

# 嘉实多元收益债券型证券投资基金

## 2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	嘉实多元债券
基金主代码	070015
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 9 月 10 日
报告期末基金份额总额	2,829,749,900.67 份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，本基金通过谋求较高的当期收益，力争资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>在本基金的债券(可转债除外)投资过程中，本基金管理人将采取积极主动的投资策略，在宏观经济趋势研究、货币及财政政策趋势研究的基础上，以中长期利率趋势分析和债券市场供求关系研究为核心，结合信用息差水平分析和收益率曲线形态分析，实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的债券组合投资收益。本基金所采取的主动投资策略涉及债券组合构建的三个步骤：确定债券组合久期、确定债券组合期限结构及类属配置、单个资产选择。其中，每个步骤都采取特定的主动投资子策略，以尽可能地控制风险、提高基金投资收益。</p> <p>具体包括：1、资产配置策略；2、债券投资策略（债券投资（可转债除外）、可转债投资）；3、股票投资策略（新股申购、公开增发等一级市场投资、二级市场股票投资、存托凭证投资）；4、权证投资策略。</p>
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
下属分级基金的交易代码	070015	070016
报告期末下属分级基金的份额总额	1,922,176,884.29 份	907,573,016.38 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
1. 本期已实现收益	17,052,694.65	9,832,102.17
2. 本期利润	-13,321,272.94	-2,926,580.03
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0094	-0.0042
4. 期末基金资产净值	2,435,725,896.56	1,140,714,638.38
5. 期末基金份额净值	1.267	1.257

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

嘉实多元债券 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	0.40%	0.25%	0.62%	0.07%	-0.22%	0.18%
过去六个月	2.01%	0.25%	2.50%	0.07%	-0.49%	0.18%
过去一年	3.94%	0.26%	3.45%	0.08%	0.49%	0.18%
过去三年	10.95%	0.39%	14.53%	0.08%	-3.58%	0.31%
过去五年	32.96%	0.39%	25.42%	0.10%	7.54%	0.29%
自基金合同	133.73%	0.34%	87.90%	0.12%	45.83%	0.22%

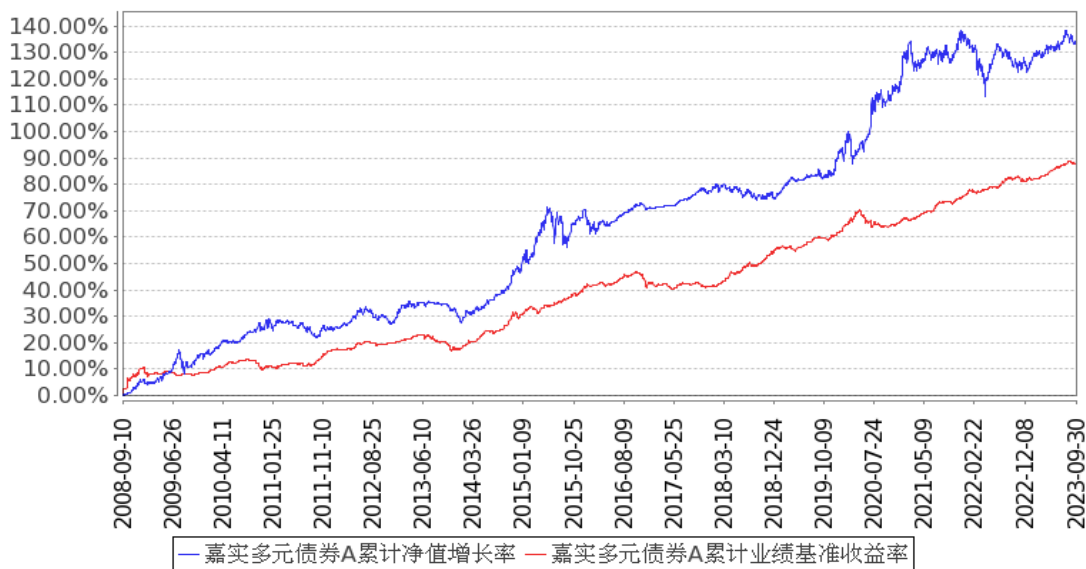
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

