

嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券  
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 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                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 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 | 12        |
| 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       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>36</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 36        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 37        |
| 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       | 37        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 37        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 37        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 .....    | 37        |
| 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 ..... | 38        |
| 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 ..... | 38        |
| 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 .....    | 38        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 38        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 38        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>39</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 39        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 39        |
| 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 .....      | 39        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>40</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>40</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 40        |
| 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 .....      | 40        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 40        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 40        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 41        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 41        |
| 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 .....      | 42        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 44        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>45</b> |
| 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 .....    | 45        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>45</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 45        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 45        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 45        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                           |                    |
|-----------------|---------------------------|--------------------|
| 基金名称            | 嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金 |                    |
| 基金简称            | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券          |                    |
| 基金主代码           | 008338                    |                    |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                    |                    |
| 基金合同生效日         | 2019 年 12 月 9 日           |                    |
| 基金管理人           | 嘉实基金管理有限公司                |                    |
| 基金托管人           | 上海浦东发展银行股份有限公司            |                    |
| 报告期末基金份额总额      | 16,660,289,021.99 份       |                    |
| 基金合同存续期         | 不定期                       |                    |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A        | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 008338                    | 008339             |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,660,269,011.00 份       | 20,010.99 份        |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 投资策略   | <p>（一）封闭期投资策略</p> <p>在封闭期内，本基金将在坚持组合久期与封闭期基本匹配的原则下，采用买入并持有到期策略构建投资组合，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。一般情况下，本基金持有的债券品种和结构在封闭期内不会发生变化。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。具体包括如下策略：类属配置策略、信用债券投资策略（个别债券选择、行业配置、信用风险控制措施）、杠杆投资策略、资产支持证券投资策略、现金管理策略。</p> <p>（二）开放期投资策略</p> <p>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 | 每个封闭期起始日的中国人民银行公布并执行的金融机构三年定期存款利率（税后）+1.5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |

|        |                                            |
|--------|--------------------------------------------|
| 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。 |
|--------|--------------------------------------------|

## 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                            | 上海浦东发展银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 郭松                                    | 汪小敏                   |
|             | 联系电话 | (010)65215588                         | 021-31888888          |
|             | 电子邮箱 | service@jsfund.cn                     | wangxm8@spdb.com.cn   |
| 客户服务电话      |      | 400-600-8800                          | 95528                 |
| 传真          |      | (010)65215588                         | 021-63602540          |
| 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    | 上海市中山东一路 12 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 | 上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋 |
| 邮政编码        |      | 100020                                | 200126                |
| 法定代表人       |      | 经雷                                    | 张为忠                   |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                                                         |
|-------------------|---------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《证券时报》                                                  |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 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<br>据和指标 | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                    |
|-------------------|-------------------------------------|--------------------|
|                   | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A                  | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C |
| 本期已实现收益           | 185,854,225.37                      | 186.38             |
| 本期利润              | 185,854,225.37                      | 186.38             |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | 0.0114                              | 0.0093             |

|                   |                       |           |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 1.12%                 | 0.91%     |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 1.12%                 | 0.93%     |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |           |
| 期末可供分配利<br>润      | 97,637,782.60         | 97.24     |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | 0.0059                | 0.0049    |
| 期末基金资产净<br>值      | 16,757,906,793.60     | 20,108.23 |
| 期末基金份额净<br>值      | 1.0059                | 1.0049    |
| 3.1.3 累计期<br>末指标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |           |
| 基金份额累计净<br>值增长率   | 20.35%                | 17.28%    |

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

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A

| 阶段    | 份额净<br>值增长<br>率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|-------|------------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 0.42%            | 0.01%               | 1.04%          | 0.01%                 | -0.62% | 0.00%  |
| 过去六个月 | 1.12%            | 0.01%               | 2.09%          | 0.02%                 | -0.97% | -0.01% |
| 过去一年  | 2.58%            | 0.01%               | 4.25%          | 0.01%                 | -1.67% | 0.00%  |
| 过去三年  | 8.35%            | 0.01%               | 13.31%         | 0.01%                 | -4.96% | 0.00%  |
| 过去五年  | 14.95%           | 0.01%               | 23.15%         | 0.01%                 | -8.20% | 0.00%  |

|                |        |       |        |       |             |       |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------------|-------|
| 自基金合同生效起<br>至今 | 20.35% | 0.01% | 31.42% | 0.01% | -11.07<br>% | 0.00% |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------------|-------|

