

嘉实新添益定期开放混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 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 2024 年 01 月 17 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 10 月 01 日起至 2023 年 12 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	44,777,084.26 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	44,055,513.61 份	721,570.65 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 10 月 1 日-2023 年 12 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	-210,090.53	-4,610.54
2. 本期利润	-121,899.56	-3,206.72
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0028	-0.0044
4. 期末基金资产净值	52,371,461.75	835,418.48
5. 期末基金份额净值	1.1888	1.1578

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	-0.23%	0.20%	0.12%	0.13%	-0.35%	0.07%
过去六个月	-1.39%	0.20%	0.12%	0.13%	-1.51%	0.07%
过去一年	1.17%	0.20%	2.30%	0.13%	-1.13%	0.07%
过去三年	2.19%	0.30%	5.41%	0.17%	-3.22%	0.13%
自基金合同	18.88%	0.29%	16.01%	0.17%	2.87%	0.12%

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	-0.38%	0.20%	0.12%	0.13%	-0.50%	0.07%
过去六个月	-1.69%	0.20%	0.12%	0.13%	-1.81%	0.07%
过去一年	0.57%	0.20%	2.30%	0.13%	-1.73%	0.07%
过去三年	0.36%	0.30%	5.41%	0.17%	-5.05%	0.13%
自基金合同生效起至今	15.78%	0.29%	16.01%	0.17%	-0.23%	0.12%

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12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12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、嘉实方舟一年持有期混合、嘉实同舟债券基金经理	2021年8月24日	-	13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 5 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

四季度，经济发展波浪式前进，经济核心指标持续修复。从统计局公布的最新经济数据来看，经济处于波动复苏阶段。供给侧复苏较为平稳、结构性亮点突出，需求侧略有起伏。具体来看，工业生产持续复苏，1-10 月规模以上工业增加值同比增长小幅加快，装备制造业生产增速持续回升；工业企业利润持续修复，在营收、利润率两方面均有所改善，累计跌幅连续第八个月收窄。需求端：消费方面，社消零售总额增速持续上涨，商品消费、服务消费双提速；投资方面，全国固定资产投资增速延续放缓，但民间投资跌幅有所收窄；进出口方面，跌幅同比小幅扩大，进口增速转正，贸易顺差缩小，结构上也体现出高质量发展的特征。此外，从价格因素来看，PPI 同比降幅较为稳定，10 月 PPI 累计同比-3.1%，与 1-9 月持平。随着国内经济波浪式复苏的逐步推进，需求的逐步恢复也定会将是价格回复的良剂。我们预计后续经济将延续恢复向好的态势，PPI 同比增速有望继续回升。

利好政策陆续出台。为巩固经济持续恢复向好趋势，11 月份利好政策仍在持续出台。货币政

策方面，三季度货币政策报告落实中央金融工作会议基调，坚持稳健的货币政策取向，未来支撑经济稳健发展力度有望增强。财政政策方面，积极的财政政策进一步发力提效的同时，继续做好防范化解地方债务风险的工作。地产政策方面，相关刺激政策持续出台，金融支持房地产力度不断加大，多家金融机构召开房企座谈会，多地出台多举措楼市新政。12 月中央经济工作会议部署明年工作，政策定调更加积极且提前落地概率加大，有助于稳定预期和助力中长期经济继续企稳向好。

上市公司盈利增速转正。在宏观经济恢复向好的同时，上市公司三季度利润增速也成功实现了由负转正，业绩底逐步得到确认。从净利润增速来看，受 2022 年三季度的低基数影响，2023 年三季度 A 股上市公司单季净利润同比增速有明显改善，整体利润增速实现由负转正。2023 年三季度 A 股上市公司单季净利润增速为 2.2%（2023Q2 单季净利润增速为-7.8%）。从盈利能力来看，2023 年三季度全部 A 股非金融两油上市公司 ROE（TTM）较二季度持平。