嘉实多元债券 B

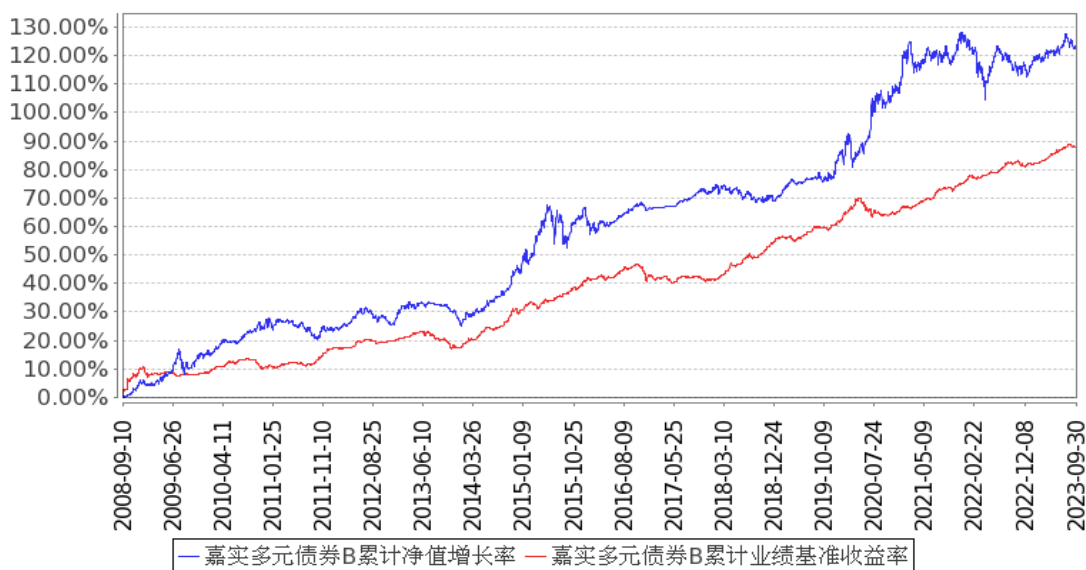
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.40%	0.25%	0.62%	0.07%	-0.22%	0.18%
过去六个月	1.86%	0.25%	2.50%	0.07%	-0.64%	0.18%
过去一年	3.71%	0.27%	3.45%	0.08%	0.26%	0.19%
过去三年	9.97%	0.39%	14.53%	0.08%	-4.56%	0.31%
过去五年	31.09%	0.39%	25.42%	0.10%	5.67%	0.29%
自基金合同生效起至今	122.97%	0.35%	87.90%	0.12%	35.07%	0.23%

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

嘉实多元债券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  
(2008年09月10日至2023年09月30日)



**嘉实多元债券B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**  
(2008年09月10日至2023年09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		
洪流	本基金、嘉实策略混合、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实阿尔法优选混合、嘉实品质优选股票、嘉实	2019年8月1日	-	24年	曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。现任平衡风格投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	兴锐优选一年持有期混合、嘉实欣荣混合 (LOF) 基金经理				
董福焱	本基金、嘉实策略混合、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实精选平衡混合基金经理	2022 年 5 月 21 日	-	13 年	曾任英国德勤会计师事务所审计师, 博时基金管理有限公司行业研究员, 天弘基金管理有限公司、长盛基金管理有限公司投资经理。2018 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司, 曾任职于上海 GARP 投资策略组, 现任基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格。中国国籍。
李宇昂	本基金、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券基金经理	2022 年 5 月 21 日	-	8 年	曾任招商基金管理有限公司固定收益投资部研究员, 宝盈基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、基金经理。2021 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司固收与配置组, 任投资经理。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、《嘉实多元收益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 2 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

报告期内，宏观经济方面稳增长、化风险政策频出，在政策的积极应对下，社融、PPI、PMI 等数据触底回升。海外方面，虽然非美发达经济体 PMI 承压，但美国经济数据较强，联储持续加息，美债收益率继续上行对全球市场造成一定影响。3 季度央行降息降准各一次，货币政策维持稳健灵活基调，资金整体保持平稳，9 月中下旬资金利率季节性的收紧。我们基于政策持续加码的预期和 PPI 阶段性拐点的判断，重点配置了顺周期类资产，包括受益于“政策发力修复资产信心”逻辑作用的资产负债表修复类资产上，如保险、地产、建筑；以及受益于“需求若恢复供给将有瓶颈”逻辑作用的上游资源类标的（煤炭、有色）。