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③         | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|-------------|--------|
| 过去三个月          | 0.34%        | 0.01%               | 1.04%          | 0.01%                 | -0.70%      | 0.00%  |
| 过去六个月          | 0.93%        | 0.01%               | 2.09%          | 0.02%                 | -1.16%      | -0.01% |
| 过去一年           | 2.18%        | 0.01%               | 4.25%          | 0.01%                 | -2.07%      | 0.00%  |
| 过去三年           | 7.10%        | 0.01%               | 13.31%         | 0.01%                 | -6.21%      | 0.00%  |
| 过去五年           | 12.71%       | 0.01%               | 23.15%         | 0.01%                 | -10.44<br>% | 0.00%  |
| 自基金合同生效起<br>至今 | 17.28%       | 0.01%               | 31.42%         | 0.01%                 | -14.14<br>% | 0.00%  |

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：

$$\text{Return}(t) = (1 + \text{中国人民银行公布并执行的金融机构三年期定期存款利率(税后)} + 1.5\%)^{(1/365)} - 1$$

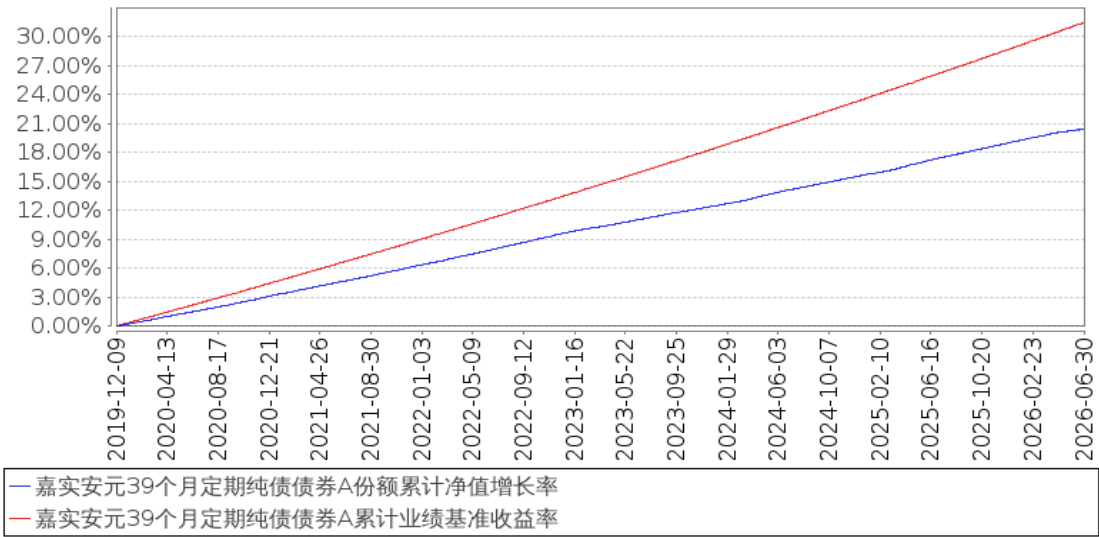
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

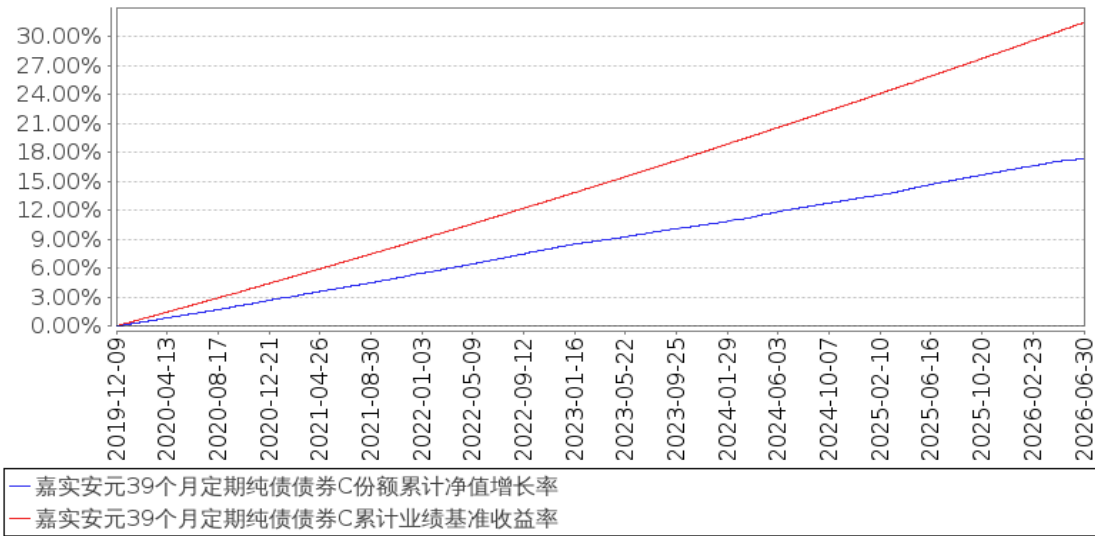
嘉实安元39个月定期纯债债券A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年12月09日至2026年06月30日)