股票方面，受制于微观资金格局和参与者对政策落地的节奏的担心，指数重回底部震荡。四季度 A 股三大股指皆回落，上证指数、深证成指、创业板指分别-4.4%、-3.8%、-5.6%。四季度北上资金净流出，同时国内公募基金等机构资金面的负反馈仍在持续，受外资和公募基金青睐较多的基金重仓股面临较严重的流动性缺失问题，在流动性分化加剧后，小市值股票流动性边际转好，进一步强化了今年以来中小市值股票跑赢大市值股票的趋势。

债券方面，10 月下旬至今，汇率压力暂缓但政府债券供给扰动仍在，叠加财政投放偏慢，市场对资金面稳定性担忧延续，年末政策托底预期再起，制约债市表现，利率转向震荡。进入 12 月，债市信息多空交织，市场静待关键会议信号。随后中央经济工作会议召开，强调高质量发展，叠加资金面回归平稳，做多情绪再度升温，利率全面下行。

操作上，泛权益方面，组合以量化策略的思路配置较高期权价值的平衡型和偏债型转债为主，操作上基于转债的凸性和期权价值进行交易，进一步提高了个券分散度。转股溢价率在四季度持续压缩，我们降低了偏股型转债的仓位以应对回撤。股票方面，在权益细分资产内部配置方面，组合配置了具备一定确定性溢价、高现金流、高股息资产，以期增强组合的防守属性。另外我们以追求获得长期稳定的超额收益以及正收益的主要目的，通过定性和定量结合的办法进行择股，主动适应不同的市场风格，提高选股胜率和赔率，持股较为分散。纯债方面，考虑到四季度资金面仍存在较大不确定性；市场在期待货币政策释放利好信号的可能，组合在 10 月和 11 月短久期的票息资产，并在 12 月份积极参与债市调整中带来的利率债波段机会。

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 1.1888 元，本报告期基金份额净值增

长率为-0.23%；截至本报告期末嘉实新添益定期混合 C 基金份额净值为 1.1578 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.38%；业绩比较基准收益率为 0.12%。

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	2,440,769.00	3.11
	其中：股票	2,440,769.00	3.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	72,035,392.19	91.73
	其中：债券	72,035,392.19	91.73
	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	1,987,587.65	2.53
8	其他资产	2,063,510.44	2.63
9	合计	78,527,259.28	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	10,842.00	0.02
B	采矿业	173,472.00	0.33
C	制造业	1,383,436.00	2.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,936.00	0.04
E	建筑业	64,630.00	0.12
F	批发和零售业	101,198.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	143,498.00	0.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	141,917.00	0.27
J	金融业	237,148.00	0.45

K	房地产业	21,599.00	0.04
L	租赁和商务服务业	32,541.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	21,735.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	21,504.00	0.04
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	65,313.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	2,440,769.00	4.59

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	601088	中国神华	1,500	47,025.00	0.09
2	601000	唐山港	12,500	43,750.00	0.08
3	000960	锡业股份	2,700	38,664.00	0.07
4	600028	中国石化	6,900	38,502.00	0.07
5	600282	南钢股份	10,200	37,740.00	0.07
6	601006	大秦铁路	4,800	34,608.00	0.07
7	600985	淮北矿业	2,000	33,260.00	0.06
8	600350	山东高速	4,700	32,618.00	0.06
9	002048	宁波华翔	2,500	32,525.00	0.06
10	000651	格力电器	1,000	32,170.00	0.06

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	12,439,434.05	23.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	36,217,229.91	68.07
5	企业短期融资券	519,253.93	0.98
6	中期票据	6,147,868.20	11.55
7	可转债（可交换债）	16,711,606.10	31.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	72,035,392.19	135.39

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	019705	23 国债 12	48,000	4,844,671.56	9.11
2	019725	23 国债 22	35,000	3,544,272.60	6.66
3	019724	23 国债 21	27,000	2,727,158.30	5.13
4	188721	21 金坛 03	26,000	2,640,530.37	4.96
5	175644	21 诸资 01	25,000	2,580,330.14	4.85

