嘉实汇明纯债债券型证券投资基金(原嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金转型)
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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。

嘉实汇明纯债债券型证券投资基金由嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金在 2026 年 1 月 12 日变更而来。

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 12 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 6

2.1 基金基本情况（转型后） 6
2.1 基金基本情况（转型前） 6
2.2 基金产品说明（转型后） 6
2.2 基金产品说明（转型前） 7
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 8

§3 主要财务指标和基金净值表现 8

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后) 8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前) 9
3.2 基金净值表现（转型后） 10
3.2 基金净值表现（转型前） 11

§4 管理人报告 13

4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 15
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 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 16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
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 17

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
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 17

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型后） 17

6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 19
6.3 净资产变动表 20
6.4 报表附注 21

§6 半年度财务会计报告（未经审计)（转型前） 46

6.1 资产负债表 46
6.2 利润表 48

6.3 净资产变动表 49
6.4 报表附注 51
§7 投资组合报告（转型后） 71
7.1 期末基金资产组合情况 71
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 72
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 72
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 72
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 72
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 73
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 73
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 73
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 73
7.11 投资组合报告附注 73
§7 投资组合报告（转型前） 74
7.1 期末基金资产组合情况 74
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 74
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 74
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 75
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 75
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 75
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 75
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 76
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 76
7.11 投资组合报告附注 76
§8 基金份额持有人信息（转型后） 77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 77
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 77
§8 基金份额持有人信息（转型前） 78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 78
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 78
§9 开放式基金份额变动（转型后） 79
§9 开放式基金份额变动（转型前） 79
§10 重大事件揭示 79
10.1 基金份额持有人大会决议 79
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 79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 80

10.4 基金投资策略的改变 80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 80
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 80
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(转型后) 81
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(转型前) 85
10.8 其他重大事件（转型后） 89
10.8 其他重大事件（转型前） 89
§11 影响投资者决策的其他重要信息 89
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 89
§12 备查文件目录 89
12.1 备查文件目录 89
12.2 存放地点 90
12.3 查阅方式 90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	嘉实汇明纯债债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实汇明纯债债券	
基金主代码	023496	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 12 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	353,402,997.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实汇明纯债债券 A	嘉实汇明纯债债券 C
下属分级基金的交易代码	023496	023497
报告期末下属分级基金的份额总额	91,727,049.88 份	261,675,947.96 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债	
基金主代码	023496	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 6 月 10 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,746,015,050.76 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C
下属分级基金的交易代码	023496	023497
报告期末下属分级基金的份额总额	494,509,547.87 份	2,251,505,502.89 份

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	债券等固定收益类资产的投资策略：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。包括：利率策略、信用债券和资产支持证券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略。 本基金其他策略包括：国债期货投资策略、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金在严格控制风险和保持基金资产流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	债券等固定收益类资产的投资策略：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。包括：利率策略、信用债券和资产支持证券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略。 本基金其他策略包括：国债期货投资策略、信用衍生品投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+银行活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，预期风险与预期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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	王小飞
	联系电话	(010)65215588	021-60637103
	电子邮箱	service@jsfund.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	021-60637228
传真		(010)65215588	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100020	100033
法定代表人		经雷	张金良

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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	嘉实汇明纯债债券 A	嘉实汇明纯债债券 C
本期已实现收益	-324,423.30	-2,118,841.86
本期利润	2,485,735.59	7,707,283.28
加权平均基金份额本期利润	0.0153	0.0139
本期加权平均净值利润率	1.51%	1.38%
本期基金份额净值增长率	1.49%	1.38%
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	1,202,346.26	2,813,275.58
期末可供分配基金份额利润	0.0131	0.0108
期末基金资产净值	93,738,809.82	266,788,799.87
期末基金份额净值	1.0219	1.0195
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	1.49%	1.38%

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。

（4）本基金合同生效日为 2026 年 01 月 12 日，本报告期自 2026 年 01 月 12 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

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 1 月 11 日)	
	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C
本期已实现收益	284,384.06	1,143,099.89
本期利润	275,536.94	1,102,873.14
加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.0005
本期加权平均净值利润率	0.06%	0.05%
本期基金份额净值增长率	0.06%	0.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 1 月 11 日)	
期末可供分配利润	3,398,382.56	12,537,092.16
期末可供分配基金份额利润	0.0069	0.0056
期末基金资产净值	497,907,930.43	2,264,042,595.05
期末基金份额净值	1.0069	1.0056
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 1 月 11 日)	
基金份额累计净值增长率	0.69%	0.56%

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。

（4）自 2026 年 1 月 12 日起，《嘉实汇明纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

3.2 基金净值表现（转型后）

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

嘉实汇明纯债债券 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	0.67%	0.02%	0.57%	0.03%	0.10%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.49%	0.02%	0.96%	0.03%	0.53%	-0.01%

嘉实汇明纯债债券 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	0.61%	0.02%	0.57%	0.03%	0.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	1.38%	0.02%	0.96%	0.03%	0.42%	-0.01%