嘉实安元39个月定期纯债债券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

(2019年12月09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<br>（助理）期限 |      | 证券从<br>业年限 | 说明                                            |
|---------|--------------|---------------------|------|------------|-----------------------------------------------|
|         |              | 任职日期                | 离任日期 |            |                                               |
| 李卓<br>锴 | 本基金、<br>嘉实多元 | 2021 年<br>10 月 16   | -    | 17 年       | 曾任职于国家开发银行资金局，从事债券<br>投资工作。2017 年 12 月加入嘉实基金管 |

|                                                                |   |  |  |                                               |
|----------------------------------------------------------------|---|--|--|-----------------------------------------------|
| 债券、嘉实新思路混合、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实稳福混合、嘉实双季瑞享 6 个月持有债券基金经理 | 日 |  |  | 理有限公司任配置策略组投资经理，现任策略投资总监。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、《嘉实安元 39 个月定期开放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

2026 年宏观经济运行总体平稳。1 季度表现好于预期，2 季度顶住下行压力，经济增长处在合理区间，高质量发展取得成效。上半年实际 GDP 增长 4.7%，外贸保持高景气状态，国内生产明显改善，外贸连续实现两位数增长。“稳增长”政策积极有为，今年上半年内需表现较去年下半年有所改善。外部不确定、不稳定因素增多，中东地缘冲突不断反复，美联储“换帅”过渡期偏长，市场对美国货币政策立场的预期以鹰派为主，发达国家市场波动加大。

2026 年上半年债券市场表现较好。1 季度银行负债端压力缓解，银行间资金利率维持低位，配置盘买入力量积极，10 年及以下品种表现亮眼。进入 2 季度，随着信贷增速下降，市场做多热情进一步显现，长债和超长债收益率稳步下行。

投资运作方面，本基金按照摊余成本法估值。1 季度主要根据资金面变化灵活调配回购期限，降低组合融资成本。6 月 24 日进入下一个运作期。6 月 15 日以前，资产逐步到期，杠杆水平有所下降。组合通过增配逆回购、同业存单等方式，积极管理现金资产。6 月 24 日之后，组合根据市场情况，有序开展新一期资产配置工作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A 基金份额净值为 1.0059 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.12%；截至本报告期末嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C 基金份额净值为 1.0049 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.93%；业绩比较基准收益率为 2.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，我们预计国内经济仍将运行在合理区间。“稳增长”政策保持战略定力，政策出台以落实存量为主。财政政策方面，加快存量政府债券发行，择机出台落地政策性金融工具，“稳投资”值得期待。货币政策方面，预计仍将延续适度宽松基调，与财政政策更好协同，继续运用公开市场、买断式逆回购、MLF 等一系列货币政策工具组合，保持流动性充裕，银行间回购利率围绕政策利率波动。在外部风险上升阶段，不排除及时降准降息抵御经济下行压力，稳定资本市场信心。总体来看，下半年宏观环境对债市有利，债券收益率有望震荡下行，积极关注超长债利差压缩的机会。

#### 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，本基金实施了利润分配，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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在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

本报告期内，由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：嘉实安元 39 个月定期开放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<br>2026 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>   |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 7,419,125,541.30               | 934,037.82                       |
| 结算备付金         |            | 273,073,891.85                 | 244,204,910.03                   |
| 存出保证金         |            | -                              | -                                |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | -                              | -                                |
| 其中：股票投资       |            | -                              | -                                |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | -                              | -                                |
| 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    | 6,600,273,314.39               | -                                |
| 债权投资          | 6.4.7.5    | 2,469,002,879.49               | 26,065,860,975.22                |
| 其中：债券投资       |            | 2,469,002,879.49               | 26,065,860,975.22                |
| 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         |            | -                              | 66,225.61                        |
| 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          |            | 16,761,475,627.03              | 26,311,066,148.68                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2025 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 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     |            | -                              | 9,598,268,546.35                 |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬       |            | 2,525,072.13                   | 2,834,726.12                     |
| 应付托管费         |            | 631,268.04                     | 708,681.51                       |
| 应付销售服务费       |            | 6.60                           | 6.82                             |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 1,287.86                       | -                                |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |

