

嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 1 月 21 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金由原嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金变更而来。

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

本报告期中的财务资料未经审计。

嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金报告期自 2020 年 12 月 9 日起至 2020 年 12 月 31 日止，原嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金报告期自 2017 年 3 月 23 日起至 2020 年 12 月 8 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

基金简称	嘉实稳骏纯债债券
基金主代码	003880
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 9 日
报告期末基金份额总额	57,588,963.51 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。具体包括债券投资策略（含利率策略、信用债券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略），资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债综合全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

2.1 基金基本情况（转型前）

基金简称	嘉实定期宝 6 个月理财债券	
基金主代码	003880	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 23 日	
报告期末基金份额总额	269,033,541.87 份	
投资目标	在有效控制风险和保持适当流动性的基础上，力求获得高于业绩比较基准的稳定回报。	
投资策略	<p>本基金根据宏观经济运行状况、政策形势、信用状况、利率走势、资金供求变化等的综合判断，并结合各类资产的估值水平、流动性特征、风险收益特征，决定各类资产的配置比例，并适时进行动态调整。</p> <p>主要投资策略包括：资产配置策略、期限配置策略、个券选择策略、利用短期市场机会的灵活策略、其他衍生工具投资策略。</p>	
业绩比较基准	中国人民银行公布的 6 个月定期存款基准利率（税后）	
风险收益特征	本基金为理财债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B
下属分级基金的交易代码	003880	003881
报告期末下属分级基金的份额总额	7,866,320.61 份	261,167,221.26 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 12 月 9 日-2020 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	50,640.94
2. 本期利润	54,660.94
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0003
4. 期末基金资产净值	57,617,349.54
5. 期末基金份额净值	1.0005

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 8 日）	
	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B
1. 本期已实现收益	22,982.91	855,844.85
2. 本期利润	22,982.91	855,844.85
3. 期末基金资产净值	7,866,320.61	261,167,221.26

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。（2）本基金无持有人认购/申购或交易基金的各项费用。（3）本基金收益在基金份额“6 个月持有周期到期日”集中结转为基金份额。（4）自 2020 年 12 月 9 日起，《嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实定期宝 6 个月理财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）

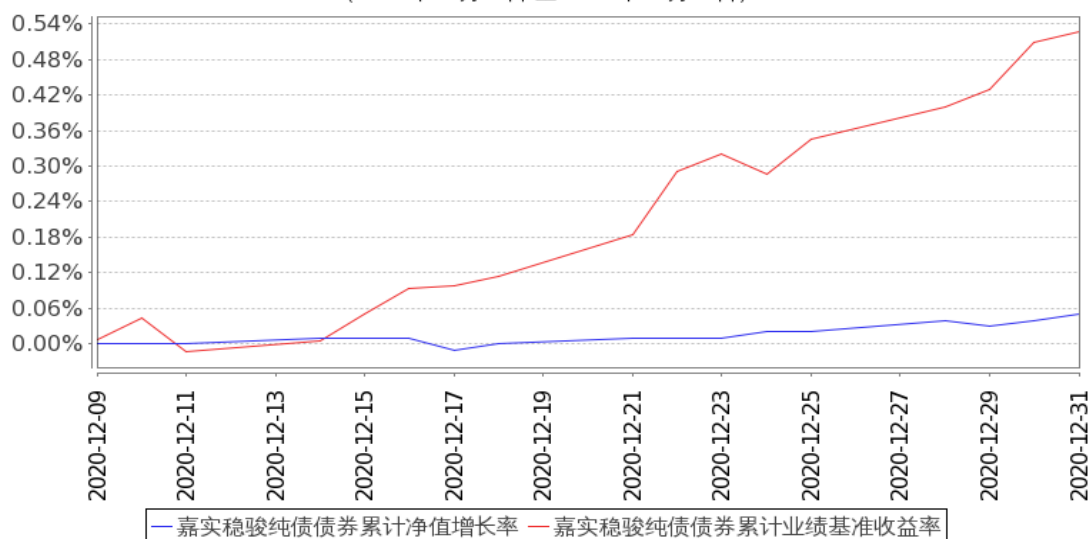
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	0.05%	0.01%	0.53%	0.04%	-0.48%	-0.03%

