

# 嘉实新添丰定期开放混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 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 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 嘉实新添丰定期混合  |
| 基金主代码      | 004916   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2017 年 8 月 23 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 67,296,646.84 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       | 一) 封闭期投资策略<br>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、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。<br>二) 开放期投资策略<br>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。 |
| 业绩比较基准     | 沪深 300 指数收益率×40% + 中债综合财富指数收益率×60%   |
| 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

中国银行股份有限公司

### §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7月1日-2024年9月30日） |
|-----------------|---------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 375,593.55                |
| 2. 本期利润         | 277,824.07                |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0056                    |
| 4. 期末基金资产净值     | 87,875,329.78             |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.3058                    |

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

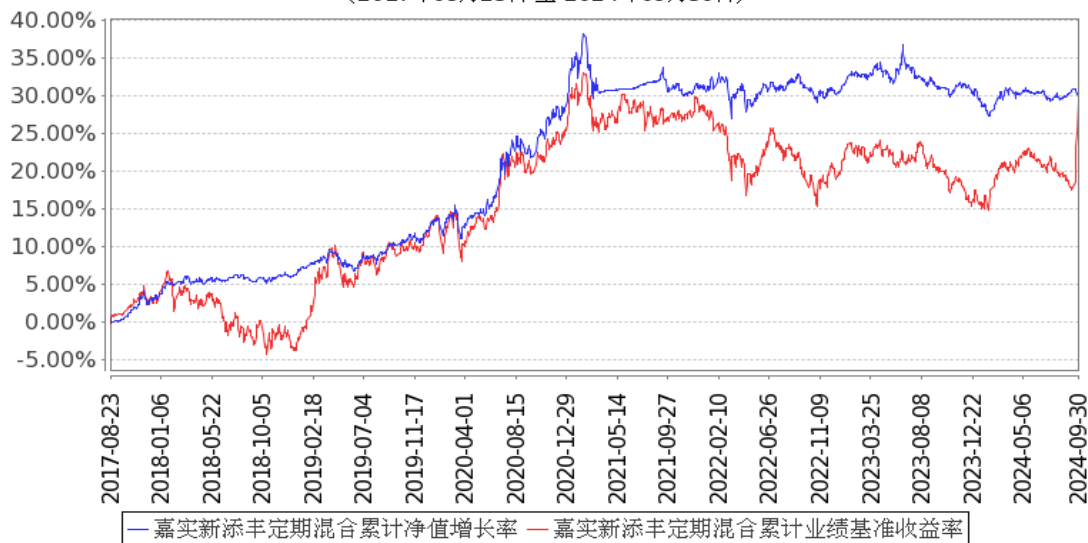
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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          | -0.05%     | 0.13%         | 6.92%          | 0.60%                 | -6.97% | -0.47% |
| 过去六个月          | -0.23%     | 0.13%         | 7.15%          | 0.48%                 | -7.38% | -0.35% |
| 过去一年           | -0.44%     | 0.17%         | 7.64%          | 0.43%                 | -8.08% | -0.26% |
| 过去三年           | -0.08%     | 0.25%         | 1.65%          | 0.43%                 | -1.73% | -0.18% |
| 过去五年           | 18.57%     | 0.31%         | 18.77%         | 0.46%                 | -0.20% | -0.15% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 30.58%     | 0.28%         | 29.11%         | 0.48%                 | 1.47%  | -0.20% |

##### 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

### 嘉实新添丰定期混合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

(2017年08月23日至2024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 |        |   |
| 王夫乐 | 本基金、嘉实新起点混合、嘉实新思路混合、嘉实润泽量化定期混合基金经理 | 2022年12月21日 | -    | 6年     | 2018年8月加入嘉实基金管理有限公司，历任博士后科研工作站研究员、平台债券组策略研究员。博士研究生，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。

（3）2024年10月10日，本基金管理人发布《关于新增嘉实新添丰定期混合基金经理的公告》，新增吴翠女士担任本基金基金经理，与王夫乐先生共同管理本基金。

## 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、《嘉实新添丰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 1 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，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

三季度内，经济延续上半年的下行势头，除出口外，消费、地产等经济板块均表现疲弱，5 月中旬的地产新政对房地产市场的提振有限，三季度的地产交易明显低于往年同期水平。同期社零增速低于 3%，居民储蓄意愿依然较强。出口表现相对较好，7、8 月出口规模均处于疫情以来高点附近。

基于“弱现实”的预期，同期的资本市场一直维持“债强股弱”总基调。央行通过公告借入债券等政策加强对债券收益率下行过快的干预，一度导致债券利率向上反弹；随后，日本央行货币政策变动与我国央行买卖国债行为加剧了股、债下跌压力；但随着我国央行对利率管控减弱，利率在 8 月中旬便重回下行通道，股票市场则在投资者对经济悲观预期影响下进一步下行。临近季末，美联储正式开启降息后不久，金融三部委在国新办新闻发布会上，直接推出宽货币政策、房地产政策，剑指低迷的股市和房市，投资者预期即日快速扭转，市场情绪急速回转，上证指数以巨大交易量快速突破 3300 点，而在股债跷跷板作用之下，仅一周左右的时间，10Y 国债活跃券