|             |          |                   |                   |
|-------------|----------|-------------------|-------------------|
| 递延所得税负债     |          | -                 | -                 |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 391,090.57        | 435,734.56        |
| 负债合计        |          | 3,548,725.20      | 9,602,247,695.36  |
| <b>净资产：</b> |          |                   |                   |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 16,660,289,021.99 | 16,500,771,293.64 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -                 | -                 |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 97,637,879.84     | 208,047,159.68    |
| 净资产合计       |          | 16,757,926,901.83 | 16,708,818,453.32 |
| 负债和净资产总计    |          | 16,761,475,627.03 | 26,311,066,148.68 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A 基金份额净值 1.0059 元，基金份额总额 16,660,269,011.00 份，嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C 基金份额净值 1.0049 元，基金份额总额 20,010.99 份，基金份额总额合计为 16,660,289,021.99 份。

### 6.2 利润表

会计主体：嘉实安元 39 个月定期开放纯债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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| <b>一、营业总收入</b>        |          | 233,693,176.21                           | 351,729,448.69                                |
| 1. 利息收入               |          | 233,693,176.21                           | 351,729,448.69                                |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.13 | 3,739,973.23                             | 346,945.68                                    |
| 债券利息收入                |          | 206,392,303.87                           | 351,382,503.01                                |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                                        | -                                             |
| 买入返售金融资产收入            |          | 23,560,899.11                            | -                                             |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）     |          | -                                        | -                                             |
| 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 | -                                        | -                                             |
| 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 | -                                        | -                                             |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 |          | -                                        | -                                             |

|                            |                |                |                |
|----------------------------|----------------|----------------|----------------|
| 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    | -              | -              |
| 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    | -              | -              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |                | 47,838,764.46  | 108,215,921.82 |
| 1. 管理人报酬                   | 6. 4. 10. 2. 1 | 16,425,382.02  | 16,606,514.65  |
| 2. 托管费                     | 6. 4. 10. 2. 2 | 4,106,345.59   | 4,151,628.71   |
| 3. 销售服务费                   | 6. 4. 10. 2. 3 | 39.82          | 39.82          |
| 4. 投资顾问费                   |                | -              | -              |
| 5. 利息支出                    |                | 27,757,102.12  | 87,594,377.40  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |                | 27,757,102.12  | 87,594,377.40  |
| 6. 信用减值损失                  | 6. 4. 7. 22    | -577,112.57    | -255,702.31    |
| 7. 税金及附加                   |                | 222.75         | -              |
| 8. 其他费用                    | 6. 4. 7. 23    | 126,784.73     | 119,063.55     |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |                | 185,854,411.75 | 243,513,526.87 |
| 减：所得税费用                    |                | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |                | 185,854,411.75 | 243,513,526.87 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |                | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |                | 185,854,411.75 | 243,513,526.87 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实安元 39 个月定期开放纯债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<br>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            | 16,500,771,293.64                     | -      | 208,047,159.68  | 16,708,818,453.32 |
| 二、本期期初净资产            | 16,500,771,293.64                     | -      | 208,047,159.68  | 16,708,818,453.32 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 159,517,728.35                        | -      | -110,409,279.84 | 49,108,448.51     |

|                                          |                                            |        |                 |                   |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|-----------------|-------------------|
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 185,854,411.75  | 185,854,411.75    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | 159,517,728.35                             | -      | 750,135.33      | 160,267,863.68    |
| 其中：1. 基金申购款                              | 7,060,045,508.00                           | -      | 40,083,143.90   | 7,100,128,651.90  |
| 2. 基金赎回款                                 | -6,900,527,779.65                          | -      | -39,333,008.57  | -6,939,860,788.22 |
| (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) | -                                          | -      | -297,013,826.92 | -297,013,826.92   |
| 四、本期期末净资产                                | 16,660,289,021.99                          | -      | 97,637,879.84   | 16,757,926,901.83 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 16,500,771,293.64                          | -      | 301,577,202.04  | 16,802,348,495.68 |
| 二、本期期初净资产                                | 16,500,771,293.64                          | -      | 301,577,202.04  | 16,802,348,495.68 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -                                          | -      | -60,100,606.45  | -60,100,606.45    |
| (一)、综合收益总额                               | -                                          | -      | 243,513,526.87  | 243,513,526.87    |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数<br>(净资产减少以“-”号填列)  | -                                          | -      | -               | -                 |
| 其中：1. 基金申购款                              | -                                          | -      | -               | -                 |
| 2. 基金赎回款                                 | -                                          | -      | -               | -                 |

|                                          |                   |   |                 |                   |
|------------------------------------------|-------------------|---|-----------------|-------------------|
| 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) | -                 | - | -303,614,133.32 | -303,614,133.32   |
| 四、本期期末净资产                                | 16,500,771,293.64 | - | 241,476,595.59  | 16,742,247,889.23 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷  
基金管理人负责人

