

嘉实新添益定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 4 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 04 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。

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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实新添益定期混合
基金主代码	007266
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 9 日
报告期末基金份额总额	49,325,508.53 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>1、封闭期投资策略</p> <p>本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。</p> <p>2、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	沪深 300 指数收益率×15% + 中债综合财富指数收益率×85%

风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实新添益定期混合 A	嘉实新添益定期混合 C
下属分级基金的交易代码	007266	007267
报告期末下属分级基金的份额总额	48,497,280.87 份	828,227.66 份

§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（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	嘉实新添益定期混合 A	嘉实新添益定期混合 C
1. 本期已实现收益	968,094.09	14,748.90
2. 本期利润	1,575,762.67	24,918.89
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0325	0.0301
4. 期末基金资产净值	58,558,564.10	978,403.27
5. 期末基金份额净值	1.2075	1.1813

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

嘉实新添益定期混合 A

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
过去三个月	2.77%	0.18%	1.52%	0.13%	1.25%	0.05%
过去六个月	1.66%	0.19%	1.83%	0.16%	-0.17%	0.03%
过去一年	4.49%	0.25%	2.53%	0.17%	1.96%	0.08%
过去三年	15.36%	0.31%	10.76%	0.18%	4.60%	0.13%
自基金合同	20.75%	0.31%	15.13%	0.18%	5.62%	0.13%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

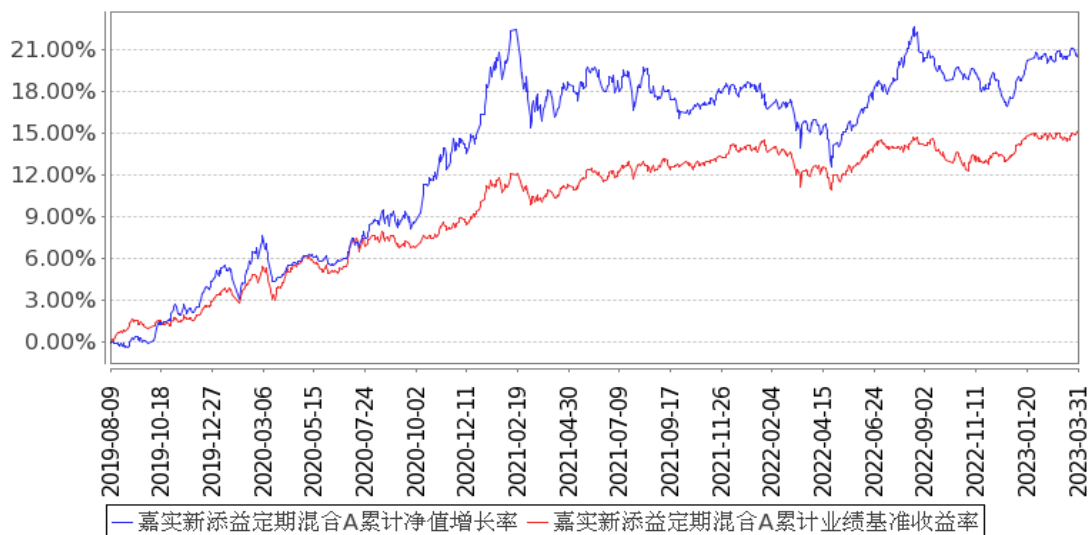
嘉实新添益定期混合 C

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
过去三个月	2.61%	0.18%	1.52%	0.13%	1.09%	0.05%
过去六个月	1.35%	0.19%	1.83%	0.16%	-0.48%	0.03%
过去一年	3.86%	0.25%	2.53%	0.17%	1.33%	0.08%
过去三年	13.29%	0.31%	10.76%	0.18%	2.53%	0.13%
自基金合同生效起至今	18.13%	0.31%	15.13%	0.18%	3.00%	0.13%

