.61
25	601975	招商南油	5,635,100	21,018,923.00	0.59
26	600309	万华化学	303,600	20,769,276.00	0.58
27	300751	迈为股份	68,900	19,461,494.00	0.55
28	603979	金诚信	300,775	17,754,748.25	0.50
29	002049	紫光国微	198,700	17,634,625.00	0.49
30	688548	广钢气体	324,807	16,922,444.70	0.47
31	002475	立讯精密	227,300	16,001,920.00	0.45
32	600026	中远海能	881,300	15,810,522.00	0.44
33	600673	东阳光	466,200	15,654,996.00	0.44
34	300001	特锐德	400,000	15,132,000.00	0.42
35	605589	圣泉集团	232,700	14,792,739.00	0.41
36	600362	江西铜业	331,600	14,358,280.00	0.40
37	600188	兖矿能源	717,100	12,742,867.00	0.36
38	300969	恒帅股份	123,861	11,613,207.36	0.33
39	002371	北方华创	12,250	10,835,860.00	0.30
40	000975	山金国际	597,900	10,164,300.00	0.28
41	000506	招金黄金	834,600	9,781,512.00	0.27
42	300567	精测电子	29,684	9,427,638.40	0.26
43	601100	恒立液压	75,245	8,093,352.20	0.23
44	688002	睿创微纳	50,000	7,734,500.00	0.22
45	603259	药明康德	59,300	7,383,443.00	0.21
46	603993	洛阳钼业	401,900	7,053,345.00	0.20

47	688127	蓝特光学	71,408	6,969,420.80	0.20
48	600547	山东黄金	247,800	5,721,702.00	0.16
49	300308	中际旭创	4,000	5,080,000.00	0.14
50	600486	扬农化工	100,000	5,070,000.00	0.14
51	600301	华锡有色	72,100	4,421,172.00	0.12
52	300285	国瓷材料	42,300	4,364,514.00	0.12
53	300454	深信服	37,203	3,578,928.60	0.10
54	002920	德赛西威	43,800	3,569,700.00	0.10
55	002493	荣盛石化	329,800	3,545,350.00	0.10
56	300433	蓝思科技	61,700	3,310,822.00	0.09
57	002738	中矿资源	47,000	2,772,530.00	0.08
58	605020	永和股份	53,252	2,168,421.44	0.06
59	300258	精锻科技	193,521	2,134,536.63	0.06
60	601231	环旭电子	53,813	1,743,541.20	0.05
61	601137	博威合金	72,410	1,616,915.30	0.05
62	603225	新凤鸣	79,278	1,557,812.70	0.04
63	603200	上海洗霸	30,000	1,300,800.00	0.04
64	603596	伯特利	47,552	1,181,191.68	0.03
65	601166	兴业银行	69,100	1,144,296.00	0.03
66	000888	峨眉山 A	92,000	822,480.00	0.02
67	600346	恒力石化	30,700	543,697.00	0.02
68	601211	国泰海通	27,900	507,780.00	0.01
69	002997	瑞鹄模具	13,365	368,339.40	0.01
70	688472	阿特斯	29,113	315,002.66	0.01
71	605133	嵘泰股份	6,600	259,842.00	0.01
72	603606	东方电缆	5,660	234,946.60	0.01
73	002179	中航光电	4,650	214,830.00	0.01
74	300487	蓝晓科技	2,700	158,895.00	0.00
75	688179	阿拉丁	5,225	144,784.75	0.00
76	601601	中国太保	4,800	136,896.00	0.00
77	603369	今世缘	4,400	104,324.00	0.00
78	600435	北方导航	7,100	79,520.00	0.00
79	600760	中航沈飞	1,560	64,116.00	0.00
80	002345	潮宏基	5,500	50,435.00	0.00
81	600389	江山股份	2,561	49,990.72	0.00
82	000988	华工科技	200	36,922.00	0.00
83	600276	恒瑞医药	580	30,183.20	0.00
84	601009	南京银行	2,194	21,698.66	0.00
85	601919	中远海控	1,600	21,216.00	0.00
86	600761	安徽合力	1,261	20,629.96	0.00
87	002230	科大讯飞	500	20,420.00	0.00
88	300014	亿纬锂能	299	19,443.97	0.00
89	600862	中航高科	700	12,621.00	0.00