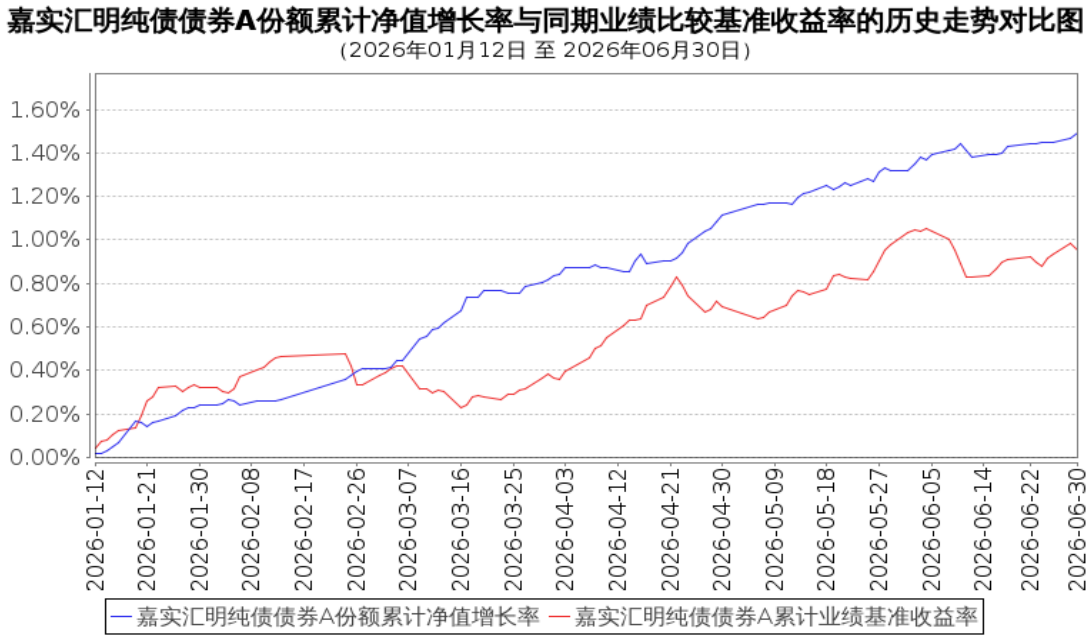
注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

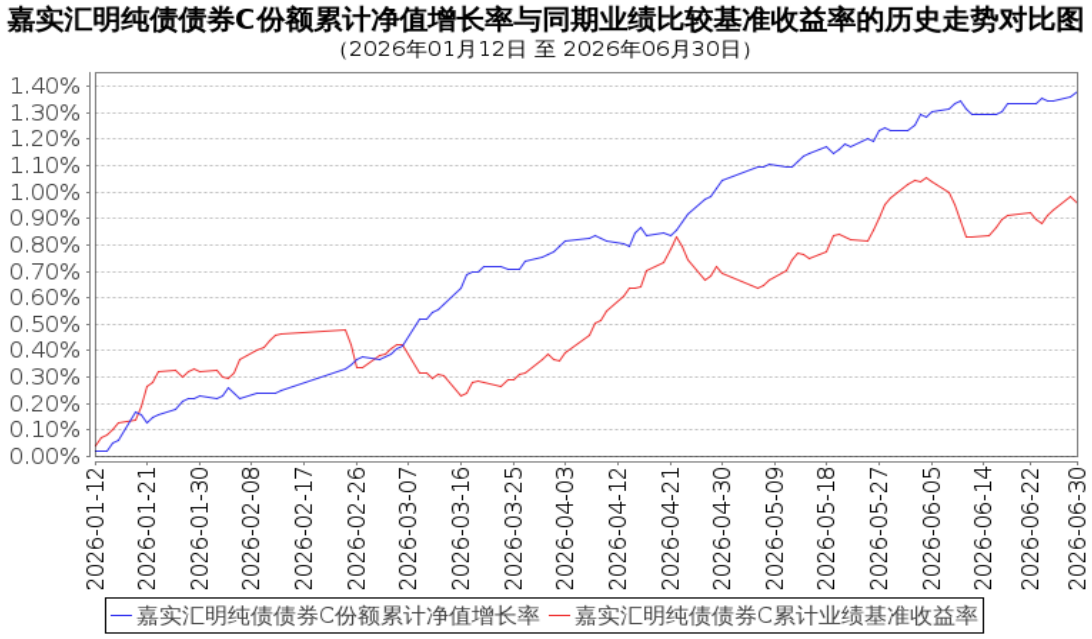
Return(t)=(中债综合全价(总值)指数(t)/中债综合全价(总值)指数(t-1)-1)×90%＋((1+银行活期存款利率(税后))^(1/365)-1）×10%

Benchmark(t)=(1+Return(t))×（1+Benchmark(t-1)）-1

其中，t =1，2，3，…T，T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金转型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





注：（1）本基金合同生效日 2026 年 01 月 12 日至报告期末未满 1 年。

（2）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，本报告期处于建仓期内。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A

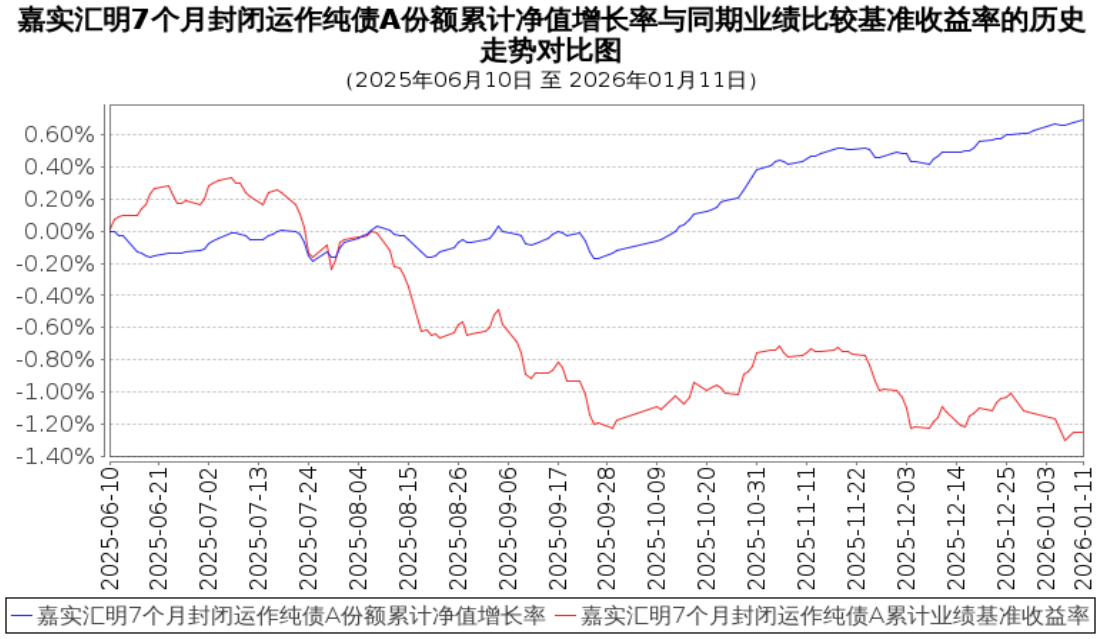
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①－③	②－④