梁凯  
主管会计工作负责人

李袁  
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实安元 39 个月定期开放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[2019]2324 号《关于准予嘉实安元 39 个月定期开放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《嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 20,201,221,207.18 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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

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[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。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，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。

(4) 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 7,419,125,541.30       |
| 等于：本金          | 7,418,668,508.09       |
| 加：应计利息         | 457,033.21             |
| 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             | 7,419,125,541.30       |

6.4.7.2 交易性金融资产

无。

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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | -                      | -         |
| 银行间市场 | 6,600,273,314.39       | -         |
| 合计    | 6,600,273,314.39       | -         |

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

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |               |               |        |                  |
|--------|-------|------------------------|---------------|---------------|--------|------------------|
|        |       | 初始成本                   | 利息调整          | 应计利息          | 减：减值准备 | 账面价值             |
| 债券     | 交易所市场 | -                      | -             | -             | -      | -                |
|        | 银行间市场 | 2,350,000,000.00       | 78,836,158.94 | 40,166,720.55 | -      | 2,469,002,879.49 |
|        | 小计    | 2,350,000,000.00       | 78,836,158.94 | 40,166,720.55 | -      | 2,469,002,879.49 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -             | -             | -      | -                |
| 其他     |       | -                      | -             | -             | -      | -                |
| 合计     |       | 2,350,000,000.00       | 78,836,158.94 | 40,166,720.55 | -      | 2,469,002,879.49 |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备      | 第一阶段           | 第二阶段                 | 第三阶段                 | 合计         |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|------------|
|           | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) |            |
| 期初余额      | 577,112.57     | -                    | -                    | 577,112.57 |
| 本期从其他阶段转入 | -              | -                    | -                    | -          |
| 本期转出至其他阶段 | -              | -                    | -                    | -          |

|      |            |   |   |            |
|------|------------|---|---|------------|
| 本期新增 | 138,358.53 | - | - | 138,358.53 |
| 本期转回 | 715,471.10 | - | - | 715,471.10 |
| 其他变动 | -          | - | - | -          |
| 期末余额 | -          | - | - | -          |

#### 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<br>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      | 297,862.90             |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 297,862.90             |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 93,227.67              |
| 合计          | 391,090.57             |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A

| 项目   | 本期<br>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 | 16,500,751,181.67                     | 16,500,751,181.67 |
| 本期申购 | 7,060,045,508.00                      | 7,060,045,508.00  |

|               |                   |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,900,527,678.67 | -6,900,527,678.67 |
| 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           | 16,660,269,011.00 | 16,660,269,011.00 |

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C

| 项目            | 本期<br>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          | 20,111.97                             | 20,111.97 |
| 本期申购          | -                                     | -         |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -100.98                               | -100.98   |
| 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           | 20,010.99                             | 20,010.99 |

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

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 上年度末           | 208,046,941.65  | -     | 208,046,941.65  |
| 本期期初           | 208,046,941.65  | -     | 208,046,941.65  |
| 本期利润           | 185,854,225.37  | -     | 185,854,225.37  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 750,135.33      | -     | 750,135.33      |
| 其中：基金申购款       | 40,083,143.90   | -     | 40,083,143.90   |
| 基金赎回款          | -39,333,008.57  | -     | -39,333,008.57  |
| 本期已分配利润        | -297,013,519.75 | -     | -297,013,519.75 |
| 本期末            | 97,637,782.60   | -     | 97,637,782.60   |

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C

| 项目             | 已实现部分  | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------|-------|---------|
| 上年度末           | 218.03 | -     | 218.03  |
| 本期期初           | 218.03 | -     | 218.03  |
| 本期利润           | 186.38 | -     | 186.38  |
| 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  | -307.17 | - | -307.17 |
| 本期末      | 97.24   | - | 97.24   |

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  | 1,862,841.28                    |  |
| 定期存款利息收入  | 1,600,000.00                    |  |
| 其他存款利息收入  | -                               |  |
| 结算备付金利息收入 | 277,131.95                      |  |
| 其他        | -                               |  |
| 合计        | 3,739,973.23                    |  |

