嘉实债券开放式证券投资基金
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：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意。

基金托管人中国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。

本基金为嘉实理财通系列证券投资基金之一，嘉实理财通系列证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金和嘉实债券开放式证券投资基金。每只基金均为契约型开放式，适用一个基金合同和招募说明书。

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

§1 重要提示及目录 2

1.1 重要提示 2
1.2 目录 3

§2 基金简介 5

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 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

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 8

§4 管理人报告 9

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遵规守信情况的说明 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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
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 13

§5 托管人报告 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13

6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18

§7 投资组合报告 38

7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40

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 40
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 41
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 41
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 41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 41
7.11 投资组合报告附注 41

§8 基金份额持有人信息 42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
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 43

§9 开放式基金份额变动 43

§10 重大事件揭示 44

10.1 基金份额持有人大会决议 44
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 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 44
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 44
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 45
10.8 其他重大事件 53

§11 影响投资者决策的其他重要信息 53

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 53

§12 备查文件目录 54

12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 54
12.3 查阅方式 54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实债券开放式证券投资基金	
基金简称	嘉实债券	
基金主代码	070005	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003 年 7 月 9 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	
报告期末基金份额总额	1,263,943,955.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实债券 A	嘉实债券 C
下属分级基金的交易代码	070005	020508
报告期末下属分级基金的份额总额	943,192,965.43 份	320,750,990.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以本金安全为前提，追求较高的组合回报
投资策略	在有效管理风险的基础上，采取主动的自上而下的投资策略，通过对投资组合的相对价值分析，充分挖掘收益率曲线动态变化而带来的潜在的投资机会；应用久期调整、凸度挖掘、息差比较等策略构建组合，实现基金的保值增值。具体策略包括：资产配置、组合构建策略与方法、债券选择标准。
业绩比较基准	中央国债登记结算公司的中国债券指数
风险收益特征	本基金的投资目标和投资范围决定了本基金属于低风险证券投资基金，其长期平均的风险和预期收益率低于股票基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉实基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区复兴门内大街 1 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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	层	
邮政编码	100020	100818
法定代表人	经雷	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	嘉实债券 A	嘉实债券 C
本期已实现收益	19,128,545.98	3,453,931.22
本期利润	25,738,905.93	-1,232,874.59
加权平均基金份额本期利润	0.0315	-0.0036
本期加权平均净值利润率	2.42%	-0.28%
本期基金份额净值增长率	2.69%	2.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	116,077,005.37	39,314,110.91
期末可供分配基金份额利润	0.1231	0.1226
期末基金资产净值	1,242,910,865.14	422,517,332.28
期末基金份额净	1.3178	1.3173

值		
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	266.33%	12.87%

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

嘉实债券 A

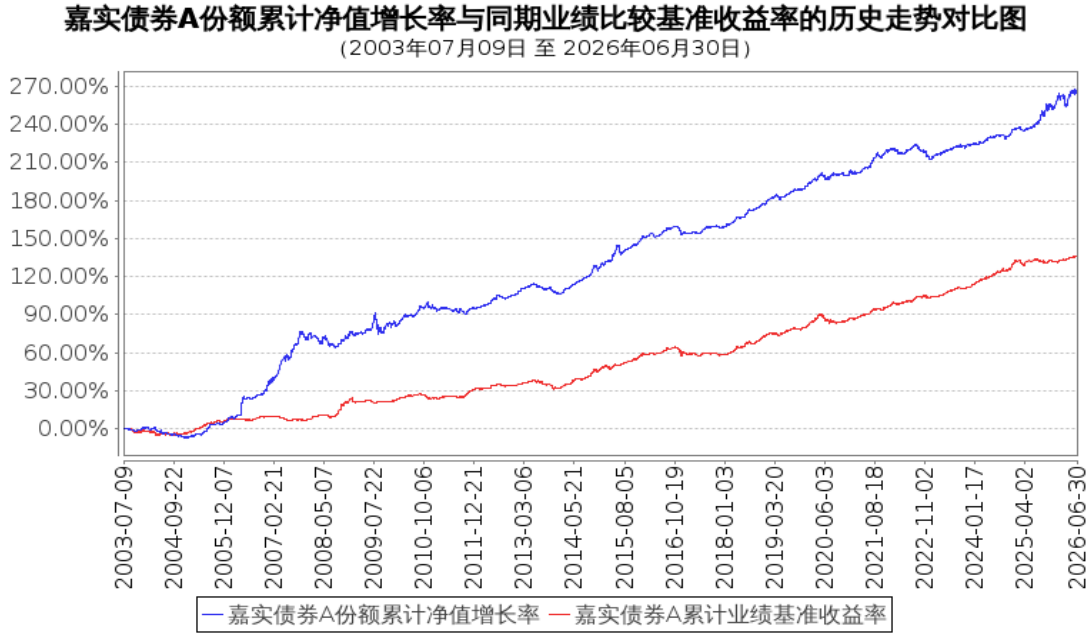
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.35%	0.26%	1.17%	0.05%	2.18%	0.21%
过去六个月	2.69%	0.29%	1.98%	0.05%	0.71%	0.24%
过去一年	7.76%	0.27%	1.33%	0.07%	6.43%	0.20%
过去三年	14.23%	0.17%	12.87%	0.09%	1.36%	0.08%
过去五年	19.31%	0.15%	23.86%	0.09%	-4.55%	0.06%
过去七年	28.86%	0.14%	34.01%	0.10%	-5.15%	0.04%
过去十年	44.27%	0.12%	47.27%	0.10%	-3.00%	0.02%
自基金合同生效起至今	266.33%	0.22%	136.24%	0.14%	130.09%	0.08%