90	601878	浙商证券	1,240	11,780.00	0.00
91	600737	中粮糖业	452	5,573.16	0.00
92	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
93	603799	华友钴业	21	1,013.46	0.00
94	603179	新泉股份	11	546.15	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	002048	宁波华翔	68,944,879.00	6.42
2	002126	银轮股份	63,917,211.00	5.95
3	601899	紫金矿业	59,644,660.52	5.55
4	600498	烽火通信	59,077,732.56	5.50
5	600141	兴发集团	55,057,045.30	5.13
6	600346	恒力石化	53,399,813.16	4.97
7	300680	隆盛科技	52,723,626.00	4.91
8	600276	恒瑞医药	50,230,049.80	4.68
9	600489	中金黄金	49,978,662.51	4.65
10	002545	东方铁塔	48,964,145.85	4.56
11	002493	荣盛石化	45,981,936.00	4.28
12	600549	厦门钨业	45,077,273.39	4.20
13	601615	明阳智能	43,889,480.00	4.09
14	601872	招商轮船	42,910,607.00	4.00
15	600259	中稀有色	42,631,845.92	3.97
16	600879	航天电子	42,495,583.00	3.96
17	601318	中国平安	42,395,932.00	3.95
18	688368	晶丰明源	42,232,787.08	3.93
19	603986	兆易创新	40,388,242.25	3.76
20	603979	金诚信	40,377,179.25	3.76
21	688008	澜起科技	37,719,167.07	3.51
22	000831	中国稀土	36,579,574.00	3.41
23	601288	农业银行	35,954,166.00	3.35
24	000338	潍柴动力	35,542,500.04	3.31
25	300277	汽轮科技	34,748,784.26	3.24
26	600026	中远海能	33,221,570.00	3.09
27	688041	海光信息	32,947,943.61	3.07
28	002353	杰瑞股份	32,702,053.79	3.05
29	002049	紫光国微	32,461,860.99	3.02
30	000506	招金黄金	31,043,380.00	2.89
31	002128	电投能源	30,565,216.38	2.85
32	600389	江山股份	30,235,445.71	2.82
33	603606	东方电缆	29,269,672.88	2.73
34	688778	厦钨新能	28,756,790.58	2.68

35	600309	万华化学	25,209,883.00	2.35
36	601975	招商南油	25,096,184.00	2.34
37	603225	新凤鸣	23,025,648.32	2.14
38	300037	新宙邦	22,947,299.00	2.14
39	600188	兖矿能源	22,697,121.00	2.11

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	600346	恒力石化	45,377,082.00	4.23
2	600276	恒瑞医药	41,898,681.20	3.90
3	601318	中国平安	38,647,804.00	3.60
4	300680	隆盛科技	36,951,710.00	3.44
5	002493	荣盛石化	35,232,779.49	3.28
6	601288	农业银行	35,071,887.00	3.27
7	300277	汽轮科技	33,230,390.97	3.09
8	002128	电投能源	33,063,282.71	3.08
9	600879	航天电子	33,035,365.12	3.08
10	601615	明阳智能	32,409,647.00	3.02
11	603986	兆易创新	31,108,023.00	2.90
12	600389	江山股份	26,142,836.00	2.43
13	688778	厦钨新能	26,104,043.43	2.43
14	603606	东方电缆	23,468,434.60	2.19
15	600498	烽火通信	22,607,982.12	2.11
16	603979	金诚信	21,893,280.00	2.04
17	603225	新凤鸣	20,983,016.00	1.95
18	600711	盛屯矿业	20,752,979.42	1.93
19	600141	兴发集团	19,889,975.00	1.85
20	601166	兴业银行	17,667,143.00	1.65

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	2,045,966,965.49
卖出股票收入（成交）总额	997,553,740.59

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	22,106,930.64	0.62
2	央行票据	—	—
3	金融债券	1,598,925,212.29	44.79
	其中：政策性金融债	327,268,698.63	9.17

4	企业债券	224,657,248.21	6.29
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,260,140.27	0.29
7	可转债（可交换债）	1,114,862,451.85	31.23
8	同业存单	-	-
9	其他	18,638,488.53	0.52
10	合计	2,989,450,471.79	83.73

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	2228001	22 邮储银行永续债 01	1,300,000	133,410,815.34	3.74
2	123176	精测转 2	242,410	130,241,513.49	3.65
3	092202005	22 国开行二级资本债 01A	1,200,000	124,387,397.26	3.48
4	092280098	22 杭州银行二级资本债 01	1,000,000	104,378,630.14	2.92
5	232280012	22 广州银行二级资本债 01	800,000	85,235,835.62	2.39