**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**

本基金国债期货操作主要以对冲现有持仓的久期风险为主，基于对利率债市场的判断和曲线形态进行择时套期保值。

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

本期通过套期保值操作对组合其他债券资产的波动进行了对冲，力争实现风险与收益的平衡。

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

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。

5.11.2 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	11,110.45
2	应收证券清算款	2,052,399.99
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	2,063,510.44

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	128035	大族转债	352,576.79	0.66
2	113065	齐鲁转债	314,060.86	0.59
3	110073	国投转债	283,610.96	0.53
4	113606	荣泰转债	250,646.87	0.47
5	127068	顺博转债	245,989.04	0.46
6	113629	泉峰转债	233,638.81	0.44
7	127034	绿茵转债	217,188.03	0.41
8	123165	回天转债	215,123.63	0.40
9	113625	江山转债	213,394.55	0.40
10	123144	裕兴转债	207,866.08	0.39
11	127044	蒙娜转债	202,895.16	0.38
12	128131	崇达转 2	197,120.47	0.37
13	127073	天赐转债	187,199.34	0.35
14	123093	金陵转债	171,807.58	0.32
15	127055	精装转债	170,737.26	0.32
16	113056	重银转债	169,816.32	0.32
17	128074	游族转债	155,368.88	0.29
18	132018	G 三峡 EB1	154,562.60	0.29
19	127037	银轮转债	153,600.01	0.29

20	128127	文科转债	151,575.77	0.28
21	123104	卫宁转债	149,153.73	0.28
22	128105	长集转债	147,670.78	0.28
23	127061	美锦转债	142,434.63	0.27
24	118025	奕瑞转债	142,390.49	0.27
25	123076	强力转债	142,279.30	0.27
26	113610	灵康转债	140,636.49	0.26
27	123192	科思转债	140,372.93	0.26
28	128116	瑞达转债	139,818.27	0.26
29	113021	中信转债	136,951.28	0.26
30	113063	赛轮转债	134,935.75	0.25
31	128042	凯中转债	133,291.74	0.25
32	127012	招路转债	132,202.34	0.25
33	127054	双箭转债	132,187.37	0.25
34	113593	沪工转债	131,320.35	0.25
35	127052	西子转债	127,862.57	0.24
36	123186	志特转债	124,093.78	0.23
37	110088	淮 22 转债	123,979.26	0.23
38	128066	亚泰转债	123,605.34	0.23
39	123159	崧盛转债	123,376.57	0.23
40	110048	福能转债	121,039.67	0.23
41	123127	耐普转债	120,168.16	0.23
42	118032	建龙转债	119,567.40	0.22
43	123153	英力转债	119,199.10	0.22
44	123147	中辰转债	119,048.05	0.22
45	127047	帝欧转债	118,746.37	0.22
46	113648	巨星转债	117,803.46	0.22
47	113668	鹿山转债	117,189.03	0.22
48	110045	海澜转债	116,753.83	0.22
49	123168	惠云转债	116,551.29	0.22
50	110047	山鹰转债	116,355.76	0.22
51	123048	应急转债	115,185.14	0.22
52	118000	嘉元转债	114,815.10	0.22
53	123082	北陆转债	114,639.06	0.22
54	132026	G 三峡 EB2	114,306.90	0.21
55	123107	温氏转债	113,921.38	0.21
56	123087	明电转债	113,570.22	0.21
57	113532	海环转债	110,791.82	0.21
58	128108	蓝帆转债	110,593.56	0.21
59	123050	聚飞转债	110,177.10	0.21
60	127085	韵达转债	109,546.16	0.21
61	123143	胜蓝转债	108,726.60	0.20