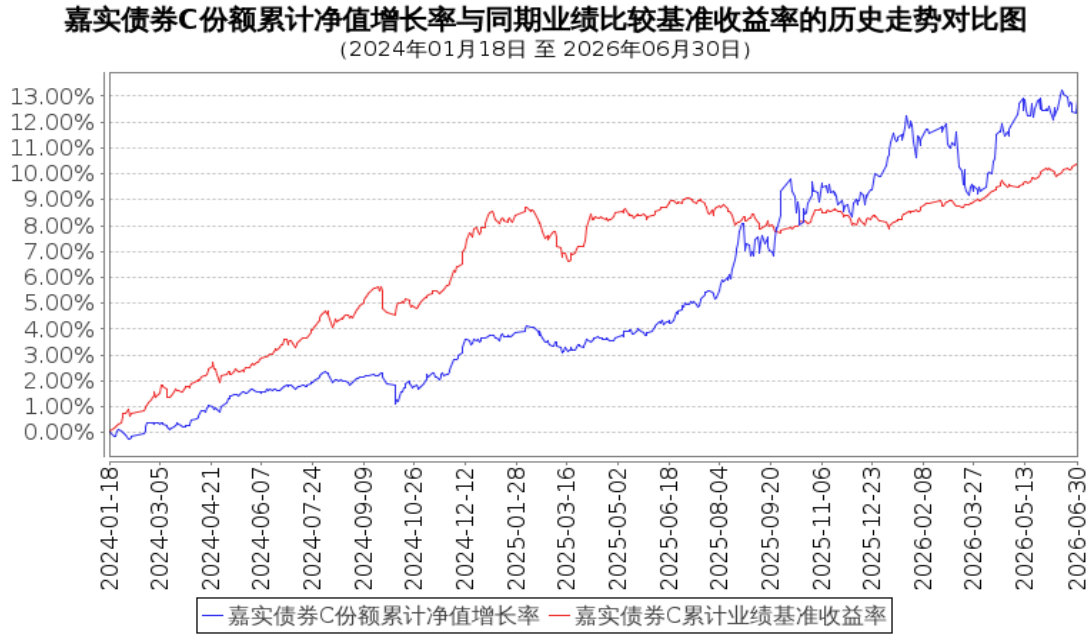
嘉实债券 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	3.35%	0.26%	1.17%	0.05%	2.18%	0.21%
过去六个月	2.68%	0.28%	1.98%	0.05%	0.70%	0.23%
过去一年	7.74%	0.27%	1.33%	0.07%	6.41%	0.20%
自基金合同生效起	12.87%	0.19%	10.31%	0.10%	2.56%	0.09%

至今						

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





注：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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
轩璇	本基金、嘉实纯债债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新趋势混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起、嘉实年年红一	2019 年 11 月 5 日	-	14 年	曾任易方达基金管理有限公司固定收益部高级研究员、基金经理助理。2019 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	年持有债券发起式、嘉实致泰一年定开纯债债券发起式、嘉实同舟债券基金经理				

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

上半年国内经济“总量达标、结构分化”，内需修复偏弱：零售总额上半年仅增长 1.3%，其中商品消费增速仅 1.1%，服务消费虽相对亮眼（+5.3%）但体量有限；房地产开发投资同比下滑