3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实稳骏纯债债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020年12月09日至2020年12月31日)



注：（1）本基金合同生效日 2020 年 12 月 9 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 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

嘉实定期宝 6 个月理财债券 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.2919%	0.0016%	0.2458%	0.0000%	0.0461%	0.0016%
过去六个月	0.5910%	0.0014%	0.5734%	0.0000%	0.0176%	0.0014%
过去一年	2.1550%	0.0125%	1.2216%	0.0000%	0.9334%	0.0125%
过去三年	9.4517%	0.0080%	3.8216%	0.0000%	5.6301%	0.0080%
自基金合同生效起至今	12.7455%	0.0072%	4.8332%	0.0000%	7.9123%	0.0072%

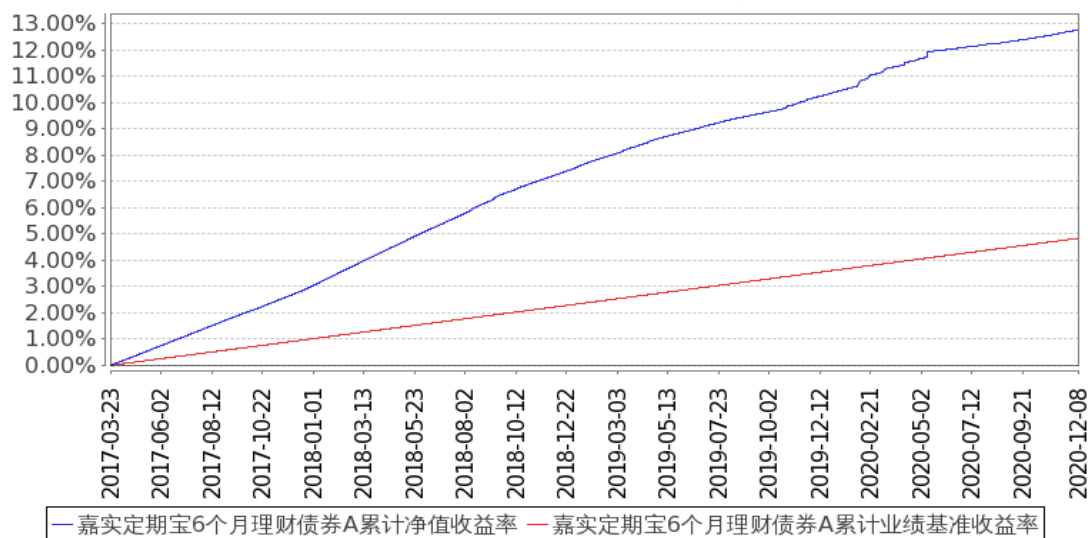
嘉实定期宝 6 个月理财债券 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.3277%	0.0016%	0.2458%	0.0000%	0.0819%	0.0016%
过去六个月	0.6749%	0.0014%	0.5734%	0.0000%	0.1015%	0.0014%
过去一年	2.3358%	0.0125%	1.2216%	0.0000%	1.1142%	0.0125%
过去三年	10.0578%	0.0080%	3.8216%	0.0000%	6.2362%	0.0080%
自基金合同生效起至今	13.5336%	0.0072%	4.8332%	0.0000%	8.7004%	0.0072%