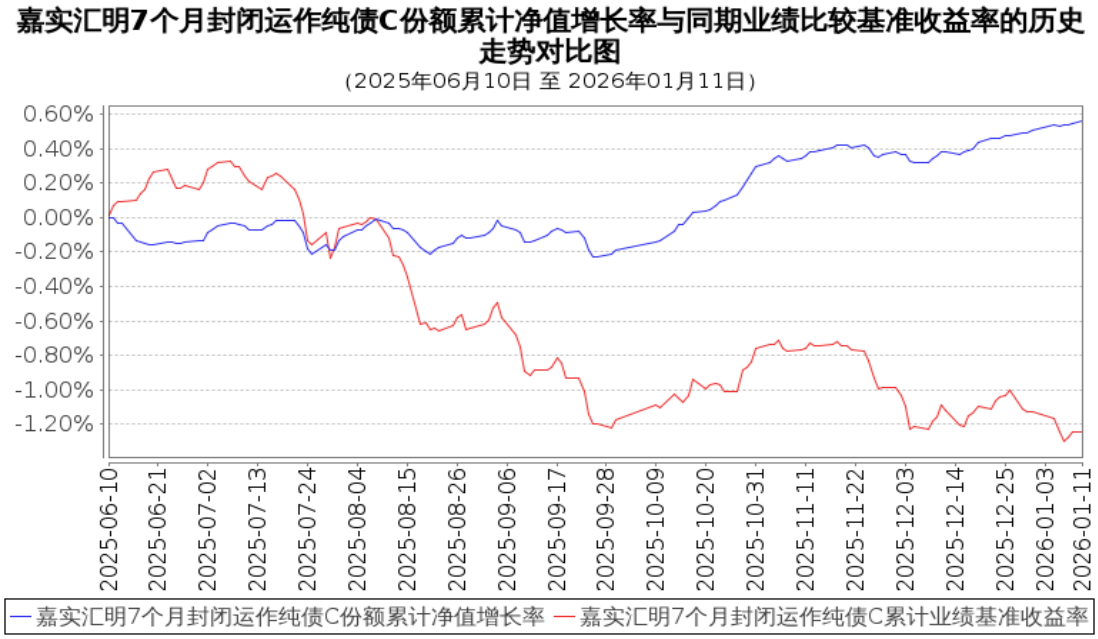
	率①	准差②		④		
过去三个月	0.06%	0.02%	-0.12%	0.04%	0.18%	-0.02%
过去六个月	0.81%	0.02%	-0.07%	0.05%	0.88%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.69%	0.03%	-1.25%	0.06%	1.94%	-0.03%

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 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	0.05%	0.01%	-0.12%	0.04%	0.17%	-0.03%
过去六个月	0.75%	0.02%	-0.07%	0.05%	0.82%	-0.03%
自基金合同生效起至今	0.56%	0.03%	-1.25%	0.06%	1.81%	-0.03%

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





注：（1）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。

（2）自 2026 年 01 月 12 日起，《嘉实汇明纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

§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		
赵国英	本基金、嘉实信用债券、嘉	2025 年 6 月 10 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

	实稳怡债券、嘉实致享纯债债券、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基金经理				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。
陈硕	本基金、嘉实汇达中短债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实致远 3 个月定期纯债债券、嘉实致乾纯债债券、嘉实中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期基金经理	2025 年 8 月 6 日	-	12 年	曾任中国民生银行股份有限公司金融市场部投资经理。2021 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司固收与配置组，任投资经理。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、《嘉实汇明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 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

宏观层面，一季度经济同比增速相对较高，二季度边际放缓：上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中一季度同比增长 5.0%、二季度同比增长 4.3%。外需方面，上半年货物贸易进出口总额同比增长 16.9%，出口景气度高。内需方面，上半年社会消费品零售总额同比增长 1.3%，消费修复节奏总体温和；固定资产投资（不含农户）上半年同比下降 5.7%，投资端压力仍在；房地产开发投资上半年同比下降 18.0%，地产链条仍是内需偏弱的重要来源。此外，供给端工业生产保持一定韧性：上半年规模以上工业增加值同比增长 5.4%，其中高技术制造业等新动能表现相对突出。

债市运行层面，上半年债市整体呈现低波动，窄区间的特征。10 年期国债收益率在年初短暂冲高，随后从 1.90%的高点震荡下行至 6 月初 1.70%的阶段低点，之后小幅回调，六月末收于 1.73%。从驱动因素看，上半年大致可分为三个阶段：第一阶段（1 月至 2 月中旬），政策利率稳定叠加流动性偏松，债市偏强。年初在“宽信用、稳增长”政策取向下，市场对流动性维持合理充裕的预

期较强；同时，央行于 1 月中下调再贷款、再贴现利率 25BP，进一步强化了宽松的政策取向。春节前后避险需求阶段性升温，10 年期国债收益率下破 1.80%，收益率曲线呈现平坦化特征。第二阶段（2 月下旬至 3 月下旬），基本面数据与外部通胀等多因素扰动共振。一方面，经济数据表现偏强对债市情绪形成压制；另一方面，中东地缘冲突扰动叠加油价高位运行，市场对输入性通胀风险的担忧升温，长端与超长端利率承压，收益率曲线趋于陡峭化。第三阶段（4 月至 6 月），外部扰动边际缓和，流动性环境总体稳定，债市重回“牛平”。随着地缘风险溢价回落，叠加资金面总体维持充裕，债市延续偏强格局；6 月在季节性因素影响下出现阶段性收敛，债市小幅回调，但整体仍处于窄幅区间震荡。