18.0%，对上下游产业链形成持续拖累；制造业投资降至近年低位，基建投资同比回落，未能形成有效对冲。社融总量增速维持低位，企业中长期贷款需求疲软。实体经济资产回报率持续走低，推动"资产荒"格局进一步深化。商业银行在信贷投放受阻的背景下加速增配债券类资产，形成信贷需求不足、银行增配债券、收益率下行的核心传导链条，上半年债券市场震荡小幅向下。

利率债上半年整体走出陡峭下行、震荡走牛、窄幅整固的三阶段行情，配置力量、基本面与资金面交替驱动。年初至一季度末，配置盘"开门红"成色较好，货币财政协调配合下市场对供需结构的担忧明显缓解。短端方面，流动性整体充裕叠加同业活期存款利率调降预期及外围避险需求，存单利率创出新低；长端虽先后经历年初权益与商品市场回暖、2 月关税裁定扰动及 3 月美伊局势引发的通胀担忧，但收益率保持韧性、波动下行——"配置盘主导、利空不跌"是这一阶段的核心特征。二季度前半段（4-5 月），经济数据持续走弱——制造业产销与企业投资边际降温、地产修复持续低于预期，叠加资金面延续宽松格局，做多情绪集中回暖，长端利率进入趋势性下行通道，10 年期国债向 1.70%一线靠拢，30 年期同步走强。进入 6 月，资金面边际收敛，DR007 回升至政策利率 1.40%附近，叠加前期利率下行幅度较大后机构获利了结增多，多空分歧持续放大，交易情绪趋于谨慎，长端利率转入窄幅震荡整固区间。从上半年整体运行看，偏弱基本面与宽松流动性的"双底"支撑始终稳固，阶段性扰动更多来自供给节奏与政策预期的边际变化。

信用债上半年最显著的特征是利差系统性收窄至低位。利差极致压缩的根源在于"资产荒"深化：理财规模持续扩张叠加存款利率下行推动资金向固收类产品转移，而信用债供给端受城投债务严控与房企融资收缩影响增量有限，供需缺口驱动利差持续收敛。

上半年中证转债指数累计上涨 2.51%，整体震荡上行，但行情结构分化显著，且估值高企贯穿始终。分阶段看：1 月权益市场回暖带动转债积极开局，估值快速抬升；春节后估值高企引发减仓行为，行情转入震荡；3 月美伊冲突升级，地缘风险升温推动组合转向防御，转债仓位有所压降；4 月正股与转债估值出现罕见的"双升"格局，指数再度冲高；5-6 月进入高位震荡，估值维持历史极高分位但向上动能衰减。行业结构方面，仅电子、通信、建材、机械四个行业跑赢同期上证指数，消费、医药等传统赛道持续承压，与"科技+高端制造"的 A 股结构性主线高度吻合。

操作上，纯债部分以高等级信用债作为底仓配置核心，贯穿上半年始终。在久期管理上，一季度维持中性久期中枢，根据资金面与利率波动进行灵活微调，兼顾票息收益与利率风险控制。进入二季度，基于对基本面修复节奏偏缓、货币政策维持宽松基调的判断，我们主动提升组合久期水平，积极捕捉利率下行带来的波段收益。

转债部分，组合延续高频灵活调整的风格。上半年仓位变动大致经历五个阶段：1 月份基于年初流动性充裕与春季躁动预期，转债仓位相对积极；随着市场估值快速抬升，逐步降低仓位并

收缩持仓弹性。3 月初海外突发军事冲突，市场风险偏好显著回落，配置上进一步转向防御，减持高弹性品种。4 月份地缘风险阶段性缓和、权益市场企稳回暖，我们再次积极提升转债仓位，参与估值修复行情。5 月中下旬，在前述反弹积累一定涨幅后，进行了减仓操作以兑现收益、控制回撤。个券层面，以自下而上的价值挖掘为主，聚焦个券的绝对收益属性而非赛道贝塔，持仓相对分散均衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实债券 A 基金份额净值为 1.3178 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.69%；截至本报告期末嘉实债券 C 基金份额净值为 1.3173 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.68%；业绩比较基准收益率为 1.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，债券市场的震荡格局较难打破。一方面，周期性修复力量正在积聚：上半年财政支出落后于预算序时进度，专项债发行放缓，为下半年留出了充足的存量政策空间，中央预算内投资加快落地，三季度财政发力具有较高确定性，经济下行压力有望边际缓解。另一方面，趋势性下行力量依然深刻：居民资产负债表修复尚未完成，收入预期未见改善，耐用品消费在超前刺激后必然经历"还账"过程，消费回升基础不牢；同时"零基预算"试点、政府投资提级审批等财政纪律约束不断加强，中长期总需求中枢面临下移压力。从定价角度，收益率已充分隐含经济下行预期，货币宽松态度不明、缺乏进一步下行催化剂；通胀预期回落、风险偏好下降、配置资金力量持续显现，构成收益率上方的坚实压制。

