嘉实致享纯债债券型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 2026 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实致享纯债债券
基金主代码	006841
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 28 日
报告期末基金份额总额	2,783,112,321.61 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	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。 债券具体投资策略包括：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，其他投资策略包括：资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率
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。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）
1.本期已实现收益	27,776,959.02
2.本期利润	21,995,217.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062
4.期末基金资产净值	2,913,355,859.48
5.期末基金份额净值	1.0468

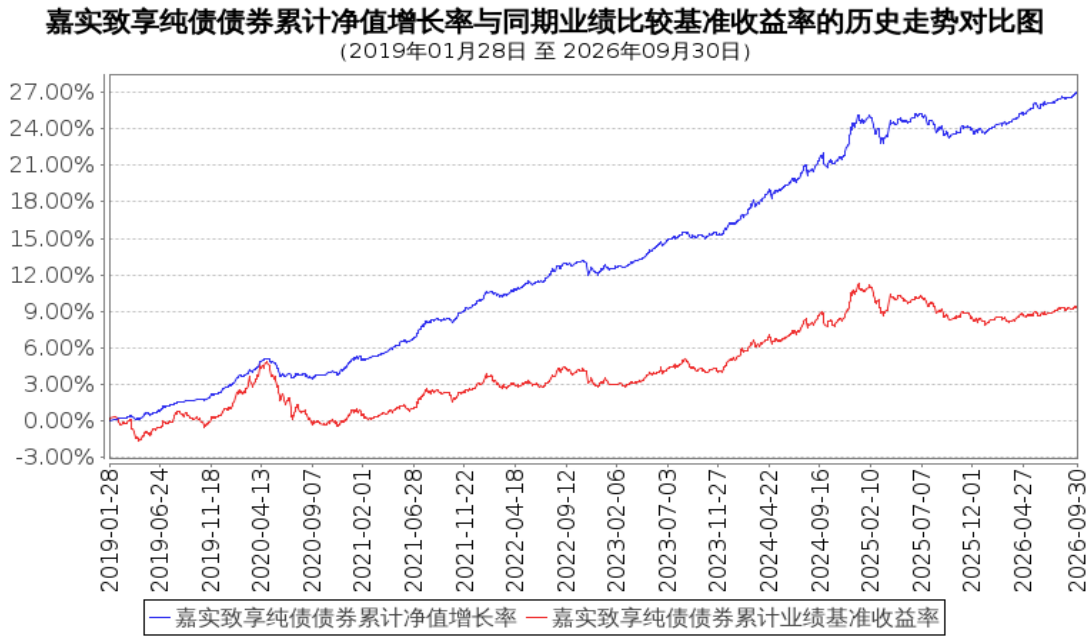
注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.58%	0.04%	0.40%	0.04%	0.18%	0.00%
过去六个月	1.66%	0.04%	0.90%	0.05%	0.76%	-0.01%
过去一年	2.76%	0.05%	0.90%	0.06%	1.86%	-0.01%
过去三年	10.07%	0.10%	4.90%	0.09%	5.17%	0.01%
过去五年	17.04%	0.08%	6.80%	0.09%	10.24%	-0.01%
过去七年	24.73%	0.08%	9.15%	0.10%	15.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	26.87%	0.07%	9.31%	0.10%	17.56%	-0.03%

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



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 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		
赵国英	本基金、嘉实信用债券、嘉实稳怡债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉	2022 年 1 月 14 日	-	22 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。

	实致乾纯债债券、嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数、嘉实汇明纯债债券基金经理				
张文佳	本基金、嘉实稳熙纯债债券、嘉实致盈债券、嘉实致华纯债债券、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、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	2022 年 6 月 14 日	-	10 年	曾任中欧基金管理有限公司宏观及债券策略研究助理、债券投资基金经理助理。2020 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司固收投研体系，任基金经理助理。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。