收益率大幅上行，直至季末国债收益和大盘指数均处于高位。

组合上，基于基本面的判断和政策宽松的现实，基本维持较长久期的基本配置，在结构上在中长端和短端做防御性交易；同时低配部分可转债，保持组合的灵活性。

#### 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 1.3058 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.05%，业绩比较基准收益率为 6.92%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 7 月 31 日；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

在迷你基金期间，由本基金管理人承担本基金信息披露费、审计费等费用。

## §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            | 84,348,799.72 | 94.62        |
|    | 其中：债券             | 84,348,799.72 | 94.62        |
|    | 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          | 1,485,620.31  | 1.67         |
|    | 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      | 1,688,814.21  | 1.89         |
| 8  | 其他资产              | 1,622,717.11  | 1.82         |
| 9  | 合计                | 89,145,951.35 | 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      | 69,222,730.45 | 78.77        |
| 2  | 央行票据      | -             | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,657,443.56  | 4.16         |
|    | 其中：政策性金融债 | 3,657,443.56  | 4.16         |
| 4  | 企业债券      | -             | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -            |
| 6  | 中期票据      | 3,062,432.98  | 3.48         |
| 7  | 可转债（可交换债） | 8,406,192.73  | 9.57         |
| 8  | 同业存单      | -             | -            |
| 9  | 其他        | -             | -            |
| 10 | 合计        | 84,348,799.72 | 95.99        |

### 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  | 019733 | 24 国债 02 | 180,000 | 18,271,277.26 | 20.79        |
| 2  | 019741 | 24 国债 10 | 120,000 | 12,151,742.47 | 13.83        |
| 3  | 019739 | 24 国债 08 | 90,000  | 9,156,526.03  | 10.42        |
| 4  | 019748 | 24 国债 14 | 50,000  | 5,035,908.22  | 5.73         |
| 5  | 019706 | 23 国债 13 | 40,000  | 4,037,671.23  | 4.59         |

### 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**

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   | 13,289.26    |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,609,427.85 |
| 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      | 1,622,717.11 |

**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    | 985,133.84 | 1.12         |
| 2  | 128074 | 游族转债    | 559,525.34 | 0.64         |
| 3  | 113069 | 博 23 转债 | 370,818.25 | 0.42         |
| 4  | 118004 | 博瑞转债    | 366,185.34 | 0.42         |
| 5  | 128109 | 楚江转债    | 362,038.44 | 0.41         |
| 6  | 118013 | 道通转债    | 353,448.90 | 0.40         |
| 7  | 111018 | 华康转债    | 333,068.22 | 0.38         |
| 8  | 118024 | 冠宇转债    | 330,944.38 | 0.38         |
| 9  | 123071 | 天能转债    | 329,729.59 | 0.38         |
| 10 | 113663 | 新化转债    | 255,152.88 | 0.29         |
| 11 | 123035 | 利德转债    | 252,992.82 | 0.29         |
| 12 | 113637 | 华翔转债    | 249,960.55 | 0.28         |
| 13 | 128134 | 鸿路转债    | 222,592.88 | 0.25         |
| 14 | 110059 | 浦发转债    | 221,621.26 | 0.25         |
| 15 | 123169 | 正海转债    | 214,447.07 | 0.24         |
| 16 | 127098 | 欧晶转债    | 205,552.66 | 0.23         |
| 17 | 113059 | 福莱转债    | 205,427.40 | 0.23         |
| 18 | 128119 | 龙大转债    | 201,731.23 | 0.23         |
| 19 | 127022 | 恒逸转债    | 198,041.10 | 0.23         |
| 20 | 113021 | 中信转债    | 179,834.79 | 0.20         |
| 21 | 113065 | 齐鲁转债    | 144,701.61 | 0.16         |
| 22 | 127080 | 声迅转债    | 132,301.64 | 0.15         |
| 23 | 113598 | 法兰转债    | 131,289.73 | 0.15         |
| 24 | 110052 | 贵广转债    | 126,972.60 | 0.14         |
| 25 | 113050 | 南银转债    | 125,704.05 | 0.14         |
| 26 | 118030 | 睿创转债    | 118,971.37 | 0.14         |
| 27 | 111007 | 永和转债    | 118,069.04 | 0.13         |
| 28 | 113042 | 上银转债    | 113,478.11 | 0.13         |
| 29 | 110070 | 凌钢转债    | 110,079.59 | 0.13         |
| 30 | 127046 | 百润转债    | 109,226.58 | 0.12         |
| 31 | 127078 | 优彩转债    | 107,802.68 | 0.12         |
| 32 | 113542 | 好客转债    | 107,257.40 | 0.12         |
| 33 | 123085 | 万顺转 2   | 106,496.58 | 0.12         |
| 34 | 118042 | 奥维转债    | 102,435.59 | 0.12         |
| 35 | 113680 | 丽岛转债    | 102,260.27 | 0.12         |
| 36 | 118021 | 新致转债    | 72,799.38  | 0.08         |
| 37 | 127095 | 广泰转债    | 66,241.27  | 0.08         |
| 38 | 128090 | 汽模转 2   | 59,693.38  | 0.07         |
| 39 | 128121 | 宏川转债    | 52,164.92  | 0.06         |

#### 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

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 23,334,207.69 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 53,436,606.02 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 9,474,166.87  |
| 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               | 67,296,646.84 |

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。

### §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) 中国证监会准予嘉实新添丰定期开放混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实新添丰定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新添丰定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实新添丰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) 报告期内嘉实新添丰定期开放混合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

2024 年 10 月 25 日