在此格局下，组合操作上计划保持中性的久期水平，同时通过骑乘、利差策略进行收益增厚。

经济基本面的边际承压叠加 AI 景气度一枝独秀，形成了 A 股强结构性，目前的极致分化可能会迎来阶段性的风格收敛。转债方面今年以来整体估值偏离度持续位于高位，若 A 股市场不出现持续调整，转债估值难回落；由于近期市场波动较大，从个券角度，部分品种已具备较好的安全边际。组合将维持中性仓位，对具备安全边际的个券进行积极配置。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实债券开放式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本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的真实、准确和完整发表意见

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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§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：嘉实债券开放式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	6.4.7.1	984,021.99	504,829.65
结算备付金		2,295,917.39	1,729,129.73
存出保证金		135,111.68	81,298.27
交易性金融资产	6.4.7.2	1,749,831,851.25	738,440,208.92
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,749,831,851.25	738,440,208.92
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	-	73,004,556.71
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		110,288.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,790,523.98	1,490,907.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,755,147,714.75	815,250,930.81
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		74,002,230.14	-
应付清算款		760,952.84	-
应付赎回款		13,483,979.48	1,840,819.92
应付管理人报酬		769,540.28	390,823.66
应付托管费		256,513.41	130,274.55
应付销售服务费		3,402.10	335.08
应付投资顾问费		-	-
应交税费		65,691.49	20,949.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	377,207.59	312,850.75
负债合计		89,719,517.33	2,696,053.02
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	1,263,943,955.67	630,632,618.39
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	401,484,241.75	181,922,259.40
净资产合计		1,665,428,197.42	812,554,877.79
负债和净资产总计		1,755,147,714.75	815,250,930.81

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实债券 A 基金份额净值 1.3178 元，基金份额总额 943,192,965.43 份，嘉实债券 C 基金份额净值 1.3173 元，基金份额总额 320,750,990.24 份，基金份额总额合计为 1,263,943,955.67 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		32,093,556.61	28,211,814.77
1.利息收入		261,078.88	101,472.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	28,001.50	11,139.00
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		233,077.38	90,333.06
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		29,768,906.15	34,179,867.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	207,698.10	-1,649,381.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	29,521,301.59	35,735,102.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	39,906.46	94,146.63
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	1,923,554.14	-6,674,240.66
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	140,017.44	604,715.86

减：二、营业总支出		7,587,525.27	9,795,733.38
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	4,508,448.00	5,453,273.98
2．托管费	6.4.10.2.2	1,502,815.99	1,817,757.91
3．销售服务费	6.4.10.2.3	22,356.85	220.79
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		1,389,178.86	2,346,713.87
其中：卖出回购金融资产支出		1,389,178.86	2,346,713.87
6．信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7．税金及附加		42,438.19	51,935.74
8．其他费用	6.4.7.23	122,287.38	125,831.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,506,031.34	18,416,081.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,506,031.34	18,416,081.39
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,506,031.34	18,416,081.39

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实债券开放式证券投资基金

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 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	630,632,618.39	-	181,922,259.40	812,554,877.79
二、本期期初净资产	630,632,618.39	-	181,922,259.40	812,554,877.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	633,311,337.28	-	219,561,982.35	852,873,319.63
（一）、综合收益总额	-	-	24,506,031.34	24,506,031.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	633,311,337.28	-	199,500,960.05	832,812,297.33
其中：1.基金申购款	1,492,724,818.94	-	453,005,996.54	1,945,730,815.48

2.基金赎回款	-859,413,481.66	-	-253,505,036.49	-1,112,918,518.15
（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）	-	-	-4,445,009.04	-4,445,009.04
四、本期期末净资产	1,263,943,955.67	-	401,484,241.75	1,665,428,197.42
项目	上年度可比期间 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	2,287,228,695.21	-	491,483,228.31	2,778,711,923.52
二、本期期初净资产	2,287,228,695.21	-	491,483,228.31	2,778,711,923.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-947,272,575.95	-	-186,050,843.98	-1,133,323,419.93
（一）、综合收益总额	-	-	18,416,081.39	18,416,081.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-947,272,575.95	-	-204,466,925.37	-1,151,739,501.32
其中：1.基金申购款	12,532,452.18	-	2,710,477.05	15,242,929.23
2.基金赎回款	-959,805,028.13	-	-207,177,402.42	-1,166,982,430.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,339,956,119.	-	305,432,384.33	1,645,388,503.5