上半年，本基金秉持稳健投资原则，根据央行货币政策和利率走势灵活调整组合的久期和杠杆水平，适当进行利率债波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后：

截至 2026 年 06 月 30 日，嘉实汇明纯债债券 A 基金份额净值为 1.0219 元，嘉实汇明纯债债券 C 基金份额净值为 1.0195 元；自 2026 年 01 月 12 日起至 2026 年 06 月 30 日止，基金 A 份额净值增长率为 1.49%，基金 C 份额净值增长率为 1.38%；业绩比较基准收益率为 0.96%。

转型前：

截至 2026 年 01 月 11 日，嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A 基金份额净值为 1.0069 元，嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C 基金份额净值为 1.0056 元；自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 01 月 11 日止，基金 A 份额净值增长率为 0.06%，基金 C 份额净值增长率为 0.05%；业绩比较基准收益率为-0.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济层面，政策重点料将着重于实施好现有政策，在外围环境不超预期的情况下，预计全年可实现 4.5%-5%的 GDP 目标，因此在目前时点进一步推出强有力的货币与财政政策可能性不大。债券市场下半年预计整体仍维持区间震荡行情，10 年国债收益率区间预计为 1.60%-1.9%。行情发展的节奏可能会是"收益率先上后下"，三季度债券的供给压力与止盈压力可能推动收益率阶段性上行，四季度随供给压力消退与年末抢跑逻辑重现，利率有望再度下行。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实汇明纯债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

资 产：		
货币资金	6.4.7.1	1,257,216.13
结算备付金		3,912,113.19
存出保证金		862,577.00
交易性金融资产	6.4.7.2	422,384,726.04
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		422,384,726.04
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		-
应收股利		-
应收申购款		75,363.37
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		428,491,995.73
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 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		65,005,047.68
应付清算款		-
应付赎回款		2,682,533.58
应付管理人报酬		71,968.62
应付托管费		32,713.02
应付销售服务费		53,439.62
应付投资顾问费		-
应交税费		21,338.85
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	97,344.67
负债合计		67,964,386.04

净资产：		
实收基金	6.4.7.10	353,402,997.84
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	7,124,611.85
净资产合计		360,527,609.69
负债和净资产总计		428,491,995.73

注：本基金合同生效日为 2026 年 01 月 12 日，本报告期自基金合同生效日 2026 年 01 月 12 日起至 2026 年 06 月 30 日止。报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实汇明纯债债券 A 基金份额净值 1.0219 元，基金份额总额 91,727,049.88 份，嘉实汇明纯债债券 C 基金份额净值 1.0195 元，基金份额总额 261,675,947.96 份，基金份额总额合计为 353,402,997.84 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实汇明纯债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,423,210.37
1.利息收入		128,934.67
其中：存款利息收入	6.4.7.13	62,045.76
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		66,888.91
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-357,061.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	290,084.52
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-647,146.35
股利收益	6.4.7.19	-
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	12,636,284.03
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	15,053.50
减：二、营业总支出		2,230,191.50
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	720,222.26
2．托管费	6.4.10.2.2	327,373.79

3．销售服务费	6.4.10.2.3	554,691.02
4．投资顾问费		-
5．利息支出		469,455.45
其中：卖出回购金融资产支出		469,455.45
6．信用减值损失	6.4.7.22	-
7．税金及附加		35,115.30
8．其他费用	6.4.7.23	123,333.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,193,018.87
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,193,018.87
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		10,193,018.87

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实汇明纯债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,746,015,050.76	-	15,935,474.72	2,761,950,525.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,392,612,052.92	-	-8,810,862.87	-2,401,422,915.79
（一）、综合收益总额	-	-	10,193,018.87	10,193,018.87
（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）	-2,392,612,052.92	-	-19,003,881.74	-2,411,615,934.66
其中：1.基金申购款	595,763,204.17	-	7,952,485.73	603,715,689.90
2.基金赎回款	-2,988,375,257.09	-	-26,956,367.47	-3,015,331,624.56
（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	353,402,997.84	-	7,124,611.85	360,527,609.69

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

嘉实汇明纯债债券型证券投资基金是原嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金(以下简称“嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债”)依照《关于嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金封闭运作期届满转为开放式运作、变更基金名称并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》变更而来。自 2026 年 1 月 12 日起，原嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债正式变更为嘉实汇明纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)，原《嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金基金合同》失效，《嘉实汇明纯债债券型证券投资基金基金合同》生效。经向中国证监会备案，《嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,746,015,050.76 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1)金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资和基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的以公允价值计量的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

在封闭期内，实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

本基金转型为开放式基金后，实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准

金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算确认。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

本基金在封闭期内不开放申购或赎回，不产生损益平准金。

本基金转型为开放式基金后，损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，由基金管理人根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制

定收益分配方案。本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

无。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司

所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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》、国务院令第 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	1,257,216.13
等于：本金	1,257,027.57
加：应计利息	188.56
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	1,257,216.13

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		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	185,697,452.03	2,590,404.38	185,986,604.38	-2,301,252.03
	银行间市场	232,746,665.21	2,782,121.66	236,398,121.66	869,334.79
	合计	418,444,117.24	5,372,526.04	422,384,726.04	-1,431,917.24
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		418,444,117.24	5,372,526.04	422,384,726.04	-1,431,917.24

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	20,497,295.38	-	-	-
其中：国债期货投资	20,497,295.38	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,497,295.38	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
TL2609	TL2609	-20.00	-22,750,000.00	-194,000.00
TS2609	TS2609	21.00	43,113,000.00	59,704.62

合计				-134,295.38
减：可抵销期货暂收款				-134,295.38
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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	14,033.99
其中：交易所市场	-
银行间市场	14,033.99
应付利息	-
预提费用	83,310.68
合计	97,344.67