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

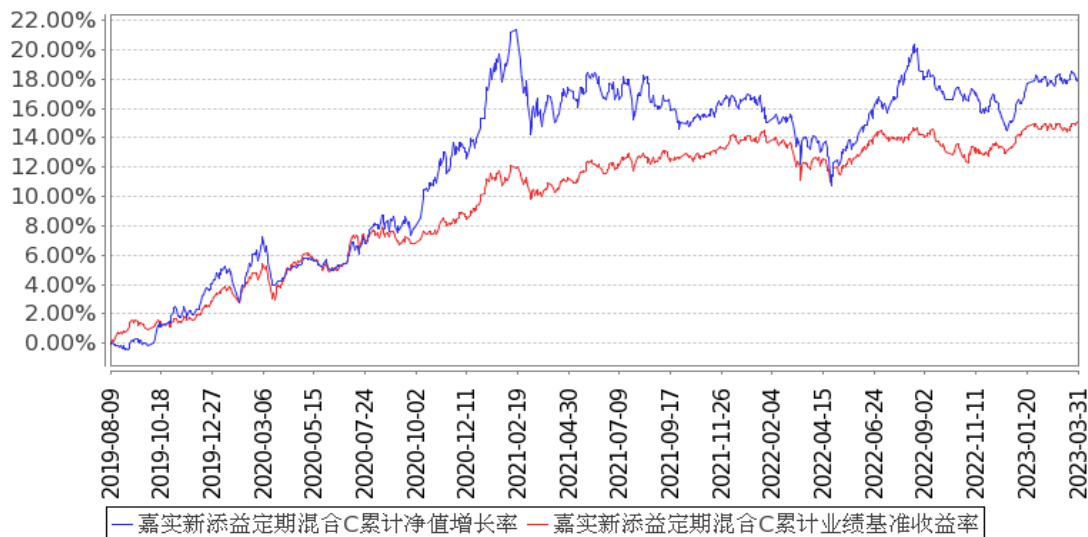
嘉实新添益定期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019年08月09日至2023年03月31日)



嘉实新添益定期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

(2019年08月09日至2023年03月31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		
顾晶菁	本基金、嘉实方舟6个月滚动持有债券发起基金经理	2021年8月24日	-	12年	曾任美国贝莱德集团资产配置基金经理、美国威灵顿管理公司股票投资部研究员、基金经理。2020年5月加入嘉实基金管理有限公司，从事量化研究工作。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、《嘉实新添益定期开放混合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

一季度权益市场震荡上行，沪深 300 指数上涨 4.6%。1 月受疫情及春节假期影响生产活动触底，消费率先实现疫后快速修复，2 月起开工随即提速，加速复常，1-2 月份社会消费品零售总额同比+3.5%，工业增加值增速+2.4%，供需回暖趋势明确。信贷方面，信贷和社融继续双双高于预期，前 2 月贷款同比多增了 1.5 万亿，超过了去年全年。结构上，企业贷款占到了新增的主要部分；企业端内部，票据继续负增长，企业中长期和短贷均实现同比多增。海外方面，海外银行风波“此起彼伏”，银行系统风险与监管应对轮流主导市场情绪，市场对欧美加息预期均大幅下行，美国国债利率大幅回落。

股票结构上，数字经济政策支持叠加生成式 AI 产业趋势热潮催化下，TMT 板块表现大幅领先。债券市场先抑后扬，1 月经济强预期带动下 10 年期国债一度向上接近 3.0%；2 月起国内弱复苏现实及海外银行风险事件共同推动债市震荡回暖。信用债演绎牛市行情，信用利差波动下行，回归至去年四季度赎回潮附近，目前除了隐含 AA(2) 和 AA- 之外，城投债和产业债曲线的利差已经几乎回到理财赎回潮冲击前水平。

展望未来，我对未来的股票市场持中性偏积极看法，站在目前时点，年内经济复苏的主线依然可期，现实和预期的节奏与 2022 年可能呈现错位，今年二季度有概率出现“预期谨慎而现实较强”的情形，权益市场可积极有为，但结构选择和赛道遴选可能变得非常重要。全年而言，A

股震荡后终将上行，数字经济、AIGC 产业链和中国特色估值体系望成为年度主线。

操作上，受到理财资金赎回的影响，转债市场在去年四季度经历了溢价率的大幅压缩，组合在报告期内提高了转债仓位，较好地把握转股溢价率上行的区间收益；组合在择券上偏自下而上，从个券弹性，赎回概率，转债估值定位，债底保护等层面进行配置，维持较低的个股集中度，行业结构上趋向均衡。纯债方面，考虑到组合规模有限，组合以短期限高等级的信用债的配置为主，同时小仓位参与利率债获取了超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新添益定期混合 A 基金份额净值为 1.2075 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.77%；截至本报告期末嘉实新添益定期混合 C 基金份额净值为 1.1813 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.61%；业绩比较基准收益率为 1.52%。