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

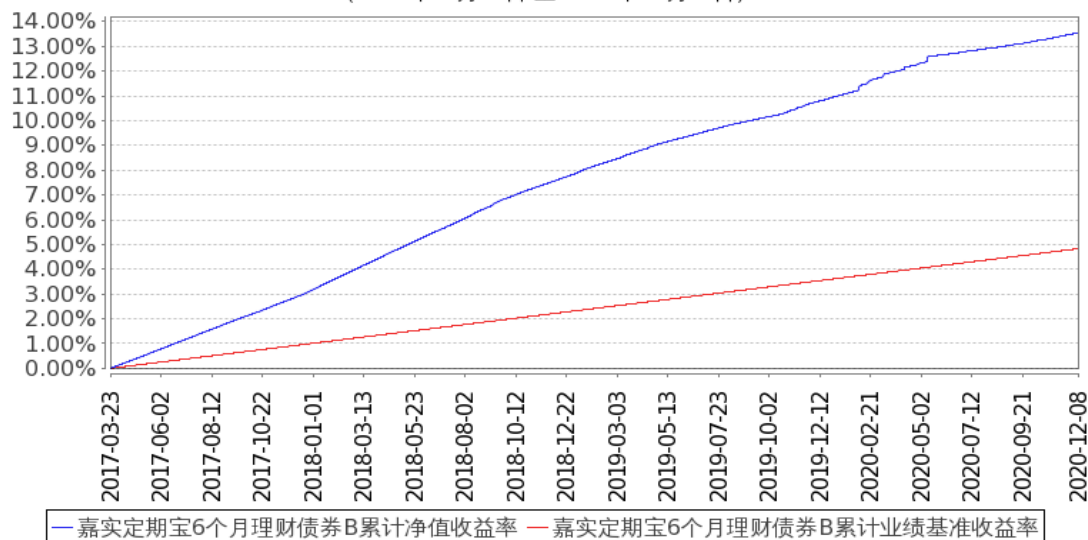
嘉实定期宝6个月理财债券A累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年03月23日至2020年12月08日)



嘉实定期宝6个月理财债券B累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年03月23日至2020年12月08日)



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 2020 年 12 月 9 日起，《嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金基金合同》同日起失效。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李金灿	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实宝、嘉实薪金宝货币、嘉实 6 个月理财债券、嘉实中短债债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实融享货币、嘉实汇鑫中短债债券基金经理	2020 年 12 月 9 日	-	11 年	曾任 Futex Trading Ltd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任职于固收投研体系基金经理。硕士研究生，CFA、具有基金从业资格。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李金灿	本基金、嘉实货币、嘉实超短债债券、理财宝 7 天债券、嘉实宝、嘉实薪金宝货币、嘉实 6 个月理财债券、嘉实中短债债券、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实融享货币、嘉实汇鑫中短债债券基金经理	2017 年 5 月 25 日	-	11 年	曾任 Futex Trading Ltd 期货交易员、北京首创期货有限责任公司研究员、建信基金管理有限公司债券交易员。2012 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券交易员，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，CFA、具有基金从业资格。

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉

实稳骏纯债债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年 4 季度，央行主导下货币政策保持稳健，货币市场收益率保持平稳，债券市场利率整体下行。今年以来统筹疫情防控和经济社会发展工作取得重大成果，经济运行逐步恢复常态。稳健的货币政策体现了前瞻性、精准性和时效性，大力支持疫情防控、复工复产和实体经济发展，金融风险有效防控，金融服务实体经济的质量和效率逐步提升。存量浮动利率贷款定价基准转换顺利完成，贷款市场报价利率改革红利持续释放，货币传导效率增强，贷款利率明显下降，人民币汇率总体稳定，双向浮动弹性提升，发挥了宏观经济稳定器功能。宏观经济数据显示，当前境外疫情和世界经济形势依然复杂严峻。国内经济内生动力增强，但也面临疫情等不稳定不确定因素冲击，国内房地产、汽车等传统支柱产业进入调整期，消费增长相对乏力，经济内生增长动力不强。从国际上看，受疫情影响，国际金融市场动荡加剧，对我国金融市场造成一定影响，主要发达经济体增长有所放缓。在这样的宏观环境下，我国央行主导下稳健的货币政策灵活精准、合理适度，货币政策保持连续性、稳定性、可持续性，保持对经济恢复的必要支持力度。央行综合运用并创新多种货币政策工具，保持流动性合理充裕，保持货币供应量和社会融资规模增速同名义经济增速基本匹配，保持宏观杠杆率基本稳定。未来面临内外因素交织的局面下，资金面在表面平稳的环境下，依然存在多重不确定因素。

今年 4 季度银行间隔夜和 7 天回购利率均值分别为 1.70%和 2.50%，较 3 季度均值 1.87%和 2.33%差距不大。4 季度债券市场收益率整体下行，3 季末 1 年期和 10 年期国开债收益率分别收于