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实汇明纯债债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	494,509,547.87	494,509,547.87
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-

本期申购	40,302,110.34	40,302,110.34
本期赎回（以“-”号填列）	-443,084,608.33	-443,084,608.33
本期末	91,727,049.88	91,727,049.88

嘉实汇明纯债债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,251,505,502.89	2,251,505,502.89
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	-	-
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	-	-
2026 年 1 月 12 日(基金合同生效日)至 2026 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	-	-
本期申购	555,461,093.83	555,461,093.83
本期赎回（以“-”号填列）	-2,545,290,648.76	-2,545,290,648.76
本期末	261,675,947.96	261,675,947.96

注： (1)申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2)本基金合同于 2026 年 1 月 12 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,746,015,050.76 份基金份额。

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

嘉实汇明纯债债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	5,956,297.15	-2,557,914.59	3,398,382.56
本期期初	5,956,297.15	-2,557,914.59	3,398,382.56
本期利润	-324,423.30	2,810,158.89	2,485,735.59
本期基金份额交易产生的变动数	-4,429,527.59	557,169.38	-3,872,358.21
其中：基金申购款	448,423.03	159,167.37	607,590.40
基金赎回款	-4,877,950.62	398,002.01	-4,479,948.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,202,346.26	809,413.68	2,011,759.94

嘉实汇明纯债债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	24,181,674.22	-11,644,582.06	12,537,092.16
本期期初	24,181,674.22	-11,644,582.06	12,537,092.16
本期利润	-2,118,841.86	9,826,125.14	7,707,283.28
本期基金份额交易产生的变动数	-19,249,556.78	4,118,033.25	-15,131,523.53
其中：基金申购款	5,158,915.32	2,185,980.01	7,344,895.33
基金赎回款	-24,408,472.10	1,932,053.24	-22,476,418.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,813,275.58	2,299,576.33	5,112,851.91

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,276.08
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	54,619.10
其他	150.58
合计	62,045.76

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	11,286,461.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-10,996,377.01
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	290,084.52

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 12 日（基金合同生效日）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	2,625,676,214.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,607,371,197.28
减：应计利息总额	29,288,044.07
减：交易费用	13,350.00
买卖债券差价收入	-10,996,377.01

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-647,146.35

6.4.7.19 股利收益

无。

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 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	13,071,639.41
股票投资	-
债券投资	13,071,639.41
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-435,355.38
权证投资	-
期货投资	-435,355.38
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	12,636,284.03

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,048.74
基金转出费收入	4.76
合计	15,053.50

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 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,356.70
信息披露费	55,890.90
证券出借违约金	-
银行划款手续费	26,486.08
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	123,333.68

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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 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 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	720,222.26
其中：应支付销售机构的客户维护费	317,679.53
应支付基金管理人的净管理费	402,542.73

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 0.22%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：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.22%/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 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	327,373.79

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	本期

方名称	2026 年 1 月 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实汇明纯债债券 A	嘉实汇明纯债债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	253.79	253.79
中国建设银行	-	343,720.15	343,720.15
合计	-	343,973.94	343,973.94

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.22%，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×0.22%/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

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 12 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	1,257,216.13	7,276.08

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 12 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

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 65,005,047.68 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
250431	25 农发 31	2026 年 7 月 1 日	101.27	43,000	4,354,571.12
102484232	24 豫航空港 MTN020	2026 年 7 月 6 日	103.15	100,000	10,314,947.95
102484477	24 水发集团 MTN010	2026 年 7 月 6 日	104.40	100,000	10,439,982.47
102583893	25 淄博城资 MTN007	2026 年 7 月 6 日	103.23	8,000	825,879.67
102584114	25 豫航空港 MTN005	2026 年 7 月 6 日	103.81	200,000	20,762,499.73
102601914	26 贵州交通 MTN002	2026 年 7 月 6 日	100.77	200,000	20,154,410.96
232480003	24 恒丰银行二级资本债 01	2026 年 7 月 6 日	104.41	37,000	3,863,170.00
合计				688,000	70,715,461.90

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风险管理制度，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

无。

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
AAA	196,041,810.96
AAA 以下	10,142,568.22
未评级	216,200,346.86
合计	422,384,726.04

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	1,257,216.13	-	-	-	1,257,216.13
结算备付金	3,912,113.19	-	-	-	3,912,113.19
存出保证金	66,327.00	-	-	796,250.00	862,577.00
交易性金融资产	173,585,653.15	165,697,208.78	83,101,864.11	-	422,384,726.04
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	-	-	-	75,363.37	75,363.37
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	178,821,309.47	165,697,208.78	83,101,864.11	871,613.37	428,491,995.73
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	65,005,047.68	-	-	-	65,005,047.68
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,682,533.58	2,682,533.58
应付管理人报酬	-	-	-	71,968.62	71,968.62
应付托管费	-	-	-	32,713.02	32,713.02
应付销售服务费	-	-	-	53,439.62	53,439.62
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	21,338.85	21,338.85
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	97,344.67	97,344.67
负债总计	65,005,047.68	-	-	2,959,338.36	67,964,386.04
利率敏感度缺口	113,816,261.79	165,697,208.78	83,101,864.11	-2,087,724.99	360,527,609.69

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）
	市场利率下降 25 个基点	1,698,694.13
	市场利率上升 25 个基点	-1,684,614.64

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）
	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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

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）
	业绩比较基准上升 5%	-
	业绩比较基准下降 5%	-

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
第一层次	-
第二层次	422,384,726.04
第三层次	-
合计	422,384,726.04