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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

无。

6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
| 银行存款     | -                               |
| 买入返售金融资产 | -                               |

|        |             |
|--------|-------------|
| 债权投资   | -577,112.57 |
| 其他债权投资 | -           |
| 其他     | -           |
| 合计     | -577,112.57 |

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用      | 33,720.30                             |
| 信息披露费     | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金   | -                                     |
| 银行划款手续费   | 14,957.06                             |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00                             |
| 其他        | 600.00                                |
| 合计        | 126,784.73                            |

#### 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   |
| 上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”） | 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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   | 16,425,382.02                         | 16,606,514.65                              |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 23,509.22                             | -                                          |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 16,401,872.80                         | 16,606,514.65                              |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>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 | 4,106,345.59                          | 4,151,628.71                               |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/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<br>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                      |                        |    |
|                | 嘉实安元 39 个月定期<br>纯债债券 A                | 嘉实安元 39 个月定期<br>纯债债券 C | 合计 |

|                |                                 |                        |       |
|----------------|---------------------------------|------------------------|-------|
| 嘉实基金管理有限公司     | -                               | 39.82                  | 39.82 |
| 合计             | -                               | 39.82                  | 39.82 |
| 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                |                        |       |
|                | 嘉实安元 39 个月定期<br>纯债债券 A          | 嘉实安元 39 个月定期<br>纯债债券 C | 合计    |
| 嘉实基金管理有限公司     | -                               | 39.82                  | 39.82 |
| 合计             | -                               | 39.82                  | 39.82 |

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期                              |                |      |       |      |              |            |
|---------------------------------|----------------|------|-------|------|--------------|------------|
| 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |      |       |      |              |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称                  | 债券交易金额         |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购        |            |
|                                 | 基金买入           | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额         | 利息支出       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司                  | 190,610,216.30 | -    | -     | -    | 1,220,000.00 | 47,881.12  |
| 上年度可比期间                         |                |      |       |      |              |            |
| 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |      |       |      |              |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称                  | 债券交易金额         |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购        |            |
|                                 | 基金买入           | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额         | 利息支出       |
| 上海浦东发展银行股份有限公司                  | -              | -    | -     | -    | 2,175,000.00 | 121,853.48 |

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

份额单位：份

嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                             | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                             |
|-------|------------------------|-----------------------------|--------------------------|-----------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额            | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的<br>基金份额              | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例<br>（%） |
| 浦发银行  | 3,696,030,619.77       | 22.18                       | 2,999,999,000.00         | 18.18                       |

注：除基金管理人以外的其他关联方投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |              | 上年度可比期间<br>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    |
| 上海浦东发展银行股份有限公司_活期 | 7,419,125,541.30                      | 1,862,841.28 | 758,673.10                                 | 22,955.73 |

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

单位：人民币元

| 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A |                |     |                |                       |                      |                   |                  |    |
|--------------------|----------------|-----|----------------|-----------------------|----------------------|-------------------|------------------|----|
| 序号                 | 权益<br>登记日      | 除息日 |                | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计 | 备注 |
|                    |                | 场内  | 场外             |                       |                      |                   |                  |    |
| 1                  | 2026 年 6 月 2 日 | -   | 2026 年 6 月 2 日 | 0.1800                | 297,013,519.75       | -                 | 297,013,519.75   | -  |
| 合计                 | -              | -   | -              | 0.1800                | 297,013,519.75       | -                 | 297,013,519.75   | -  |
| 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C |                |     |                |                       |                      |                   |                  |    |
| 序号                 | 权益<br>登记日      | 除息日 |                | 每 10 份基<br>金份额分<br>红数 | 现金形<br>式<br>发放总<br>额 | 再投资形<br>式<br>发放总额 | 本期利<br>润分配<br>合计 | 备注 |
|                    |                | 场内  | 场外             |                       |                      |                   |                  |    |

|    |                |   |                |        | 额      |   |        |   |
|----|----------------|---|----------------|--------|--------|---|--------|---|
| 1  | 2026 年 6 月 2 日 | - | 2026 年 6 月 2 日 | 0.1530 | 307.17 | - | 307.17 | - |
| 合计 | -              | - | -              | 0.1530 | 307.17 | - | 307.17 | - |

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会合规与风险控制委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程

度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级 AA 级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至 C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | —                      | 5,360,875,259.51         |
| AAA 以下 | —                      | —                        |
| 未评级    | 2,469,002,879.49       | 20,704,985,715.71        |
| 合计     | 2,469,002,879.49       | 26,065,860,975.22        |