（3）2026 年 9 月 28 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告》，张文佳女士已结束休假（产假），自 2026 年 9 月 28 日起恢复履行基金经理职务。

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、《嘉实致享纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽

责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 2 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

经济基本面来看，三季度实际 GDP 同比大概率落在 4.3%-4.5%区间，较二季度 4.3%基本持平略升，仍低于全年“4.5%-5.0%”目标下沿。结构分化依然明显，供给端逐月修复，8 月工业增加值同比由 7 月的 4.5%回升至 5.2%，9 月制造业 PMI 重回 50.1%。新动能维持高位，旧经济拖累收窄，但需求端消费与投资继续走弱，8 月社零同比仅 0.4%，较 7 月的 0.6%进一步回落，1-8 月累计社零同比仅 1.1%。投资方面，1-8 月固定资产投资累计同比-7.2%，较 1-7 月的-6.7%跌幅进一步加深，分项看，制造业投资累计-2.3%、广义基建-4.0%、房地产开发投资-19.9%；广义财政支出 1-8 月同比-3.5%，财政成了拖累项而非拉动项。整体来看，“供强需弱”的分化在三季度不减反增。价格方面，8 月 CPI 同比 0.8%（7 月 0.5%）、环比 0.4%，8 月 PPI 同比+3.8%（7 月+3.5%），结构上上游涨幅远快于中下游，是典型的成本推动型通胀。就业出现边际转弱，8 月城镇调查失业率 5.3%（7 月 5.2%）、31 个大城市失业率同为 5.3%，均较 7 月上行 0.1pp，且 8 月失业率上行超过季节性规律，与消费走弱相互印证，值得关注。

政策方面，8000 亿元新型政策性金融工具已于 9 月初开始投放。9 月 28 日国常会提出“推出一批务实管用的增量政策”，隔天央行将 PSL 利率下调 25bp 至 1.5%、扩大 PSL 适用范围至“六张网”；同时中央财政首次对商业性个人住房贷款贴息。另外国常会提到“用好地方政府债务结存限额”，预计四季度将新增政府债发行约 5000 亿左右。

债券市场方面，三季度国内债市走出典型的“牛平”行情—长端与超长端利率顺畅下行，短端受资金利率刚性约束几近钝化，1 年国债甚至有一定幅度的上行，收益率曲线显著平坦化。30 年国债 3 季度整体下行约 24bp，10 年国债下行约 5bp，1 年国债上行约 10bp。

报告期内，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，三季度适当提升了组合的久期水平，获得了较好的效果。

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 1.0468 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.58%，业绩比较基准收益率为 0.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,607,111,703.06	99.99
	其中：债券	3,607,111,703.06	99.99
	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	481,872.13	0.01
8	其他资产	-	-
9	合计	3,607,593,575.19	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	473,178,048.24	16.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,133,933,654.82	107.57
	其中：政策性金融债	3,133,933,654.82	107.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,607,111,703.06	123.81

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	190205	19 国开 05	3,400,000	364,160,772.60	12.50
2	200210	20 国开 10	3,200,000	341,436,493.15	11.72
3	250218	25 国开 18	3,000,000	308,391,041.10	10.59
4	09240201	24 国开清发 01	2,500,000	266,509,863.01	9.15
5	230205	23 国开 05	2,200,000	242,746,372.60	8.33

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，国家开发银行出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

无。

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	4,148,052,364.20
报告期期间基金总申购份额	288,816,202.92
减：报告期期间基金总赎回份额	1,653,756,245.51
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	2,783,112,321.61

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	2026-08-18 至 2026-09-30	761,829,556.66	-	-	761,829,556.66	27.37
	2	2026-07-01 至 2026-08-17	1,439,538,387.71	-	1,439,538,387.71	-	-
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予嘉实致享纯债债券型证券投资基金注册的批复文件。

（2）《嘉实致享纯债债券型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实致享纯债债券型证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实致享纯债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）报告期内嘉实致享纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 10 月 27 日