62	123088	威唐转债	108,211.01	0.20
63	113637	华翔转债	108,021.01	0.20
64	128119	龙大转债	107,754.21	0.20
65	113643	风语转债	107,532.68	0.20
66	123063	大禹转债	107,359.47	0.20
67	113662	豪能转债	107,072.10	0.20
68	123194	百洋转债	107,031.75	0.20
69	113566	翔港转债	106,821.98	0.20
70	123100	朗科转债	106,270.02	0.20
71	113619	世运转债	106,148.39	0.20
72	118011	银微转债	105,307.86	0.20
73	110070	凌钢转债	105,306.85	0.20
74	127076	中宠转 2	105,238.86	0.20
75	123010	博世转债	105,100.50	0.20
76	110093	神马转债	105,011.78	0.20
77	127071	天箭转债	104,875.71	0.20
78	123128	首华转债	104,859.77	0.20
79	128071	合兴转债	104,453.84	0.20
80	123035	利德转债	104,405.34	0.20
81	123172	漱玉转债	104,208.84	0.20
82	113066	平煤转债	103,694.05	0.19
83	128063	未来转债	103,205.97	0.19
84	118004	博瑞转债	103,148.84	0.19
85	123149	通裕转债	102,634.51	0.19
86	123171	共同转债	100,419.50	0.19
87	113524	奇精转债	100,279.12	0.19
88	123130	设研转债	98,737.42	0.19
89	111002	特纸转债	98,714.08	0.19
90	113602	景 20 转债	98,589.92	0.19
91	123090	三诺转债	98,004.93	0.18
92	128123	国光转债	96,543.56	0.18
93	128039	三力转债	96,472.79	0.18
94	127084	柳工转 2	96,002.19	0.18
95	127059	永东转 2	95,913.95	0.18
96	123184	天阳转债	95,885.39	0.18
97	123146	中环转 2	95,870.19	0.18
98	123011	德尔转债	95,049.64	0.18
99	118026	利元转债	94,343.23	0.18
100	128130	景兴转债	93,739.51	0.18
101	113058	友发转债	93,514.85	0.18
102	113623	风 21 转债	93,285.92	0.18
103	128044	岭南转债	91,290.96	0.17

104	113530	大丰转债	91,016.97	0.17
105	127045	牧原转债	90,737.58	0.17
106	127042	嘉美转债	89,686.25	0.17
107	113669	景 23 转债	89,549.14	0.17
108	118013	道通转债	88,949.24	0.17
109	113609	永安转债	87,656.65	0.16
110	127033	中装转 2	87,259.08	0.16
111	110063	鹰 19 转债	87,231.56	0.16
112	113639	华正转债	87,086.88	0.16
113	113600	新星转债	86,647.36	0.16
114	123089	九洲转 2	85,642.32	0.16
115	127053	豪美转债	84,599.85	0.16
116	123120	隆华转债	84,170.31	0.16
117	123196	正元转 02	80,397.17	0.15
118	113601	塞力转债	79,739.09	0.15
119	123092	天壕转债	79,705.78	0.15
120	113542	好客转债	75,808.86	0.14
121	127007	湖广转债	68,933.84	0.13
122	123131	奥飞转债	68,839.73	0.13
123	111012	福新转债	62,600.34	0.12
124	118029	富淼转债	60,056.05	0.11
125	127077	华宏转债	58,771.90	0.11
126	127035	濮耐转债	57,776.64	0.11
127	123151	康医转债	56,981.19	0.11
128	110079	杭银转债	54,128.73	0.10
129	127020	中金转债	53,546.24	0.10
130	113632	鹤 21 转债	53,363.16	0.10
131	123198	金埔转债	52,054.69	0.10
132	123175	百畅转债	43,742.32	0.08
133	110092	三房转债	38,556.48	0.07
134	110081	闻泰转债	36,027.50	0.07
135	118031	天 23 转债	35,609.60	0.07
136	113596	城地转债	33,206.50	0.06
137	113049	长汽转债	1,077.10	0.00

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	43,285,749.98	726,572.22
报告期期间基金总申购份额	835,102.71	-
减：报告期期间基金总赎回份额	65,339.08	5,001.57
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	44,055,513.61	721,570.65

§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（%）	38.20	-

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	2023-10-01 至 2023-12-31	16,827,367.10	-	-	16,827,367.10	37.58

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

2024 年 1 月 19 日