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<br>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                   | 7,419,125,541.30  | -                | -     | -            | 7,419,125,541.30  |
| 结算备付金                  | 273,073,891.85    | -                | -     | -            | 273,073,891.85    |
| 存出保证金                  | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 交易性金融资产                | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 衍生金融资产                 | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 买入返售金融资产               | 6,600,273,314.39  | -                | -     | -            | 6,600,273,314.39  |
| 应收清算款                  | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 债权投资                   | -                 | 2,469,002,879.49 | -     | -            | 2,469,002,879.49  |
| 应收股利                   | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 应收申购款                  | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 递延所得税资产                | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 其他资产                   | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 资产总计                   | 14,292,472,747.54 | 2,469,002,879.49 | -     | -            | 16,761,475,627.03 |
| 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              | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 应付清算款                  | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 应付赎回款                  | -                 | -                | -     | -            | -                 |
| 应付管理人报酬                | -                 | -                | -     | 2,525,072.13 | 2,525,072.13      |
| 应付托管费                  | -                 | -                | -     | 631,268.04   | 631,268.04        |
| 应付销售服务费                | -                 | -                | -     | 6.60         | 6.60              |
| 应付投资顾问费                | -                 | -                | -     | -            | -                 |

|                          |                   |                  |       |               |                   |
|--------------------------|-------------------|------------------|-------|---------------|-------------------|
| 应交税费                     | -                 | -                | -     | 1,287.86      | 1,287.86          |
| 应付利润                     | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 递延所得税负债                  | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 其他负债                     | -                 | -                | -     | 391,090.57    | 391,090.57        |
| 负债总计                     | -                 | -                | -     | 3,548,725.20  | 3,548,725.20      |
| 利率敏感度缺口                  | 14,292,472,747.54 | 2,469,002,879.49 | -     | -3,548,725.20 | 16,757,926,901.83 |
| 上年度末<br>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                     | 934,037.82        | -                | -     | -             | 934,037.82        |
| 结算备付金                    | 244,204,910.03    | -                | -     | -             | 244,204,910.03    |
| 存出保证金                    | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 交易性金融资产                  | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 衍生金融资产                   | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 买入返售金融资产                 | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 应收清算款                    | -                 | -                | -     | 66,225.61     | 66,225.61         |
| 债权投资                     | 26,065,860,975.22 | -                | -     | -             | 26,065,860,975.22 |
| 应收股利                     | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 应收申购款                    | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 递延所得税资产                  | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 其他资产                     | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 资产总计                     | 26,310,999,923.07 | -                | -     | 66,225.61     | 26,311,066,148.68 |
| 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                | 9,598,268,546.35  | -                | -     | -             | 9,598,268,546.35  |
| 应付清算款                    | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 应付赎回款                    | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 应付管理人报酬                  | -                 | -                | -     | 2,834,726.12  | 2,834,726.12      |
| 应付托管费                    | -                 | -                | -     | 708,681.51    | 708,681.51        |
| 应付销售服务费                  | -                 | -                | -     | 6.82          | 6.82              |
| 应付投资顾问费                  | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 应交税费                     | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 应付利润                     | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 递延所得税负债                  | -                 | -                | -     | -             | -                 |
| 其他负债                     | -                 | -                | -     | 435,734.56    | 435,734.56        |
| 负债总计                     | 9,598,268,546.35  | -                | -     | 3,979,149.01  | 9,602,247,695.36  |
| 利率敏感度缺口                  | 16,712,731,376    | -                | -     | -3,912,923.40 | 16,708,818,453.32 |

|  |     |  |  |  |  |
|--|-----|--|--|--|--|
|  | .72 |  |  |  |  |
|--|-----|--|--|--|--|

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

无重大影响。

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。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）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |

|  |          |   | 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

无。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于本报告期末，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具(上年度末：同)。

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等。

除债权投资以外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值差异很小。

于本报告期末，本基金持有的债权投资的账面价值为 2,469,002,879.49 元，公允价值为 2,470,159,720.55 元(上年度末：本基金持有的债权投资的账面价值为 26,065,860,975.22 元，公允价值为 26,164,011,327.28 元)。

债权投资按如下原则确定公允价值：(i) 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。(ii) 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。(iii) 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。

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》的有关规定，本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；本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。于本报告期末，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次(上年度末：同)。

