

嘉实致安 3 个月定期开放债券型发起式证  
券投资基金  
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

## §1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	嘉实致安 3 个月定期债券
基金主代码	007879
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 26 日
报告期末基金份额总额	4,492,126,254.71 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）封闭期投资策略：运用大类资产配置策略，本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。本基金封闭期投资策略还包括：债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。</p> <p>（二）开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。</p>
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票，还将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	18,961,663.18
2. 本期利润	36,515,794.99
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0083
4. 期末基金资产净值	5,111,352,201.65
5. 期末基金份额净值	1.1378

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

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

#### 3.2 基金净值表现

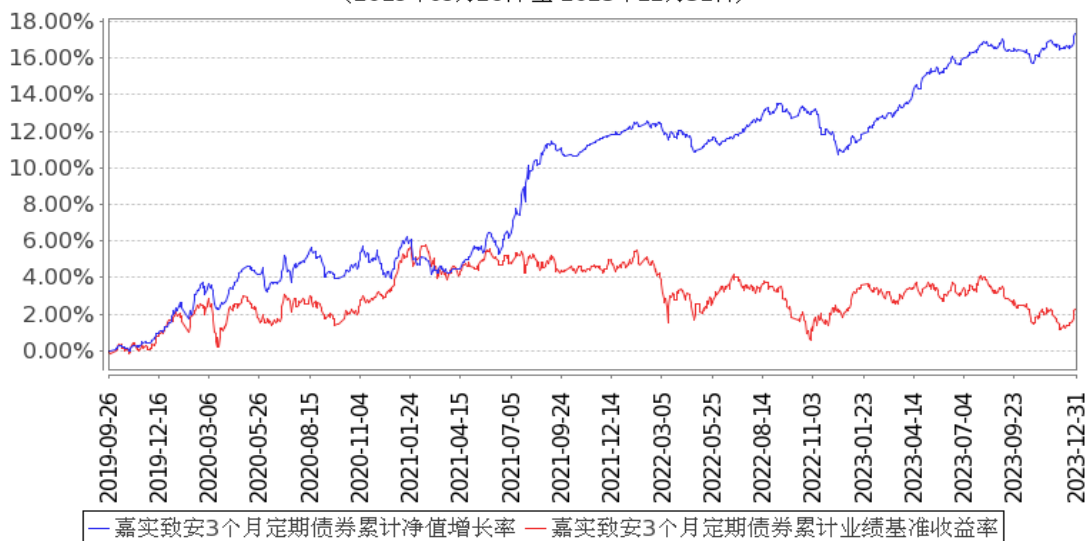
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.72%	0.09%	-0.21%	0.14%	0.93%	-0.05%
过去六个月	1.27%	0.08%	-0.85%	0.14%	2.12%	-0.06%
过去一年	5.48%	0.09%	-0.04%	0.14%	5.52%	-0.05%
过去三年	11.69%	0.13%	-1.77%	0.18%	13.46%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	17.31%	0.14%	2.28%	0.18%	15.03%	-0.04%

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

### 嘉实致安3个月定期债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年09月26日至2023年12月31日)



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

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
董福焱	本基金、嘉实策略混合、嘉实多元债券、嘉实精选平衡混合基金经理	2022年5月6日	-	13年	曾任英国德勤会计师事务所审计师，博时基金管理有限公司行业研究员，天弘基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司投资经理。2018年7月加入嘉实基金管理有限公司，曾任职于上海 GARP 投资策略组，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
赵国英	本基金、嘉实信用债券、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实致享纯债债券、嘉	2022年5月6日	-	19年	曾任天安保险债券交易员，兴业银行资金营运中心债券交易员，美国银行上海分行环球金融市场部副总裁，中欧基金策略组负责人、基金经理。2020年8月加入嘉实基金管理有限公司。现任投资总监（纯债）。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

实汇鑫中 短债债 券、嘉实 安泽一年 定期纯债 债券、嘉 实致乾纯 债债券、 嘉实中证 同业存单 AAA 指数 7 天持有 期、嘉实 致裕纯债 债券基金 经理				
--	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单

