

# 嘉实致诚纯债债券型证券投资基金

## 2024 年第 2 季度报告

2024 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：浙商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 7 月 18 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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 07 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 04 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 基金简称       | 嘉实致诚纯债债券  |
| 基金主代码      | 018169  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式  |
| 基金合同生效日    | 2023 年 3 月 30 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 3,658,142,735.39 份  |
| 投资目标       | 本基金力争在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>一、债券投资策略</p> <p>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。具体包括：利率策略、信用债券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略和息差策略。</p> <p>二、国债期货投资策略</p> <p>本基金参与国债期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与国债期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。基金管理人针对国债期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程，确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作，并明确相关岗位职责。</p> |
| 业绩比较基准     | 中债总全价指数收益率  |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型证券投资基金，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。 |
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司       |
| 基金托管人 | 浙商银行股份有限公司       |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 年 6 月 30 日） |
|-----------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 30,218,416.37                       |
| 2. 本期利润         | 35,441,533.35                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0112                              |
| 4. 期末基金资产净值     | 3,737,867,401.25                    |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0218                              |

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

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

#### 3.2 基金净值表现

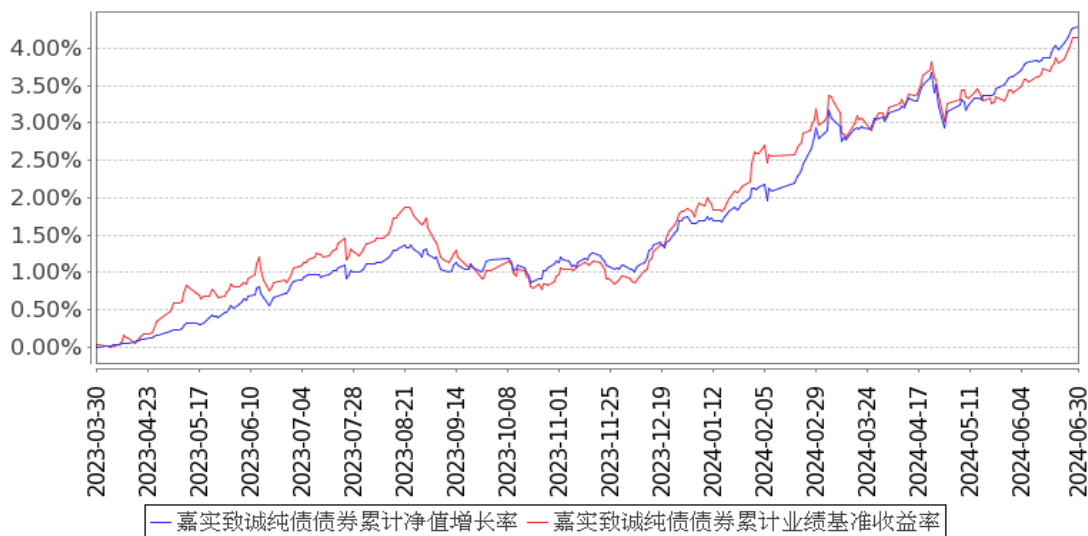
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段             | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③   | ②-④    |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月          | 1.17%      | 0.08%         | 0.98%          | 0.09%                 | 0.19% | -0.01% |
| 过去六个月          | 2.49%      | 0.08%         | 2.24%          | 0.09%                 | 0.25% | -0.01% |
| 过去一年           | 3.36%      | 0.07%         | 3.05%          | 0.08%                 | 0.31% | -0.01% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 4.28%      | 0.06%         | 4.14%          | 0.08%                 | 0.14% | -0.02% |

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

### 嘉实致诚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

(2023年03月30日至2024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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限     |      | 证券从业年限 | 说明   |
|----|--|-----------------|------|--------|--|
|    |  | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 闵锐 | 本基金、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实稳泽纯债债券、嘉实稳荣债券、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实稳骏纯 | 2023 年 3 月 30 日 | -    | 8 年    | 2015 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益研究部，从事信用研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |

|    |   |                 |   |      |   |
|----|---|-----------------|---|------|---|
|    | 债债券、嘉实长三角 ESG 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   |                 |   |      |   |
| 祝杨 | 本基金、嘉实稳泽纯债债券、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实稳骏纯债债券、嘉实长三角 ESG 纯债债券、嘉实双季兴享 6 个月持有债券、嘉实中债绿色普惠主题金融债券优选指数基金经理 | 2023 年 3 月 30 日 | - | 11 年 | 曾在海通证券股份有限公司固定收益部从事投资交易工作；曾任申港证券股份有限公司资管固收部董事总经理，民生证券股份有限公司资产管理事业部固定收益投资总部副总经理。2021 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，任固定收益策略投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
| 程剑 | 本基金、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实稳荣债券基金经理，公司副总经理、机构业务联席首席投资官兼启航解决方案   | 2023 年 4 月 12 日 | - | 17 年 | 历任海通证券股份有限公司固定收益部业务员、研究策略部经理及固定收益部总经理助理、副总经理。2022 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任公司副总经理、机构业务联席首席投资官兼启航解决方案战队负责人。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。               |

|  |        |  |  |  |  |
|--|--------|--|--|--|--|
|  | 战队负责人。 |  |  |  |  |
|--|--------|--|--|--|--|

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 3 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度债券市场总体震荡下行。4 月资金面平衡宽松，经济基本面仍处于恢复过程中但边际有所降温，有效需求不足问题仍突出，降息预期助推下债市收益率下行，中短端利率明显下行后开始向长端和超长端传导，长端利率收益率也达到历史相对低位。由于前期债券收益率下行较快，央行提示长端利率风险，债市收益率出现回调，消息面对债市扰动加大，收益率走势震荡。5 月 17 日全国切实做好保交房工作视频会议召开，地产领域推出一系列政策组合拳，但市场配置利率仍较强，地产政策密集落地后消息面趋于平静。此外，随着 5 月开始停止手工补息，资金脱媒转向非银机构，新增的配置力量使得收益率重回下行趋势，其中中短端确定性更强下行更明显，长

端和超长端对于央行风险提示仍有顾虑，下行幅度较为克制；但随着期限利差的不断拉大，长端和超长端利率再度下行。

报告期内，本基金积极参与利率债波段交易，灵活调整组合杠杆和久期，力争在风险与收益间取得平衡。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0218 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.17%，业绩比较基准收益率为 0.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | -                | -            |
|    | 其中：股票             | -                | -            |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 3,421,804,353.45 | 91.52        |
|    | 其中：债券             | 3,421,804,353.45 | 91.52        |
|    | 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          | 300,076,438.35   | 8.03         |
|    | 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      | 17,119,803.85    | 0.46         |
| 8  | 其他资产              | -                | -            |
| 9  | 合计                | 3,739,000,595.65 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

无。

#### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

无。

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 501,173,752.82   | 13.41        |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 2,920,630,600.63 | 78.14        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,920,630,600.63 | 78.14        |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,421,804,353.45 | 91.54        |

### 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  | 230208 | 23 国开 08 | 3,700,000 | 378,123,172.60 | 10.12        |
| 2  | 210203 | 21 国开 03 | 2,200,000 | 227,732,849.32 | 6.09         |
| 3  | 220220 | 22 国开 20 | 2,000,000 | 210,919,289.62 | 5.64         |
| 4  | 200210 | 20 国开 10 | 2,000,000 | 210,560,109.59 | 5.63         |
| 5  | 190208 | 19 国开 08 | 2,000,000 | 206,881,311.48 | 5.53         |

### 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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

#### 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

无。

#### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                  |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 4,262,562,109.61 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 1,687,454,183.98 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,291,873,558.20 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                |
| 报告期期末基金份额总额               | 3,658,142,735.39 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |                  |                |                 | 报告期末持有基金情况     |          |
|--|----------------|-------------------------|------------------|----------------|-----------------|----------------|----------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额             | 申购份额           | 赎回份额            | 持有份额           | 份额占比 (%) |
| 机构   | 1              | 2024-04-01 至 2024-06-30 | 1,467,997,553.34 |                | -489,332,517.80 | 978,665,035.54 | 26.75    |
|  | 2              | 2024-04-01 至 2024-05-13 | 990,196,059.02   | 195,942,980.31 | 990,196,059.02  | 195,942,980.31 | 5.36     |
| 产品特有风险   |                |                         |                  |                |                 |                |          |
| <p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |                |                         |                  |                |                 |                |          |

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

## 9.2 存放地点

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

## 9.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日