#### 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              | -                | -             |
|    | 其中：股票             | -                | -             |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 2,469,002,879.49 | 14.73         |
|    | 其中：债券             | 2,469,002,879.49 | 14.73         |
|    | 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          | 6,600,273,314.39 | 39.38         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -             |

|   |              |                   |        |
|---|--------------|-------------------|--------|
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 7,692,199,433.15  | 45.89  |
| 8 | 其他各项资产       | -                 | -      |
| 9 | 合计           | 16,761,475,627.03 | 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      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,469,002,879.49 | 14.73        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,469,002,879.49 | 14.73        |
| 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        | 2,469,002,879.49 | 14.73        |

注：上表中，附息债券的成本包括债券面值和折溢价，贴现式债券的成本包括债券投资成本和内在应收利息。

## 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  | 240208 | 24 国开 08 | 6,900,000 | 710,143,224.36 | 4.24         |
| 2  | 240415 | 24 农发 15 | 6,600,000 | 678,890,088.82 | 4.05         |
| 3  | 190215 | 19 国开 15 | 6,100,000 | 664,158,501.38 | 3.96         |
| 4  | 190210 | 19 国开 10 | 3,900,000 | 415,811,064.93 | 2.48         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 只债券。

**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，中国农业发展银行、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。

**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**  
无。

**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

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<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额       | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 嘉实安元<br>39 个月定<br>期纯债债<br>券 A | 236              | 70,594,360.22 | 16,660,134,008.98 | 100.00            | 135,002.02 | 0.00              |
| 嘉实安元<br>39 个月定<br>期纯债债<br>券 C | 3                | 6,670.33      | -                 | -                 | 20,010.99  | 100.00            |
| 合计                            | 239              | 69,708,322.27 | 16,660,134,008.98 | 100.00            | 155,013.01 | 0.00              |

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<br>理人所有从业<br>人员持<br>有本基<br>金 | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A | 1.00      | 0.00        |
|                                  | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C | 0.99      | 0.00        |
|                                  | 合计                 | 1.99      | 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 | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 A | 0                 |
|                                | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券 C | 0                 |

|                     |                        |   |
|---------------------|------------------------|---|
|                     | 合计                     | 0 |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 嘉实安元 39 个月定期纯债<br>债券 A | 0 |
|                     | 嘉实安元 39 个月定期纯债<br>债券 C | 0 |
|                     | 合计                     | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                             | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券<br>A | 嘉实安元 39 个月定期纯债债券<br>C |
|--------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 12 月 9 日）基金份额总额 | 20,201,200,197.18     | 21,010.00             |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 16,500,751,181.67     | 20,111.97             |
| 本报告期基金总申购份额                    | 7,060,045,508.00      | -                     |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 6,900,527,678.67      | 100.98                |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                     | -                     |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 16,660,269,011.00     | 20,010.99             |

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  
报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为容诚会计师事务所（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

报告期内，托管人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

报告期内，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

## 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(%) |    |
| 渤海证券股份有限公司   | 1      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 长江证券股份有限公司   | 1      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 东吴证券股份有限公司   | 2      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 1      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 华泰证券股份有限公司   | 1      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 江海证券有限公司     | 1      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 申万宏源证券有限公司   | 2      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 招商证券股份有限公司   | 2      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 浙商证券股份有限公司   | 2      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 中国国际金融股份有限公司 | 1      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 中国银河证券股份有限公司 | 2      | —    | —               | —         | —             | —  |
| 中信建投证券股份有限公司 | 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：渤海证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国泰海通证券股份有限公司退租交易单元 1 个。浙商证券股份有限公司退租交易单元 2 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 (%) |
| 渤海证券股份有限公司   | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                |
| 长江证券股份有限公司   | -    | -                | 212,276,400,000.00 | 100.00             | -    | -                |
| 东吴证券股份有限公司   | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                |
| 国泰海通证券股份有限公司 | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                |
| 华泰证券股份有限公司   | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                |
| 江海证券有限       | -    | -                | -                  | -                  | -    | -                |

| 公司           |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源证券有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

### 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关于修订旗下部分基金托管协议清算交收条款的公告                | 证券时报、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 25 日 |
| 2  | 嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金 2026 年第一次收益分配公告        | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 5 月 29 日 |
| 3  | 关于嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金第二个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告 | 证券时报、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 12 日 |
| 4  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                             | 证券时报、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 2026-06-30 | 4,499,999,000.00 | 2,286,964,303.47 | -    | 6,786,963,303.47 | 40.74   |
|       | 2              | 2026-06-17 至 2026-06-23 | 2,999,999,000.00 | -                | -    | 2,999,999,000.00 | 18.01   |

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安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实安元 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实安元 39 个月定期开放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) 报告期内嘉实安元 39 个月定期开放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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日