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 投资组合报告附注

7.11.1 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、国家开发银行、宁波银行股份有限公司、南京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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	583,936.02
2	应收清算款	9,683,010.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,190,145.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,457,091.20

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123176	精测转2	130,241,513.49	3.65
2	123251	华医转债	80,959,212.33	2.27
3	127096	泰坦转债	65,448,517.81	1.83
4	127088	赫达转债	58,578,526.77	1.64
5	123247	万凯转债	54,040,624.39	1.51
6	118053	正帆转债	50,099,072.60	1.40
7	123241	欧通转债	50,079,894.79	1.40
8	123213	天源转债	43,204,115.07	1.21
9	113052	兴业转债	39,129,798.91	1.10
10	118050	航宇转债	38,296,511.43	1.07
11	118058	微导转债	38,189,495.34	1.07
12	123252	银邦转债	31,119,329.06	0.87
13	111000	起帆转债	30,385,775.34	0.85
14	118061	茂莱转债	26,384,731.51	0.74
15	123178	花园转债	23,200,439.93	0.65
16	113042	上银转债	23,105,287.67	0.65
17	123187	超达转债	21,149,931.51	0.59
18	123158	宙邦转债	20,984,735.55	0.59
19	123253	永贵转债	20,358,122.08	0.57
20	113677	华懋转债	15,521,424.66	0.43
21	123091	长海转债	15,050,201.37	0.42
22	123257	安克转债	14,690,315.07	0.41
23	123131	奥飞转债	13,185,034.25	0.37

24	118042	奥维转债	13,091,986.30	0.37
25	118022	锂科转债	11,750,465.75	0.33
26	113667	春 23 转债	9,690,254.79	0.27
27	118037	上声转债	8,886,432.88	0.25
28	113678	中贝转债	7,498,534.25	0.21
29	118034	晶能转债	6,871,602.74	0.19
30	118052	浩瀚转债	6,819,321.92	0.19
31	118035	国力转债	6,160,098.63	0.17
32	118051	皓元转债	5,851,969.86	0.16
33	118013	道通转债	5,787,844.52	0.16
34	127083	山路转债	5,748,394.03	0.16
35	110090	爱迪转债	5,360,026.30	0.15
36	113659	莱克转债	3,809,243.84	0.11
37	113056	重银转债	3,737,038.36	0.10
38	123225	翔丰转债	3,049,972.60	0.09
39	123076	强力转债	2,965,838.36	0.08
40	113696	伯 25 转债	2,600,000.00	0.07
41	127092	运机转债	2,560,002.74	0.07
42	113673	岱美转债	1,938,327.40	0.05
43	123222	博俊转债	1,478,887.67	0.04
44	123165	回天转债	1,428,220.55	0.04
45	123237	佳禾转债	1,305,959.21	0.04
46	113649	丰山转债	1,273,075.34	0.04
47	132026	G 三峡 EB2	1,137,008.86	0.03
48	127089	晶澳转债	936,607.43	0.03
49	113697	应流转债	474,264.91	0.01
50	110074	精达转债	449,436.46	0.01
51	127070	大中转债	373,562.88	0.01
52	123195	蓝晓转 02	151,645.89	0.00
53	113043	财通转债	97,636.75	0.00

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
嘉实稳宏 债券 A	6,429	89,907.72	471,487,896.40	81.57	106,528,818.66	18.43
嘉实稳宏 债券 C	5,015	37,595.09	143,839,375.88	76.29	44,699,998.08	23.71
嘉实稳宏 债券 D	384	2,529,624.67	968,882,020.89	99.74	2,493,851.41	0.26
合计	11,478	151,414.18	1,584,209,293.17	91.15	153,722,668.15	8.85

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 理人所有从业 人员持 有本基 金	嘉实稳宏债券 A	869,341.42	0.15
	嘉实稳宏债券 C	11,329.64	0.01
	嘉实稳宏债券 D	838.55	0.00
	合计	881,509.61	0.05

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	嘉实稳宏债券 A	0
	嘉实稳宏债券 C	0
	嘉实稳宏债券 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实稳宏债券 A	50~100
	嘉实稳宏债券 C	0
	嘉实稳宏债券 D	0
	合计	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实稳宏债券 A	嘉实稳宏债券 C	嘉实稳宏债券 D
----	----------	----------	----------