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	20,430.00	0.03
	其中：股票	20,430.00	0.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	56,997,674.64	95.37
	其中：债券	56,997,674.64	95.37
	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	-777.29	-0.00
	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	367,480.28	0.61
8	其他资产	2,379,577.91	3.98
9	合计	59,764,385.54	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业		
B	采矿业		
C	制造业		
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		
E	建筑业		
F	批发和零售业		
G	交通运输、仓储和邮政业		
H	住宿和餐饮业		
I	信息传输、软件和信息技术服务业		
J	金融业	20,430.00	0.03
K	房地产业		
L	租赁和商务服务业		
M	科学研究和技术服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业		
P	教育		
Q	卫生和社会工作		
R	文化、体育和娱乐业		
S	综合		
	合计	20,430.00	0.03

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300033	同花顺	100	20,430.00	0.03

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支股票。

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	301,418.71	0.51
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	13,146,854.19	22.08
6	中期票据	19,567,474.24	32.87
7	可转债（可交换债）	23,981,927.50	40.28

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	56,997,674.64	95.73

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	101801011	18 京汽集 MTN001	50,000	5,168,406.30	8.68
2	102001478	20 义乌国资 MTN003	50,000	5,146,091.78	8.64
3	102101886	21 南昌城投 MTN006	50,000	5,106,181.64	8.58
4	012283233	22 可克达拉 SCP002	50,000	5,051,495.89	8.48
5	042280403	22 福建漳州 CP002	50,000	5,047,686.30	8.48

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，兴业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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,854.67
2	应收证券清算款	2,369,723.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,379,577.91

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	1,077,385.45	1.81
2	113505	杭电转债	368,901.69	0.62
3	110045	海澜转债	358,789.60	0.60
4	118005	天奈转债	353,289.25	0.59
5	128074	游族转债	349,028.51	0.59
6	128121	宏川转债	344,421.48	0.58
7	113542	好客转债	341,932.70	0.57
8	110074	精达转债	331,910.95	0.56
9	128083	新北转债	331,479.11	0.56
10	128124	科华转债	327,961.86	0.55
11	110086	精工转债	318,217.49	0.53

12	123025	精测转债	314,169.20	0.53
13	113604	多伦转债	308,872.80	0.52
14	110052	贵广转债	302,711.94	0.51
15	123093	金陵转债	296,769.18	0.50
16	113535	大业转债	296,361.48	0.50
17	113593	沪工转债	296,038.77	0.50
18	123091	长海转债	294,832.95	0.50
19	128049	华源转债	294,309.60	0.49
20	113519	长久转债	291,604.03	0.49
21	123080	海波转债	289,250.29	0.49
22	113594	淳中转债	287,759.48	0.48
23	127021	特发转 2	283,397.48	0.48
24	123152	润禾转债	281,034.38	0.47
25	113651	松霖转债	274,808.35	0.46
26	123118	惠城转债	274,281.84	0.46
27	128044	岭南转债	261,966.22	0.44
28	123044	红相转债	258,457.08	0.43
29	128144	利民转债	254,833.89	0.43
30	113530	大丰转债	248,486.03	0.42
31	128063	未来转债	248,458.03	0.42
32	128034	江银转债	240,014.78	0.40
33	123059	银信转债	238,069.75	0.40
34	113623	凤 21 转债	237,291.24	0.40
35	123089	九洲转 2	236,529.69	0.40
36	118003	华兴转债	235,856.26	0.40
37	113625	江山转债	233,608.26	0.39
38	123156	博汇转债	233,414.81	0.39
39	123096	思创转债	206,524.96	0.35
40	110068	龙净转债	205,332.58	0.34
41	113640	苏利转债	203,802.48	0.34
42	123106	正丹转债	202,694.86	0.34
43	127006	敖东转债	202,687.26	0.34
44	123064	万孚转债	197,752.64	0.33
45	128131	崇达转 2	186,552.47	0.31
46	127051	博杰转债	182,647.46	0.31
47	123112	万讯转债	182,314.75	0.31
48	118013	道通转债	179,345.74	0.30
49	123151	康医转债	178,896.63	0.30
50	123116	万兴转债	178,813.72	0.30
51	128118	瀛通转债	178,553.00	0.30
52	128117	道恩转债	178,349.58	0.30
53	127041	弘亚转债	178,277.16	0.30