边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 5 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度债市收益率整体震荡下行。10 月初受特殊再融资债供给扰动，叠加中美利差走阔汇率阶段性承压，资金面维持紧平衡，债券收益率整体呈现平坦化上行。10 月 24 日晚人大常委会审议批准在四季度增发国债 1 万亿，并上调赤字率至 3.8%左右，债券市场对此预期较为充分，叠加特殊再融资债发行高峰已过，宽松预期升温，短端利率下行，曲线短暂趋于陡峭化。从经济基本面来看，10 月 31 日公布的 PMI 数据偏弱，11 月 9 日公布的通胀数据也指向需求不足，在此期间长端利率震荡下行，但存单一级发行不断提价仍对短端利率构成制约，短端利率上行调整。进入 12 月中上旬，市场焦点集中在中央经济工作会议对新一年经济工作的定调，整体政策内容未超预期。12 月 22 日，多家国有大行再次下调存款挂牌利率，与此同时资金面在财政投放以及 MLF 超额续作等影响下明显缓和，跨年资金利率平稳，机构节前配置需求旺盛，收益率走出流畅下行态势。整个四季度以 1 年国债为代表的短端利率收于 2.08%，较季初下行约 7bp；以 10 年国债为代表的长端利率收于 2.55%，较季初下行 10bp 左右。

权益市场，四季度，沪深 300 下跌 7%，中证 800 下跌 6.38%，创业板指下跌 5.62%。

报告期内，组合积极参与波段交易，短端利率上行后，加仓短期资产，提升杠杆水平。积极参与长端波段交易，灵活调整久期；可转债方面，我们整体上维持中性偏低仓位运行，四季度伴随稳增长政策出台，宏观层面出现较好的边际变化，在此背景下，我们对组合进行了优化，进一步向偏股型和平衡型转债集中，适当减配偏债型转债；权益方面，本产品股票部分进行了减仓操作，除基于置换目的买入的同时具备低波动、低估值、高股息属性的标的，没有买入操作。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1378 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.72%，业绩比较基准收益率为-0.21%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
----	----	-------	--------------

1	权益投资	277,935,439.65	3.59
	其中：股票	277,935,439.65	3.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,919,178,918.57	89.39
	其中：债券	6,919,178,918.57	89.39
	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	539,629,268.18	6.97
8	其他资产	3,780,850.80	0.05
9	合计	7,740,524,477.20	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 111,831,533.55 元，占基金资产净值的比例为 2.19%。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	44,099,732.20	0.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	22,682,366.00	0.44
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	7,451,057.90	0.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,505,000.00	0.09
J	金融业	58,302,700.00	1.14
K	房地产业	29,063,050.00	0.57
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-

合计	166,103,906.10	3.25
----	----------------	------

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	29,826,020.12	0.58
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	47,146,059.25	0.92
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	16,980,061.63	0.33
信息技术	-	-
原材料	11,798,413.48	0.23
房地产	6,080,979.07	0.12
公用事业	-	-
合计	111,831,533.55	2.19

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601818	光大银行	13,421,600	38,922,640.00	0.76
2	386 HK	中国石油化工股份	10,000,000	37,064,398.00	0.73
3	700 HK	腾讯控股	112,100	29,826,020.12	0.58
4	601186	中国铁建	2,980,600	22,682,366.00	0.44
5	000002	万科 A	1,510,000	15,794,600.00	0.31
5	2202 HK	万科企业	929,400	6,080,979.07	0.12
6	601628	中国人寿	683,600	19,380,060.00	0.38
7	1800 HK	中国交通建设	5,000,000	15,768,228.00	0.31
8	300750	宁德时代	90,000	14,693,400.00	0.29
9	1787 HK	山东黄金	878,500	11,798,413.48	0.23
10	603551	奥普家居	1,000,000	10,590,000.00	0.21

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	121,180,351.92	2.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,200,591,779.97	23.49
	其中：政策性金融债	12,155,402.74	0.24
4	企业债券	1,014,241,577.04	19.84
5	企业短期融资券	726,235,234.45	14.21
6	中期票据	2,424,322,244.20	47.43
7	可转债（可交换债）	424,012,383.23	8.30



8	同业存单	199,303,870.70	3.90
9	其他	809,291,477.06	15.83
10	合计	6,919,178,918.57	135.37

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	198903	23 津 106	3,000,000	304,619,506.86	5.96
2	2371151	23 江西债 72	2,000,000	202,230,928.96	3.96
3	232380008	23 广州农商行二级资本债 01	1,800,000	195,399,737.70	3.82
4	1928031	19 广发银行永续债	1,800,000	184,345,672.13	3.61
5	2120107	21 浙商银行永续债	1,800,000	184,145,311.48	3.60

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

无。

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

无。

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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

#### 5.10 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，广发银行股份有限公司、大连银行股份有限公司、厦门国际银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	327,796.76
2	应收证券清算款	3,453,054.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	3,780,850.80