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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 1 月 11 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 1 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,992,020.26	3,714,986.90
结算备付金		48,304,396.37	48,237,419.39
存出保证金		1,958,402.44	2,069,855.77
交易性金融资产	6.4.7.2	2,691,949,560.37	3,319,825,040.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		2,691,949,560.37	3,319,825,040.62
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	248,799,852.40	-
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		5,000,534.17	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,999,004,766.01	3,373,847,302.68
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 1 月 11 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		187,051,370.64	610,713,655.92
应付清算款		49,230,304.11	1,088,931.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		183,074.91	515,271.64
应付托管费		83,215.88	234,214.41
应付销售服务费		150,072.24	422,393.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		192,898.15	151,274.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	163,304.60	149,445.13
负债合计		237,054,240.53	613,275,187.28

净资产：			
实收基金	6.4.7.10	2,746,015,050.76	2,746,015,050.76
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	15,935,474.72	14,557,064.64
净资产合计		2,761,950,525.48	2,760,572,115.40
负债和净资产总计		2,999,004,766.01	3,373,847,302.68

注：本基金合同生效日为 2025 年 06 月 10 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 06 月 10 日起至 2026 年 01 月 11 日止。报告截止日 2026 年 01 月 11 日，嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A 基金份额净值 1.0069 元，基金份额总额 494,509,547.87 份，嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C 基金份额净值 1.0056 元，基金份额总额 2,251,505,502.89 份，基金份额总额合计为 2,746,015,050.76 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,071,078.38	-2,850,538.22
1.利息收入		42,683.74	752,058.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	10,435.37	58,765.13
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		32,248.37	693,293.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,077,468.51	2,482,226.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,179,060.39	2,482,226.29
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-101,591.88	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损	6.4.7.20	-49,073.87	-6,084,823.30

失以“-”号填列）			
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	-	-
减：二、营业总支出		692,668.30	773,151.44
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	183,074.91	330,675.30
2．托管费	6.4.10.2.2	83,215.88	150,306.94
3．销售服务费	6.4.10.2.3	150,072.24	271,123.62
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		266,782.50	-
其中：卖出回购金融资产支出		266,782.50	-
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		4,459.69	7,098.27
8．其他费用	6.4.7.23	5,063.08	13,947.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,378,410.08	-3,623,689.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,378,410.08	-3,623,689.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,378,410.08	-3,623,689.66

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 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	2,746,015,050.76	-	14,557,064.64	2,760,572,115.40
二、本期期初净资产	2,746,015,050.76	-	14,557,064.64	2,760,572,115.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	1,378,410.08	1,378,410.08
（一）、综合收益总额	-	-	1,378,410.08	1,378,410.08

（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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	2,746,015,050.76	-	15,935,474.72	2,761,950,525.48
项目	上年度可比期间 2025 年 6 月 10 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	2,746,015,050.76	-	-	2,746,015,050.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-3,623,689.66	-3,623,689.66
（一）、综合收益总额	-	-	-3,623,689.66	-3,623,689.66
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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	2,746,015,050.76	-	-3,623,689.66	2,742,391,361.10

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

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债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[2025]240 号《关于准予嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债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《嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债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，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2025 年 6 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,746,015,050.76 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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。

经中国证监会批准，基金管理人嘉实基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为嘉实汇明纯债债券型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营为编制基础。

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[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、国务院令第 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 1 月 11 日
活期存款	2,992,020.26
等于：本金	2,988,435.10
加：应计利息	3,585.16
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	2,992,020.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 1 月 11 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,603,802,134.58	22,361,582.05	1,612,872,338.15	-13,291,378.48
	银行间市场	1,069,491,178.17	10,798,222.22	1,079,077,222.22	-1,212,178.17
	合计	2,673,293,312.75	33,159,804.27	2,691,949,560.37	-14,503,556.65
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,673,293,312.75	33,159,804.27	2,691,949,560.37	-14,503,556.65

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 1 月 11 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	97,770,940.00	-	-	-
其中：国债期货投资	97,770,940.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	97,770,940.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
TL2603	TL2603	-50.00	-55,435,000.00	412,500.00
TS2603	TS2603	75.00	153,507,000.00	-111,440.00

合计				301,060.00
减：可抵销期货暂收款				301,060.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 1 月 11 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	248,799,852.40	-
合计	248,799,852.40	-

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 1 月 11 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	25,994.52
其中：交易所市场	-
银行间市场	25,994.52
应付利息	-
预提费用	137,310.08
合计	163,304.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	494,509,547.87	494,509,547.87
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	494,509,547.87	494,509,547.87

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,251,505,502.89	2,251,505,502.89
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	2,251,505,502.89	2,251,505,502.89

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

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,671,913.09	-2,549,067.47	3,122,845.62
本期期初	5,671,913.09	-2,549,067.47	3,122,845.62
本期利润	284,384.06	-8,847.12	275,536.94
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,956,297.15	-2,557,914.59	3,398,382.56

嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,038,574.33	-11,604,355.31	11,434,219.02
本期期初	23,038,574.33	-11,604,355.31	11,434,219.02
本期利润	1,143,099.89	-40,226.75	1,102,873.14
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,181,674.22	-11,644,582.06	12,537,092.16

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 1 月 11 日
活期存款利息收入	3,284.64
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	7,143.86

其他	6.87
合计	10,435.37

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

无。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

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 1 月 11 日
债券投资收益——利息收入	1,968,587.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	210,472.51
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	2,179,060.39

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 1 月 11 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	871,634,222.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	861,496,288.43
减：应计利息总额	9,920,261.33
减：交易费用	7,200.00
买卖债券差价收入	210,472.51

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 11 日
国债期货投资收益	-101,591.88

6.4.7.19 股利收益

无。

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 1 月 11 日
1.交易性金融资产	-201,573.87

股票投资	-
债券投资	-201,573.87
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	152,500.00
权证投资	-
期货投资	152,500.00
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	-49,073.87

6.4.7.21 其他收入

无。

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 1 月 11 日
审计费用	1,446.61
信息披露费	3,616.47
证券出借违约金	-
合计	5,063.08

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设	基金托管人

银行”）	

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 1 月 11 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	183,074.91	330,675.30
其中：应支付销售机构的客户维护费	82,543.24	-
应支付基金管理人的净管理费	100,531.67	330,675.30