2.56%和 3.53%，较 3 季度末 2.84%和 3.72%下行。4 季度信用债市场收益率也跟随利率债先上后下，由于个别国企信用违约事件，信用债市场分化加剧。4 季末 1 年期高评级的 AAA 级短融收益率由 3 季度末的 3.17%下行至 3.14%，同期中等级别的 AA+级短融收益率则由 3.33%上行至 3.44%。

2020 年 4 季度，本基金秉持稳健投资原则，谨慎操作，以确保组合安全性为首要任务；灵活配置逆回购、银行存单、债券和同业存款，管理现金流分布，保障组合充足流动性；控制银行存款和债券资产配置比例，组合保持中性久期，在收益率曲线平坦化环境中管理组合利率风险；谨慎筛选组合投资个券，严控信用风险；灵活运用短期杠杆资源提高组合收益。整体看，4 季度本基金成功应对了市场和规模波动，投资业绩平稳，实现了安全性、流动性和收益性的目标，并且整体组合的持仓结构相对安全，流动性和弹性良好，为下一阶段抓住市场机遇、创造安全收益打下了良好基础。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后：

截至 2020 年 12 月 31 日，嘉实稳骏纯债债券基金份额净值为 1.0005 元，自 2020 年 12 月 9 日起至 2020 年 12 月 31 日止，基金份额净值增长率为 0.05%，业绩比较基准收益率为 0.53%。

转型前：

自 2020 年 10 月 1 日起至 2020 年 12 月 8 日止，嘉实定期宝 6 个月理财债券 A 的基金份额净值收益率为 0.2919%，嘉实定期宝 6 个月理财债券 B 的基金份额净值收益率为 0.3277%，业绩比较基准收益率为 0.2458%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告（转型后）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,003,000.00	51.80
	其中：债券	30,003,000.00	51.80
	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	19,982,149.97	34.50
	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	7,235,506.25	12.49
8	其他资产	700,725.54	1.21
9	合计	57,921,381.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,003,000.00	52.07
	其中：政策性金融债	30,003,000.00	52.07
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	30,003,000.00	52.07

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	200201	20 国开 01	300,000	30,003,000.00	52.07

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.9.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	700,725.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	700,725.54

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	99,011,458.52	36.57
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备 付金合计	171,720,120.69	63.42
4	其他资产	48,048.00	0.02
5	合计	270,779,627.21	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

报告期内本基金未发生债券回购融资交易。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

报告期内本基金每日债券正回购的资金余额均未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	1
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	35
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	1

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余期限均未超过 180 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净 值的比例（%）	各期限负债占基金资产净 值的比例（%）
1	30 天以内	100.63	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-

	利率债		
2	30 天（含）—60 天		-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-
3	60 天（含）—90 天		-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-
4	90 天（含）—120 天		-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-
5	120 天（含）—397 天（含）		-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债		-
	合计	100.63	

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

报告期内每个交易日投资组合平均剩余存续期均未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

无。

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0120%
报告期内偏离度的最低值	-0.0095%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0037%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内每个交易日负偏离度的绝对值均未达到 0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内每个交易日正偏离度的绝对值均未达到 0.5%。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金采用固定份额净值，基金份额账面净值始终保持为 1.00 人民币元。

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	48,048.00
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	48,048.00

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

基金合同生效日(2020年12月9日)基金份额总额	270,533,111.83
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	50,037,802.02
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	262,981,950.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	57,588,963.51

§6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

项目	嘉实定期宝 6 个月理财债券 A	嘉实定期宝 6 个月理财债券 B
报告期期初基金份额总额	7,875,401.49	261,167,221.26

报告期期间基金总申购份额	737.19	-
报告期期间基金总赎回份额	9,818.07	-
报告期期末基金份额总额	7,866,320.61	261,167,221.26

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细（转型前）

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020/12/18 至 2020/12/31	-	49,999,000.00	-	49,999,000.00	86.82
	2	2020/10/01 至 2020/12/17	109,005,982.25	615,188.69	109,621,170.94	-	-
	3	2020/10/01 至 2020/12/17	99,970,587.83	564,196.30	100,534,784.13	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实定期宝 6 个月理财债券型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实稳骏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) 报告期内嘉实稳骏纯债债券型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2021 年 1 月 21 日