报告期内，权益市场陷入减量博弈。打破减量博弈正反馈循环的关键变量来自增量资金；增量资金之所以愿意入场是因为看好人民币计价资产；人民币计价资产被看好的前提是其中占比最高、外部性影响大、预期最悲观的地产相关类资产价值预期稳住。因此与地产价值预期相关的资产中估值出清相对彻底的标的，大概率兼具赔率和胜率的机会。换言之，如果没有增量资金，这类已经 price in 相当程度悲观预期的标的下行空间相对有限；如果有增量资金，站在增量资金的角度，相较于赛道资产和科技类资产，选择这类标的对手盘力量相对较弱。

三季度债券市场走出震荡行情，利率先下后上，10y 国债收益率小幅上行 1bp，在降息期间一度下探至 2.6%以下，但从 8 月下旬至季末，在地产政策、资金面等因素的影响下持续震荡调整。信用方面，3YAAA 等信用品种收益率全季上行 9bp。

操作方面，报告期内，我们加配的版块是建筑地产和高股息资产，主要是为了应对减量博弈的市场状态。因为参考已经减量博弈数年的港股市场，其中有较明显相对和绝对优势的资产主要集中在高股息版块。主要加仓了保险、建筑；在券商、地产、银行做了波段操作；减仓了煤炭。

债券部分基于宏观和政策的判断，从 8 月起开始逐步降低组合久期和仓位，在调整中适当配置一些中短期的信用债。转债方面，组合灵活根据市场情况调整仓位，并对美债利率上行、地产政策放松等宏观因素做了仓位上的应对。品种上，还是选择化工、有色、汽车零部件、医药、机械、电新相关的中低价可转债投资，并灵活参与计算机、半导体、军工等转债的投资和交易。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实多元债券 A 基金份额净值为 1.267 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%；截至本报告期末嘉实多元债券 B 基金份额净值为 1.257 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.40%；业绩比较基准收益率为 0.62%。

#### 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	568,051,868.34	14.81
	其中：股票	568,051,868.34	14.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,211,411,642.59	83.72
	其中：债券	3,211,411,642.59	83.72
	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	32,574,198.35	0.85
8	其他资产	23,857,686.30	0.62
9	合计	3,835,895,395.58	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	157,703,535.13	4.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,955,598.48	0.50
E	建筑业	58,150,000.00	1.63
F	批发和零售业	32,518,434.08	0.91
G	交通运输、仓储和邮政业	12,240,000.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-



I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,611,920.65	0.52
J	金融业	209,075,505.65	5.85
K	房地产业	61,357,134.35	1.72
L	租赁和商务服务业	439,740.00	0.01
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	568,051,868.34	15.88

### 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	600030	中信证券	3,500,045	75,810,974.70	2.12
2	601318	中国平安	1,000,000	48,300,000.00	1.35
3	601601	中国太保	1,344,203	38,430,763.77	1.07
4	601628	中国人寿	800,043	29,009,559.18	0.81
5	600376	首开股份	7,024,915	28,731,902.35	0.80
6	601186	中国铁建	3,000,000	26,190,000.00	0.73
7	000002	万科 A	2,000,400	26,165,232.00	0.73
8	601800	中国交建	2,000,000	18,320,000.00	0.51
9	000651	格力电器	500,000	18,150,000.00	0.51
10	601881	中国银河	1,484,200	16,311,358.00	0.46

### 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	295,640,108.57	8.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,582,444,229.24	44.25
	其中：政策性金融债	574,720,687.86	16.07
4	企业债券	71,857,795.35	2.01
5	企业短期融资券	111,826,104.91	3.13
6	中期票据	443,230,990.74	12.39
7	可转债（可交换债）	706,412,413.78	19.75
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	3,211,411,642.59	89.79
----	----	------------------	-------

#### 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	230202	23 国开 02	1,500,000	153,459,328.77	4.29
2	019709	23 国债 16	1,200,000	119,900,876.71	3.35
3	1828012	18 中信银行二级 02	1,100,000	115,113,975.34	3.22
4	180322	18 进出 22	1,100,000	114,992,915.07	3.22
5	230301	23 进出 01	1,000,000	101,394,590.16	2.84

#### 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、中信证券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。

### 5.10.2 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	284,068.70
2	应收证券清算款	13,031,104.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,542,512.84
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	23,857,686.30