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 0.22%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：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 0.22%/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 1 月 11 日	上年度可比期间 2025 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

当期发生的基金应支付的托管费	83,215.88	150,306.94

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 1 月 11 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	0.66	0.66
中国建设银行	-	115,894.77	115,894.77
合计	-	115,895.43	115,895.43
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 6 月 10 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	1.20	1.20
中国建设银行	-	209,383.96	209,383.96
合计	-	209,385.16	209,385.16

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.22%，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×0.22%/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

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 1 月 11 日		上年度可比期间 2025年6月10日（基金合同生效日）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
中国建设银行股份有限公司_活期	2,992,020.26	3,284.64	685,399.74	56,432.48

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 1 月 11 日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 1 月 11 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

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 1 月 11 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 187,051,370.64 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
102481702	24 豫航空港 MTN006	2026年1月12日	103.13	204,000	21,038,874.35

102481747	24 豫航空港 MTN007	2026 年 1 月 12 日	103.30	100,000	10,330,105.75
102482345	24 豫航空港 MTN010	2026 年 1 月 12 日	102.12	100,000	10,211,604.93
102482738	24 豫航空港 MTN012	2026 年 1 月 12 日	102.07	108,000	11,023,360.57
102484232	24 豫航空港 MTN020	2026 年 1 月 12 日	101.68	100,000	10,168,443.84
102484375	24 豫航空港 MTN022	2026 年 1 月 12 日	102.95	200,000	20,590,191.78
102584114	25 豫航空港 MTN005	2026 年 1 月 12 日	101.84	100,000	10,184,255.34
232500047	25 四川银行二级资本债	2026 年 1 月 12 日	100.01	462,000	46,206,290.80
2520061	25 徽商银行小微债	2026 年 1 月 12 日	100.09	160,000	16,013,929.21
232400029	24 中原银行二级资本债 01	2026 年 1 月 13 日	101.36	506,000	51,287,009.37
合计				2,040,000	207,054,065.94

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风险管理制度，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 1 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	201,218,356.16	10,085,637.26
合计	201,218,356.16	10,085,637.26

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 1 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	1,252,190,580.08	1,518,841,082.32
AAA 以下	103,999,003.28	313,926,444.93
未评级	1,084,547,266.01	1,109,591,064.60

合计	2,440,736,849.37	2,942,358,591.85

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 1 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	317,411,738.93
AAA 以下	49,994,354.84	49,969,072.58
未评级	-	-
合计	49,994,354.84	367,380,811.51

注：评级取自第三方评级机构。

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 1 月 11 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,992,020.26	-	-	-	2,992,020.26
结算备付金	48,304,396.37	-	-	-	48,304,396.37
存出保证金	18,177.44	-	-	1,940,225.00	1,958,402.44
交易性金融资产	1,154,210,732.87	1,217,000,919.56	320,737,907.94	-	2,691,949,560.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	248,799,852.40	-	-	-	248,799,852.40
应收清算款	-	-	-	5,000,534.17	5,000,534.17
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,454,325,179.34	1,217,000,919.56	320,737,907.94	6,940,759.17	2,999,004,766.01

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	187,051,370.64	-	-	-	187,051,370.64
应付清算款	-	-	-	49,230,304.11	49,230,304.11
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	183,074.91	183,074.91
应付托管费	-	-	-	83,215.88	83,215.88
应付销售服务费	-	-	-	150,072.24	150,072.24
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	192,898.15	192,898.15
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	163,304.60	163,304.60
负债总计	187,051,370.64	-	-	50,002,869.89	237,054,240.53
利率敏感度缺口	1,267,273,808.70	1,217,000,919.56	320,737,907.94	-43,062,110.72	2,761,950,525.48
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	3,714,986.90	-	-	-	3,714,986.90
结算备付金	48,237,419.39	-	-	-	48,237,419.39
存出保证金	120,705.77	-	-	1,949,150.00	2,069,855.77
交易性金融资产	1,249,849,508.69	1,333,507,697.96	736,467,833.97	-	3,319,825,040.62
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	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,301,922,620.75	1,333,507,697.96	736,467,833.97	1,949,150.00	3,373,847,302.68
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	610,713,655.92	-	-	-	610,713,655.92
应付清算款	-	-	-	1,088,931.87	1,088,931.87
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	515,271.64	515,271.64

应付托管费	-	-	-	234,214.41	234,214.41
应付销售服务费	-	-	-	422,393.96	422,393.96
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	151,274.35	151,274.35
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	149,445.13	149,445.13
负债总计	610,713,655.92	-	-	2,561,531.36	613,275,187.28
利率敏感度缺口	691,208,964.83	1,333,507,697.96	736,467,833.97	-612,381.36	2,760,572,115.40

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 1 月 11 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	8,990,568.73	12,755,841.12
	市场利率上升 25 个基点	-8,921,630.68	-12,651,887.11

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 1 月 11 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。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

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 1 月 11 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	-	-
	业绩比较基准下降 5%	-	-

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 1 月 11 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日

第一层次	-	-
第二层次	2,691,949,560.37	3,319,825,040.62
第三层次	-	-
合计	2,691,949,560.37	3,319,825,040.62

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（转型后）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	422,384,726.04	98.57
	其中：债券	422,384,726.04	98.57
	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	5,169,329.32	1.21
8	其他各项资产	937,940.37	0.22
9	合计	428,491,995.73	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

无。

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

无。

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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	2,024,940.27	0.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	123,609,502.47	34.29
	其中：政策性金融债	40,507,638.36	11.24
4	企业债券	183,961,664.11	51.03
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	112,788,619.19	31.28
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	422,384,726.04	117.16

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	250431	25 农发 31	400,000	40,507,638.36	11.24
2	184039	21 乌城 01	300,000	30,830,240.55	8.55
3	115687	23 华综 03	300,000	30,801,348.49	8.54
4	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	200,000	21,618,684.93	6.00
5	102584114	25 豫航空港 MTN005	200,000	20,762,499.73	5.76