54	118020	芳源转债	178,227.33	0.30
55	118004	博瑞转债	177,878.08	0.30
56	113638	台 21 转债	177,788.93	0.30
57	123039	开润转债	177,746.88	0.30
58	127055	精装转债	176,777.47	0.30
59	128105	长集转债	176,422.07	0.30
60	110090	爱迪转债	176,400.37	0.30
61	128066	亚泰转债	176,197.97	0.30
62	113024	核建转债	174,996.01	0.29
63	127027	靖远转债	174,589.00	0.29
64	123109	昌红转债	173,221.60	0.29
65	123075	贝斯转债	170,379.12	0.29
66	113033	利群转债	167,864.40	0.28
67	113545	金能转债	162,394.96	0.27
68	127019	国城转债	161,528.97	0.27
69	113573	纵横转债	155,204.29	0.26
70	123104	卫宁转债	153,943.14	0.26
71	113634	珀莱转债	153,011.58	0.26
72	123130	设研转债	152,197.24	0.26
73	127052	西子转债	151,446.27	0.25
74	113619	世运转债	151,274.65	0.25
75	113549	白电转债	150,940.02	0.25
76	123076	强力转债	148,528.11	0.25
77	110060	天路转债	145,525.89	0.24
78	110047	山鹰转债	143,297.10	0.24
79	128091	新天转债	142,142.34	0.24
80	127054	双箭转债	140,447.96	0.24
81	127039	北港转债	139,191.26	0.23
82	123012	万顺转债	136,953.14	0.23
83	113585	寿仙转债	136,360.82	0.23
84	128127	文科转债	134,591.57	0.23
85	113649	丰山转债	133,221.82	0.22
86	127016	鲁泰转债	132,890.79	0.22
87	127049	希望转 2	132,184.72	0.22
88	128109	楚江转债	126,335.71	0.21
89	113654	永 02 转债	125,188.92	0.21
90	127035	濮耐转债	123,809.67	0.21
91	123101	拓斯转债	123,058.79	0.21
92	127033	中装转 2	120,832.97	0.20
93	127042	嘉美转债	120,117.41	0.20
94	118012	微芯转债	118,943.77	0.20
95	127045	牧原转债	118,464.90	0.20

96	123065	宝莱转债	118,006.10	0.20
97	113602	景 20 转债	117,555.08	0.20
98	110064	建工转债	116,963.84	0.20
99	113030	东风转债	116,918.58	0.20
100	123119	康泰转 2	116,094.64	0.19
101	113048	晶科转债	108,932.34	0.18
102	113058	友发转债	108,681.84	0.18
103	123077	汉得转债	106,495.42	0.18
104	113534	鼎胜转债	94,509.92	0.16
105	123022	长信转债	82,625.33	0.14
106	110080	东湖转债	80,556.08	0.14
107	113527	维格转债	77,135.17	0.13
108	123067	斯莱转债	76,485.02	0.13
109	123136	城市转债	66,813.09	0.11
110	123063	大禹转债	60,999.93	0.10
111	127040	国泰转债	60,634.58	0.10
112	110079	杭银转债	58,117.18	0.10
113	127028	英特转债	56,720.65	0.10
114	113017	吉视转债	39,557.23	0.07
115	113601	塞力转债	8,774.30	0.01

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 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

项目	嘉实新添益定期混合 A	嘉实新添益定期混合 C
报告期期初基金份额总额	48,497,280.87	828,227.66
报告期期间基金总申购份额	-	-
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
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	48,497,280.87	828,227.66

§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

单位：份

项目	嘉实新添益定期混合 A	嘉实新添益定期混合 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	16,827,367.10	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	16,827,367.10	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	34.70	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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	2023-01-01 至 2023-03-31	16,827,367.10	-	-	16,827,367.10	34.11

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新添益定期开放混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实新添益定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新添益定期开放混合型证券投资基金托管协议》；

- (4) 《嘉实新添益定期开放混合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) 报告期内嘉实新添益定期开放混合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

2023 年 4 月 21 日