### 5.10.4 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	110059	浦发转债	15,389,808.13	0.43
2	123151	康医转债	12,261,525.11	0.34
3	127069	小熊转债	11,040,998.46	0.31
4	123085	万顺转 2	10,393,587.72	0.29
5	111000	起帆转债	10,139,472.77	0.28
6	123063	大禹转债	10,057,551.77	0.28
7	113021	中信转债	9,454,319.51	0.26
8	127055	精装转债	9,347,344.30	0.26
9	113637	华翔转债	9,296,082.36	0.26
10	123120	隆华转债	9,061,383.61	0.25
11	127006	敖东转债	8,848,104.77	0.25
12	113654	永 02 转债	8,356,898.35	0.23
13	123169	正海转债	8,321,079.52	0.23
14	128017	金禾转债	8,285,969.82	0.23
15	110074	精达转债	8,117,691.65	0.23
16	128044	岭南转债	8,026,867.38	0.22
17	127043	川恒转债	7,891,856.47	0.22
18	127078	优彩转债	7,843,845.65	0.22
19	128095	恩捷转债	7,839,864.63	0.22
20	113618	美诺转债	7,584,053.26	0.21
21	110091	合力转债	7,582,491.36	0.21
22	123130	设研转债	7,557,850.18	0.21
23	113664	大元转债	7,548,097.47	0.21

24	127075	百川转 2	7,537,177.20	0.21
25	113064	东材转债	7,497,615.12	0.21
26	123131	奥飞转债	7,254,334.08	0.20
27	113535	大业转债	7,235,225.36	0.20
28	127073	天赐转债	6,994,638.75	0.20
29	113050	南银转债	6,865,016.73	0.19
30	128109	楚江转债	6,852,593.18	0.19
31	123114	三角转债	6,848,024.22	0.19
32	113655	欧 22 转债	6,783,781.81	0.19
33	127060	湘佳转债	6,561,184.02	0.18
34	123078	飞凯转债	6,500,113.32	0.18
35	118011	银微转债	6,459,655.31	0.18
36	128083	新北转债	6,419,235.17	0.18
37	123156	博汇转债	6,069,808.52	0.17
38	123022	长信转债	6,069,030.79	0.17
39	113663	新化转债	6,023,127.73	0.17
40	132018	G 三峡 EB1	5,892,071.23	0.16
41	113039	嘉泽转债	5,705,074.70	0.16
42	113647	禾丰转债	5,703,329.98	0.16
43	123158	宙邦转债	5,555,131.44	0.16
44	128119	龙大转债	5,554,187.48	0.16
45	127058	科伦转债	5,491,783.91	0.15
46	110092	三房转债	5,467,395.66	0.15
47	118022	锂科转债	5,446,726.00	0.15
48	127030	盛虹转债	5,418,327.56	0.15
49	127044	蒙娜转债	5,367,710.11	0.15
50	123168	惠云转债	5,132,669.88	0.14
51	118013	道通转债	5,011,047.81	0.14
52	110086	精工转债	4,900,442.44	0.14
53	113648	巨星转债	4,861,119.46	0.14
54	113048	晶科转债	4,836,233.24	0.14
55	111012	福新转债	4,831,195.07	0.14
56	110093	神马转债	4,702,289.32	0.13
57	118017	深科转债	4,658,824.68	0.13
58	110073	国投转债	4,622,103.18	0.13
59	110089	兴发转债	4,578,204.39	0.13
60	110068	龙净转债	4,459,078.14	0.12
61	127050	麒麟转债	4,441,671.06	0.12
62	113058	友发转债	4,400,994.37	0.12
63	118003	华兴转债	4,400,509.41	0.12
64	110079	杭银转债	4,340,411.95	0.12
65	113549	白电转债	4,320,886.61	0.12