	26			9

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷	梁凯	李袁
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实理财通系列开放式证券投资基金系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2003]67 号文《关于同意嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的批复》，由嘉实基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，嘉实理财通系列开放式证券投资基金由具有不同市场定位的三只基金构成，包括相互独立的嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实稳健开放式证券投资基金和嘉实债券开放式证券投资基金（以下简称“本基金”），基金合同于 2003 年 7 月 9 日正式生效。本基金首次设立募集规模为 586,521,597.17 份基金单位。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。根据《关于嘉实债券开放式证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议部分条款的公告》，为满足基金投资者的需求，为投资者提供多样化的投资途径，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，决定于 2024 年 1 月 18 日起对本基金增加 C 类基金份额，并对本基金的基金合同、托管协议及相关法律文件做相应修改。本基金的原有基金份额全部转为 A 类基金份额。

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

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据国务院令第 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《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部，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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；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，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；存款利息收入不征收增值税；

根据财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财政部，税务总局公告 2026

年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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%的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财税[2017]90 号《财政部、国家税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财税[2004]第 78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财税[2008]132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财税[2012]85 号《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，对个人持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利，按照本通知规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息红利继续暂减按 50%计

入应纳税所得额，适用 20%的税率计征个人所得税。

前款所称限售股，是指财税[2009]167 号文件和财税[2010]70 号文件规定的限售股。

根据财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、中国证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	984,021.99
等于：本金	983,623.76
加：应计利息	398.23
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	984,021.99

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市	277,117,129.26	1,241,113.75	290,438,832.27	12,080,589.26

	场				
	银行间市场	1,439,473,590.81	13,312,718.98	1,459,393,018.98	6,606,709.19
	合计	1,716,590,720.07	14,553,832.73	1,749,831,851.25	18,687,298.45
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,716,590,720.07	14,553,832.73	1,749,831,851.25	18,687,298.45

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00
应付赎回费	2,921.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	42,462.90
其中：交易所市场	15,647.88
银行间市场	26,815.02
应付利息	-
预提费用	81,822.86
合计	377,207.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实债券 A

项目	本期 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	590,112,077.29	590,112,077.29
本期申购	546,944,416.70	546,944,416.70
本期赎回（以“-”号填列）	-193,863,528.56	-193,863,528.56
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	943,192,965.43	943,192,965.43

嘉实债券 C

项目	本期 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	40,520,541.10	40,520,541.10
本期申购	945,780,402.24	945,780,402.24

本期赎回（以“-”号填列）	-665,549,953.10	-665,549,953.10
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	320,750,990.24	320,750,990.24

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	61,766,982.28	108,482,396.61	170,249,378.89
本期期初	61,766,982.28	108,482,396.61	170,249,378.89
本期利润	19,128,545.98	6,610,359.95	25,738,905.93
本期基金份额交易产生的变动数	38,602,598.84	68,548,137.78	107,150,736.62
其中：基金申购款	60,469,949.07	106,153,484.87	166,623,433.94
基金赎回款	-21,867,350.23	-37,605,347.09	-59,472,697.32
本期已分配利润	-3,421,121.73	-	-3,421,121.73
本期末	116,077,005.37	183,640,894.34	299,717,899.71

嘉实债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,223,389.74	7,449,490.77	11,672,880.51
本期期初	4,223,389.74	7,449,490.77	11,672,880.51
本期利润	3,453,931.22	-4,686,805.81	-1,232,874.59
本期基金份额交易产生的变动数	32,660,677.26	59,689,546.17	92,350,223.43
其中：基金申购款	102,486,521.39	183,896,041.21	286,382,562.60
基金赎回款	-69,825,844.13	-124,206,495.04	-194,032,339.17
本期已分配利润	-1,023,887.31	-	-1,023,887.31
本期末	39,314,110.91	62,452,231.13	101,766,342.04

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	18,043.49
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	5,618.51

其他	4,339.50
合计	28,001.50

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	207,698.10
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	207,698.10

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	162,782,845.60
减：卖出股票成本总额	162,412,360.61
减：交易费用	162,786.89
买卖股票差价收入	207,698.10