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110081	闻泰转债	10,868,648.80	0.21
2	123126	瑞丰转债	9,409,314.85	0.18
3	123076	强力转债	9,076,042.36	0.18
4	128035	大族转债	9,011,109.38	0.18
5	123124	晶瑞转 2	8,969,415.92	0.18
6	113043	财通转债	8,918,257.53	0.17
7	123056	雪榕转债	8,433,863.91	0.17
8	110092	三房转债	8,336,536.99	0.16
9	127059	永东转 2	8,271,019.65	0.16
10	118020	芳源转债	8,246,520.55	0.16
11	123132	回盛转债	7,752,158.46	0.15
12	127062	垒知转债	7,727,490.73	0.15
13	123153	英力转债	7,694,854.96	0.15
14	113610	灵康转债	7,645,216.13	0.15
15	127070	大中转债	7,614,588.78	0.15
16	123196	正元转 02	7,463,958.14	0.15
17	113545	金能转债	7,428,910.60	0.15
18	128117	道恩转债	7,146,568.81	0.14
19	128138	侨银转债	6,826,756.15	0.13

20	113629	泉峰转债	6,707,334.25	0.13
21	110076	华海转债	6,488,235.62	0.13
22	123187	超达转债	6,469,923.29	0.13
23	118000	嘉元转债	6,438,230.14	0.13
24	118032	建龙转债	6,405,396.16	0.13
25	113665	汇通转债	6,375,965.38	0.12
26	113624	正川转债	6,321,104.31	0.12
27	128108	蓝帆转债	6,138,402.74	0.12
28	113565	宏辉转债	6,054,794.52	0.12
29	128127	文科转债	5,993,155.55	0.12
30	127079	华亚转债	5,840,902.44	0.11
31	113653	永 22 转债	5,702,546.87	0.11
32	128042	凯中转债	5,669,428.09	0.11
33	113608	威派转债	5,615,396.47	0.11
34	123146	中环转 2	5,509,340.04	0.11
35	113640	苏利转债	5,436,166.31	0.11
36	123115	捷捷转债	5,419,184.93	0.11
37	113050	南银转债	5,300,842.47	0.10
38	123049	维尔转债	5,248,379.45	0.10
39	111004	明新转债	5,191,477.13	0.10
40	127061	美锦转债	4,921,721.92	0.10
41	128063	未来转债	4,914,569.86	0.10
42	123071	天能转债	4,856,099.73	0.10
43	113593	沪工转债	4,813,927.49	0.09
44	123093	金陵转债	4,772,432.88	0.09
45	123156	博汇转债	4,768,500.59	0.09
46	110070	凌钢转债	4,732,892.05	0.09
47	123172	漱玉转债	4,673,459.78	0.09
48	128118	瀛通转债	4,596,221.39	0.09
49	123106	正丹转债	4,507,096.53	0.09
50	113055	成银转债	4,490,660.82	0.09
51	113542	好客转债	4,409,177.03	0.09
52	128039	三力转债	4,391,214.30	0.09
53	123157	科蓝转债	4,359,303.45	0.09
54	123130	设研转债	4,319,762.33	0.08
55	113049	长汽转债	4,308,383.56	0.08
56	113033	利群转债	4,292,964.38	0.08
57	123190	道氏转 02	4,131,461.88	0.08
58	113056	重银转债	4,091,959.45	0.08
59	128144	利民转债	3,546,166.10	0.07
60	113582	火炬转债	3,352,750.00	0.07
61	123151	康医转债	3,293,468.90	0.06

62	123155	中陆转债	3,255,433.36	0.06
63	123141	宏丰转债	3,205,795.50	0.06
64	123194	百洋转债	2,781,018.50	0.05
65	127024	盈峰转债	2,516,540.65	0.05
66	110060	天路转债	2,376,835.48	0.05
67	118005	天奈转债	2,311,961.76	0.05
68	110064	建工转债	2,219,283.29	0.04
69	113652	伟 22 转债	2,155,606.34	0.04
70	118031	天 23 转债	2,034,834.52	0.04
71	113574	华体转债	2,020,551.62	0.04
72	113660	寿 22 转债	1,035,737.91	0.02

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,403,631,564.44
报告期期间基金总申购份额	88,494,690.27
减：报告期期间基金总赎回份额	-
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,492,126,254.71

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

### §8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无。

### §9 影响投资者决策的其他重要信息

## 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023-10-01 至 2023-12-31	3,719,545,285.48	-	-	3,719,545,285.48	82.80
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## §10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

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

### 10.2 存放地点

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

### 10.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日