基金合同生效日（2017 年 6 月 2 日）基金份额总额	85,962,059.60	243,344,783.44	—
本报告期期初基金份额总额	470,947,581.58	110,257,606.88	34,228,403.36
本报告期基金总申购份额	718,621,415.23	399,611,647.88	2,103,016,815.23
减：本报告期基金总赎回份额	611,552,281.75	321,329,880.80	1,165,869,346.29
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	578,016,715.06	188,539,373.96	971,375,872.30

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、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

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，会计师事务所为容诚会计师事务所（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

本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

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 (%)	
华源证券股份有限公司	2	613,593,794.55	21.07	267,465.61	21.07	-

公司						
国金证券股份有限公司	1	348,334,336.65	11.96	151,839.69	11.96	—
国盛证券股份有限公司	2	344,127,296.77	11.82	150,003.81	11.82	—
开源证券股份有限公司	3	323,395,371.83	11.11	140,974.16	11.11	—
天风证券股份有限公司	2	203,550,188.51	6.99	88,729.03	6.99	—
招商证券股份有限公司	2	194,867,855.40	6.69	84,943.78	6.69	—
申万宏源证券有限公司	1	181,088,019.22	6.22	78,935.20	6.22	—
中信建投证券股份有限公司	3	171,962,822.25	5.91	74,955.89	5.91	—
东吴证券股份有限公司	1	106,460,185.80	3.66	46,405.82	3.66	—
长江证券股份有限公司	2	95,048,110.24	3.26	41,433.56	3.26	—
中泰证券股份有限公司	1	78,893,577.60	2.71	34,392.54	2.71	—
中信证券股份有限公司	3	61,578,335.72	2.11	26,842.83	2.11	—
东方财富证券股份有限公司	2	55,303,976.94	1.90	24,103.79	1.90	—
国联民生证券股份有限公司	2	52,989,933.00	1.82	23,100.70	1.82	—
国泰海通证券股份有限公司	4	35,119,169.00	1.21	15,307.78	1.21	—
兴业证券	1	24,734,658.34	0.85	10,783.29	0.85	—

股份有限公司						
中国国际金融股份有限公司	2	20,738,632.00	0.71	9,040.60	0.71	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中国中金 财富证券 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。

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	
	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(%)
华源证券股份有限公司	656,069,055.12	22.42	6,576,000,000.00	36.43	-	-
国金证券股份有限公司	514,879,607.70	17.60	889,000,000.00	4.92	-	-
国盛证券股份有限公司	269,757,255.06	9.22	2,212,000,000.00	12.25	-	-
开源证券股份有限公司	357,974,703.64	12.23	3,335,600,000.00	18.48	-	-
天风证券股份有限公司	191,411,158.53	6.54	373,000,000.00	2.07	-	-

司						
招商证券股份有限公司	50,237,761.98	1.72	1,410,000,000.00	7.81	—	—
申万宏源证券有限公司	252,755,461.39	8.64	539,500,000.00	2.99	—	—
中信建投证券股份有限公司	131,100,037.89	4.48	1,498,000,000.00	8.30	—	—
东吴证券股份有限公司	96,641,536.28	3.30	93,000,000.00	0.52	—	—
长江证券股份有限公司	138,897,264.41	4.75	92,000,000.00	0.51	—	—
中泰证券股份有限公司	92,115,984.12	3.15	—	—	—	—
中信证券股份有限公司	78,378,891.51	2.68	—	—	—	—
东方财富证券股份有限公司	47,243,606.77	1.61	296,000,000.00	1.64	—	—
国联民生证券股份有限公司	22,014,532.86	0.75	326,000,000.00	1.81	—	—
国泰海通证券股份有限公司	—	—	184,000,000.00	1.02	—	—
兴业证券股份有限公司	18,047,368.56	0.62	195,000,000.00	1.08	—	—

司						
中国国际金融股份有限公司	8,430,467.80	0.29	34,000,000.00	0.19	—	—
财通证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
德邦证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
东方证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
高盛(中国)证券有限责任公司	—	—	—	—	—	—
光大证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
广发证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
国信证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
华金证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
华泰证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
民生证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—

司						
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 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	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、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

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	2026-01-01 至 2026-01-07	133,789,562.87	-	133,789,562.87	-	-
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。

§ 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稳宏债券型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实稳宏债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实稳宏债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实稳宏债券型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实稳宏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