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	16,287,322.01
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	13,233,979.58
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	29,521,301.59

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,232,792,730.23

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,214,060,445.08
减：应计利息总额	5,412,117.40
减：交易费用	86,188.17
买卖债券差价收入	13,233,979.58

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

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	39,906.46
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	39,906.46

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,923,554.14
股票投资	-
债券投资	1,923,554.14
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	1,923,554.14

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	125,396.93
基金转出费收入	14,620.51
合计	140,017.44

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

银行划款手续费	21,864.52
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	122,287.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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	上年度可比期间

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	4,508,448.00	5,453,273.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	941,443.24	248,802.03
应支付基金管理人的净管理费	3,567,004.76	5,204,471.95

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 0.60%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×0.60%/当年天数。

2.根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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托管费	1,502,815.99	1,817,757.91

注：支付基金托管人的托管费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：日托管费＝前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实债券 A	嘉实债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	475.06	475.06
合计	-	475.06	475.06
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		
	嘉实债券 A	嘉实债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	11.84	11.84
合计	-	11.84	11.84

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.16%，每日计提，逐日累计至每月月底，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×0.16%/当年天

数。

（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

（3）根据《关于嘉实债券开放式证券投资基金 C 类基金份额销售服务费优惠活动的公告》，自 2024 年 2 月 1 日起，C 类基金份额的销售服务费率由 0.16%变更为 0.01%。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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
中国银行股份有限公司_活期	984,021.99	18,043.49	1,158,273.16	4,030.24

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

嘉实债券 A								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	0.0530	2,442,802.93	978,318.80	3,421,121.73	-
合计	-	-	-	0.0530	2,442,802.93	978,318.80	3,421,121.73	-
嘉实债券 C								
序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 16 日	-	2026 年 1 月 16 日	0.0530	1,006,402.82	17,484.49	1,023,887.31	-
合计	-	-	-	0.0530	1,006,402.82	17,484.49	1,023,887.31	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 55,002,230.14 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
230026	23 附息国债 26	2026 年 7 月 1 日	108.11	562,000	60,756,949.51
合计				562,000	60,756,949.51

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 19,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	225,383,110.79	50,301,506.85
合计	225,383,110.79	50,301,506.85

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	413,137,069.84	120,821,389.65
AAA 以下	211,885,163.97	120,579,156.25
未评级	899,426,506.65	446,738,156.17
合计	1,524,448,740.46	688,138,702.07

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下

赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	984,021.99	-	-	-	984,021.99
结算备付金	2,295,917.39	-	-	-	2,295,917.39
存出保证金	135,111.68	-	-	-	135,111.68
交易性金融资产	746,542,393.59	680,760,685.75	322,528,771.91	-	1,749,831,851.25
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	110,288.46	110,288.46
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,790,523.98	1,790,523.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	749,957,444.65	680,760,685.75	322,528,771.91	1,900,812.44	1,755,147,714.75

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	74,002,230.14	-	-	-	74,002,230.14
应付清算款	-	-	-	760,952.84	760,952.84
应付赎回款	-	-	-	13,483,979.48	13,483,979.48
应付管理人报酬	-	-	-	769,540.28	769,540.28
应付托管费	-	-	-	256,513.41	256,513.41
应付销售服务费	-	-	-	3,402.10	3,402.10
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	65,691.49	65,691.49
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	377,207.59	377,207.59
负债总计	74,002,230.14	-	-	15,717,287.19	89,719,517.33
利率敏感度缺口	675,955,214.51	680,760,685.75	322,528,771.91	-13,816,474.75	1,665,428,197.42
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	504,829.65	-	-	-	504,829.65
结算备付金	1,729,129.73	-	-	-	1,729,129.73
存出保证金	81,298.27	-	-	-	81,298.27
交易性金融资产	112,412,006.91	525,989,720.96	100,038,481.05	-	738,440,208.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	73,004,556.71	-	-	-	73,004,556.71
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,490,907.53	1,490,907.53
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	187,731,821.27	525,989,720.96	100,038,481.05	1,490,907.53	815,250,930.81
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	-	-	-	1,840,819.92	1,840,819.92
应付管理人报酬	-	-	-	390,823.66	390,823.66
应付托管费	-	-	-	130,274.55	130,274.55
应付销售服务费	-	-	-	335.08	335.08
应付投资顾问费	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	20,949.06	20,949.06
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	312,850.75	312,850.75
负债总计	-	-	-	2,696,053.02	2,696,053.02
利率敏感度缺口	187,731,821.27	525,989,720.96	100,038,481.05	-1,205,145.49	812,554,877.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	14,013,493.41	5,174,631.28
	市场利率上升 25 个基点	-13,644,959.43	-5,108,557.16