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

本基金国债期货操作主要以对冲现有持仓的久期风险为主，基于对利率债市场的判断和曲线形态进行择时套期保值。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货对组合整体风险影响较小，符合既定的投资政策和目标。

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，中国农业发展银行、中原银行股份有限公司、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。

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	862,577.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	75,363.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	937,940.37

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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。

§7 投资组合报告（转型前）

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,691,949,560.37	89.76
	其中：债券	2,691,949,560.37	89.76
	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	248,799,852.40	8.30
	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	51,296,416.63	1.71
8	其他各项资产	6,958,936.61	0.23
9	合计	2,999,004,766.01	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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

无。

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	349,212,189.61	12.64
2	央行票据	-	-
3	金融债券	592,558,598.90	21.45
	其中：政策性金融债	241,759,167.12	8.75
4	企业债券	1,556,434,589.63	56.35
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	143,749,827.39	5.20
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	49,994,354.84	1.81
9	其他	-	-
10	合计	2,691,949,560.37	97.47

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	250306	25 进出 06	2,000,000	201,218,356.16	7.29
2	250005	25 附息国债 05	1,400,000	141,981,287.67	5.14
3	240024	24 附息国债 24	1,000,000	99,871,315.07	3.62
4	232380026	23 厦门国际二级资本债 01	900,000	95,752,479.45	3.47
5	241044	24 津投 14	900,000	92,176,964.39	3.34

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

本基金国债期货操作主要以对冲现有持仓的久期风险为主，基于对利率债市场的判断和曲线形态进行择时套期保值。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货对组合整体风险影响较小，符合既定的投资政策和目标。

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，中国进出口银行、厦门国际银行股份有限公司、中原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	1,958,402.44
2	应收清算款	5,000,534.17
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,958,936.61

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

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（转型后）

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（%）
嘉实汇明纯债债券 A	751	122,139.88	-	-	91,727,049.88	100.00
嘉实汇明纯债债券 C	2,340	111,827.33	-	-	261,675,947.96	100.00
合计	3,043	116,136.38	-	-	353,402,997.84	100.00

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	嘉实汇明纯债债券 A	10.99	0.00
	嘉实汇明纯债债券 C	10,017.59	0.00
	合计	10,028.58	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	嘉实汇明纯债债券 A	0
	嘉实汇明纯债债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实汇明纯债债券 A	0
	嘉实汇明纯债债券 C	0
	合计	0

§8 基金份额持有人信息（转型前）

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（%）
嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	1,832	269,928.79	-	-	494,509,547.87	100.00
嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C	6,255	359,952.92	4,603,599.42	0.20	2,246,901,903.47	99.80
合计	7,989	343,724.50	4,603,599.42	0.17	2,741,411,451.34	99.83

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	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	10.99	0.00
	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C	10,017.59	0.00
	合计	10,028.58	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	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	0
	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	0

	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	嘉实汇明纯债债券 A	嘉实汇明纯债债券 C
基金合同生效日（2026 年 1 月 12 日）基金份额总额	494,509,547.87	2,251,505,502.89
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	40,302,110.34	555,461,093.83
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	443,084,608.33	2,545,290,648.76
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	91,727,049.88	261,675,947.96

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。

§9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 A	嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债 C
基金合同生效日（2025 年 6 月 10 日）基金份额总额	494,509,547.87	2,251,505,502.89
本报告期期初基金份额总额	494,509,547.87	2,251,505,502.89
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	494,509,547.87	2,251,505,502.89

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

本基金管理人于 2026 年 01 月 10 日发布了《关于嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金封闭运作期届满转为开放式运作、变更基金名称并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》，根据基金合同的约定，本基金的封闭运作期将于 2026 年 1 月 11 日届满，自 2026 年 1 月 12 日起，本基金转为开放式运作，在每个开放日的开放时间办理基金的申购和赎回业务，基金名称相应变更为“嘉实汇明纯债债券型证券投资基金”，基金简称变更为“嘉实汇明纯债债券”，基金代码不变。嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金变更为开放式基金后，基金的费率、投资范围、投资策略等均不变，并适用基金合同中关于转为开放式运作后的有关规定。

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，本基金托管人的托管业务部门无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，本基金托管人相关从业人员无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(转型后)

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(%)	
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	新增
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
国元证券	1	-	-	-	-	新增

股份有限公司						
华福证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	新增
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
银泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	新增
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	新增
中信建投证券股份有限公司	6	-	-	-	-	新增
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	新增

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。

3.报告期内，本基金退租以下交易单元：国泰海通证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

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(%)
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	80,749,240.00	6.36	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	1,079,052,190.60	84.98	1,094,253,000.00	100.00	-	-
申万宏源证券有限公司	110,000,000.00	8.66	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-

中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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(转型前)

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(%)	
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	2	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	6	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	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。

3.报告期内，本基金退租以下交易单元：国泰海通证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

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(%)
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
开源证券股份有限公司	4,730,698.49	100.00	921,000,000.00	100.00	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实汇明纯债债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	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 1 月 12 日
2	关于嘉实汇明纯债债券型证券投资基金 2026 年春节前暂停申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	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 2 月 10 日
3	关于嘉实汇明纯债债券型证券投资基金 2026 年劳动节前暂停申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	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 4 月 27 日
4	关于嘉实汇明纯债债券型证券投资基金 2026 年端午节前暂停申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	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 15 日
5	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	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
6	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

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金封闭运作期届满转为开放式运作、变更基金名称并修改基金合同、托管协议部分条款的公告	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 1 月 10 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汇明 7 个月封闭运作纯债债券型证券投资基金注册的批复文件。

（2）《嘉实汇明纯债债券型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实汇明纯债债券型证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实汇明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）报告期内嘉实汇明纯债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