66	127066	科利转债	4,256,378.08	0.12
67	113651	松霖转债	4,181,566.50	0.12
68	113594	淳中转债	4,115,629.29	0.12
69	113602	景 20 转债	4,016,265.25	0.11
70	118031	天 23 转债	3,829,480.03	0.11
71	127012	招路转债	3,828,735.62	0.11
72	127053	豪美转债	3,788,486.99	0.11
73	123108	乐普转 2	3,773,239.50	0.11
74	123100	朗科转债	3,743,483.53	0.10
75	113046	金田转债	3,678,230.90	0.10
76	113609	永安转债	3,671,252.43	0.10
77	118021	新致转债	3,660,852.05	0.10
78	113662	豪能转债	3,631,618.67	0.10
79	113634	珀莱转债	3,566,936.56	0.10
80	123067	斯莱转债	3,554,363.69	0.10
81	127054	双箭转债	3,546,163.12	0.10
82	127022	恒逸转债	3,527,743.97	0.10
83	113657	再 22 转债	3,470,298.21	0.10
84	123154	火星转债	3,449,297.99	0.10
85	110085	通 22 转债	3,436,558.00	0.10
86	127071	天箭转债	3,416,806.69	0.10
87	113534	鼎胜转债	3,351,216.99	0.09
88	113601	塞力转债	3,348,982.92	0.09
89	113605	大参转债	3,344,399.55	0.09
90	113030	东风转债	3,328,541.06	0.09
91	113051	节能转债	3,292,762.11	0.09
92	118015	芯海转债	3,226,873.62	0.09
93	110055	伊力转债	3,220,075.36	0.09
94	113505	杭电转债	3,217,708.17	0.09
95	128037	岩土转债	3,173,914.26	0.09
96	110087	天业转债	3,161,167.24	0.09
97	113025	明泰转债	3,100,662.05	0.09
98	127040	国泰转债	3,085,849.84	0.09
99	128137	洁美转债	3,067,206.85	0.09
100	128049	华源转债	3,061,073.15	0.09
101	113640	苏利转债	3,036,023.76	0.08
102	123152	润禾转债	2,883,672.46	0.08
103	118024	冠宇转债	2,866,691.40	0.08
104	123157	科蓝转债	2,728,707.24	0.08
105	110075	南航转债	2,712,958.13	0.08
106	123164	法本转债	2,711,278.80	0.08
107	113033	利群转债	2,707,220.47	0.08

108	123090	三诺转债	2,680,126.13	0.07
109	113524	奇精转债	2,636,246.22	0.07
110	113598	法兰转债	2,448,549.85	0.07
111	113545	金能转债	2,409,945.21	0.07
112	123162	东杰转债	2,251,778.46	0.06
113	123132	回盛转债	2,189,702.34	0.06
114	127049	希望转 2	2,186,038.90	0.06
115	127077	华宏转债	2,079,781.79	0.06
116	113052	兴业转债	2,063,874.52	0.06
117	123088	威唐转债	1,998,195.21	0.06
118	123071	天能转债	1,936,892.47	0.05
119	123048	应急转债	1,930,910.18	0.05
120	118029	富淼转债	1,929,994.82	0.05
121	123170	南电转债	1,882,136.19	0.05
122	128130	景兴转债	1,847,871.75	0.05
123	123092	天壕转债	1,834,730.80	0.05
124	128023	亚太转债	1,771,031.23	0.05
125	127029	中钢转债	1,687,375.29	0.05
126	123160	泰福转债	1,355,977.91	0.04
127	132026	G 三峡 EB2	1,344,320.88	0.04
128	110058	永鼎转债	1,276,822.36	0.04
129	110064	建工转债	1,174,996.96	0.03
130	113641	华友转债	1,160,283.90	0.03
131	128021	兄弟转债	1,116,652.72	0.03
132	113519	长久转债	1,103,392.22	0.03
133	127019	国城转债	1,016,864.38	0.03
134	127076	中宠转 2	969,940.31	0.03
135	127033	中装转 2	958,573.97	0.03
136	127027	能化转债	877,205.20	0.02
137	113658	密卫转债	805,884.18	0.02
138	127016	鲁泰转债	799,371.97	0.02
139	111005	富春转债	603,788.01	0.02
140	127059	永东转 2	594,808.26	0.02
141	123179	立高转债	501,567.71	0.01
142	113619	世运转债	259,660.36	0.01
143	123146	中环转 2	137,945.56	0.00
144	123091	长海转债	101,764.71	0.00
145	111004	明新转债	1,339.13	0.00

#### 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

项目	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
报告期期初基金份额总额	807,145,425.72	539,991,493.93
报告期期间基金总申购份额	1,209,553,109.48	553,089,182.14
减：报告期期间基金总赎回份额	94,521,650.91	185,507,659.69
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	1,922,176,884.29	907,573,016.38

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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会《关于核准嘉实多元收益债券型证券投资基金募集的批复》；
- (2) 《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实多元收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实多元收益债券型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) 报告期内嘉实多元收益债券型证券投资基金公告的各项原稿。

### 8.2 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

### 8.3 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 10 月 24 日