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具均以人民币计价，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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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）
	业绩比较基准上升 5%	-	-
	业绩比较基准下降 5%	-	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	280,408,937.37	151,909,980.50
第二层次	1,469,422,913.88	586,530,228.42
第三层次	-	-
合计	1,749,831,851.25	738,440,208.92

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	1,749,831,851.25	99.70
	其中：债券	1,749,831,851.25	99.70
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	3,279,939.38	0.19
8	其他各项资产	2,035,924.12	0.12
9	合计	1,755,147,714.75	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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300454	深信服	18,917,027.00	2.33
2	300900	广联航空	15,237,128.57	1.88
3	688311	盟升电子	11,852,374.80	1.46
4	688019	安集科技	11,522,963.20	1.42
5	603225	新凤鸣	10,567,137.55	1.30
6	000582	北部湾港	10,434,645.06	1.28
7	688678	福立旺	10,305,099.70	1.27
8	688372	伟测科技	10,226,746.40	1.26
9	301188	力诺药包	10,006,583.40	1.23
10	300483	首华燃气	8,728,218.20	1.07
11	002850	科达利	7,627,798.38	0.94
12	601137	博威合金	6,954,862.00	0.86
13	300014	亿纬锂能	6,928,794.80	0.85
14	002961	瑞达期货	6,889,720.72	0.85
15	600141	兴发集团	5,648,722.50	0.70
16	002859	洁美科技	4,932,743.27	0.61
17	002891	中宠股份	2,516,168.00	0.31
18	603992	松霖科技	1,586,692.86	0.20
19	300681	英搏尔	1,528,934.20	0.19

注：报告期内，本基金累计买入金额前 20 名的股票明细仅包括上述 19 只股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300454	深信服	17,554,153.95	2.16
2	300900	广联航空	15,088,040.25	1.86
3	688372	伟测科技	13,199,541.75	1.62
4	688678	福立旺	12,489,240.17	1.54
5	000582	北部湾港	11,749,863.28	1.45
6	688019	安集科技	11,615,946.59	1.43
7	688311	盟升电子	10,801,068.16	1.33
8	300483	首华燃气	10,037,701.16	1.24
9	301188	力诺药包	9,235,318.61	1.14

10	603225	新凤鸣	9,112,347.50	1.12
11	002850	科达利	7,469,122.96	0.92
12	002859	洁美科技	6,626,557.78	0.82
13	300014	亿纬锂能	6,522,611.40	0.80
14	601137	博威合金	5,803,857.92	0.71
15	002961	瑞达期货	5,609,370.00	0.69
16	600141	兴发集团	4,842,622.00	0.60
17	002891	中宠股份	2,080,470.20	0.26
18	603992	松霖科技	1,667,305.12	0.21
19	300681	英搏尔	1,277,706.80	0.16

注：报告期内，本基金累计卖出金额前 20 名的股票明细仅包括上述 19 只股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	162,412,360.61
卖出股票收入（成交）总额	162,782,845.60

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	526,207,164.01	31.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	214,722,462.46	12.89
	其中：政策性金融债	51,368,060.27	3.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	151,416,932.05	9.09
6	中期票据	570,251,726.87	34.24
7	可转债（可交换债）	287,233,565.86	17.25
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,749,831,851.25	105.07

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	230026	23 附息国债 26	700,000	75,675,915.76	4.54
2	250020	25 附息国债 20	700,000	71,464,380.82	4.29
3	220017	22 附息国债 17	500,000	54,000,303.87	3.24
4	230018	23 附息国债 18	500,000	53,743,563.54	3.23
5	230014	23 附息国债 14	500,000	52,471,534.25	3.15

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，中国工商银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	135,111.68
2	应收清算款	110,288.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,790,523.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,035,924.12

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）

1	127096	泰坦转债	23,059,694.44	1.38
2	113042	上银转债	18,917,454.28	1.14
3	113632	鹤 21 转债	18,414,361.25	1.11
4	118051	皓元转债	17,061,418.14	1.02
5	123245	集智转债	16,954,048.14	1.02
6	113052	兴业转债	16,600,241.75	1.00
7	118030	睿创转债	13,451,371.40	0.81
8	118025	奕瑞转债	13,173,758.08	0.79
9	113046	金田转债	12,764,728.19	0.77
10	127070	大中转债	11,346,219.20	0.68
11	128136	立讯转债	10,281,869.84	0.62
12	123107	温氏转债	9,993,095.15	0.60
13	113667	春 23 转债	9,657,953.95	0.58
14	127049	希望转 2	9,587,865.85	0.58
15	123251	华医转债	8,521,837.09	0.51
16	123258	胜蓝转 02	7,046,950.96	0.42
17	132026	G 三峡 EB2	6,824,628.49	0.41
18	118011	银微转债	6,058,235.51	0.36
19	128127	文科转债	6,033,105.53	0.36
20	123158	宙邦转债	5,757,243.55	0.35
21	113056	重银转债	5,710,194.61	0.34
22	123241	欧通转债	4,945,389.61	0.30
23	123247	万凯转债	4,246,887.05	0.26
24	123188	水羊转债	4,219,249.88	0.25
25	128142	新乳转债	3,924,992.92	0.24
26	118034	晶能转债	3,900,779.82	0.23
27	113673	岱美转债	3,337,799.78	0.20
28	123243	严牌转债	2,961,029.75	0.18
29	127110	广核转债	2,702,543.74	0.16
30	113053	隆 22 转债	2,594,986.62	0.16
31	128129	青农转债	2,417,391.40	0.15

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	户均持有的基	持有人结构

	户数（户）	金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实债券 A	66,378	14,209.42	589,392,390.26	62.49	353,800,575.17	37.51
嘉实债券 C	2,777	115,502.70	270,285,253.88	84.27	50,465,736.36	15.73
合计	69,018	18,313.25	859,677,644.14	68.02	404,266,311.53	31.98

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实债券 A	40,302.77	0.00
	嘉实债券 C	787.84	0.00
	合计	41,090.61	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	嘉实债券 A	0
	嘉实债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实债券 A	0~10
	嘉实债券 C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实债券 A	嘉实债券 C
基金合同生效日（2003 年 7 月 9 日）基金份额总额	586,521,597.17	-
本报告期期初基金份额总额	590,112,077.29	40,520,541.10

本报告期基金总申购份额	546,944,416.70	945,780,402.24
减：本报告期基金总赎回份额	193,863,528.56	665,549,953.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	943,192,965.43	320,750,990.24

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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

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，会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（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	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。

出整改意见）	
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及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(%)	
中信证券股份有限公司	5	69,531,929.21	42.71	30,308.97	42.71	-
广发证券股份有限公司	4	42,960,298.94	26.39	18,726.55	26.39	-
国泰海通证券股份有限公司	4	34,706,501.85	21.32	15,130.86	21.32	-
申万宏源证券有限	1	15,584,115.60	9.57	6,792.99	9.57	-

公司						
财通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-

股份有限公司						
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联储证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
天府证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-

有限公司						
粤开证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	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。国新证券股份有限公司退租交易单元 2 个。信达证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

4.报告期内，本基金新增以下交易单元：摩根大通证券(中国)有限公司新增交易单元 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(%)
中信证券股份有限公司	1,033,311,672.25	55.26	2,537,000,000.00	96.49	-	-
广发证券股份有限公司	291,871,808.35	15.61	25,600,000.00	0.97	-	-
国泰海通证券股份有限公司	102,739,661.06	5.49	7,000,000.00	0.27	-	-
申万宏源证券有限公司	441,931,840.65	23.63	59,700,000.00	2.27	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公	-	-	-	-	-	-

司						
联储证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天府证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招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	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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	嘉实债券开放式证券投资基金 2025 年第一次收益分配公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 14 日
2	关于嘉实债券开放式证券投资基金 2026 年春节前暂停申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 11 日
3	关于嘉实债券开放式证券投资基金 2026 年劳动节前暂停申购（含转换转入及定期定额投资）业务的公告	上海证券报、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 28 日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	上海证券报、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
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、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 2026-02-09,2026-03-18 至 2026-05-18	271,485,935.75	-	115,000,000.00	156,485,935.75	12.38
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)中国证监会批准嘉实理财通系列开放式证券投资基金设立的文件；

(2)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式证券投资基金基金合同》；

(3)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式证券投资基金招募说明书》；

(4)《嘉实理财通系列开放式证券投资基金暨嘉实稳健开放式证券投资基金、嘉实增长开放式证券投资基金、嘉实债券开放式证券投资基金托管协议》；

(5)基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6)报告期内嘉实债券开放式证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

（2）网站查询：基金管理人网址：http://www.jsfund.cn

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日