

# 嘉实多利收益债券型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 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。

嘉实多利收益债券型证券投资基金由嘉实多利分级债券型证券投资基金转型而成。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.11 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
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 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	53
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</b>
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
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
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	嘉实多利收益债券型证券投资基金
基金简称	嘉实多利收益债券
场内简称	嘉实多利
基金主代码	160718
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 11 月 27 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	211,878,925.96 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金为达到控制基金组合风险，实现良好收益率的目标，会密切关注经济运行趋势，深入分析财政及货币政策对经济运行的影响，结合各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等方面因素，做出最佳的资产配置，在规避基金组合风险的同时进一步增强基金组合收益。主要投资策略包括：资产配置策略、信用债券投资策略、杠杆放大策略、其他债券投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率 × 90% + 沪深 300 指数收益率 × 10%
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

### 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95555
传真	(010)65215588	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

邮政编码	100005	518040
法定代表人	经雷	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-6,061,548.97
本期利润	-6,109,719.54
加权平均基金份额本期利润	-0.0460
本期加权平均净值利润率	-4.26%
本期基金份额净值增长率	-3.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	92,140,147.99
期末可供分配基金份额利润	0.4349
期末基金资产净值	234,772,078.54
期末基金份额净值	1.1080
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.23%

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

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去一个月	2.99%	0.26%	0.68%	0.11%	2.31%	0.15%
过去三个月	4.15%	0.67%	0.66%	0.15%	3.49%	0.52%
过去六个月	-3.19%	0.69%	-1.11%	0.17%	-2.08%	0.52%
过去一年	7.69%	0.60%	0.20%	0.15%	7.49%	0.45%
自基金合同生效起至今	8.23%	0.51%	2.14%	0.15%	6.09%	0.36%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 90\% * (\text{中债总全价指数}(t) / \text{中债总全价指数}(t-1) - 1) + 10\% * (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1)$$

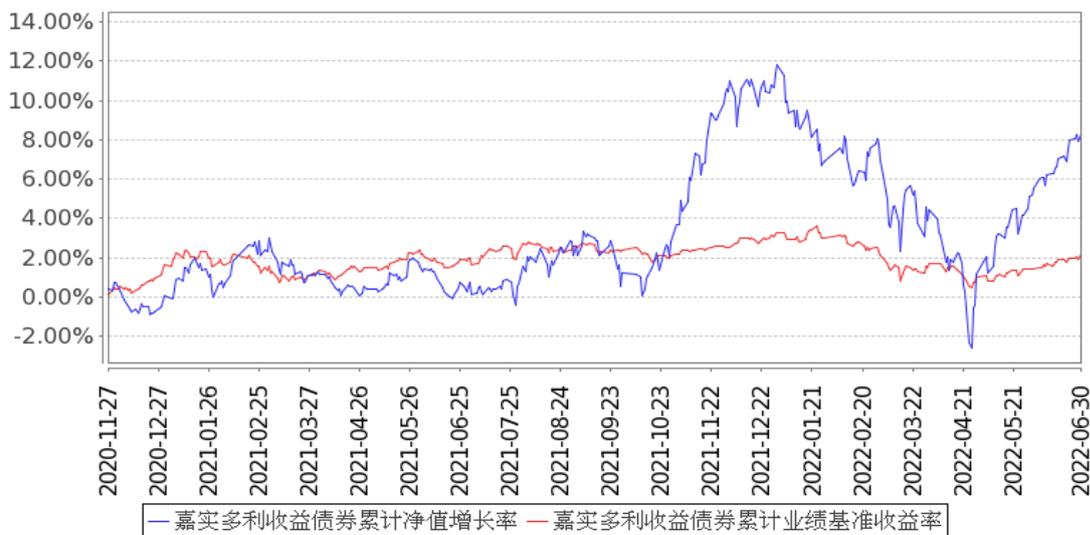
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截至日。

### 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

嘉实多利收益债券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

(2020年11月27日至2022年06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字[1999]5 号文批准, 于 1999 年 3 月 25 日成立, 是中国第一批基金管理公司之一, 是中外合资基金管理公司。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 2022 年 6 月 30 日, 基金管理人共管理 277 只开放式证券投资基金, 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 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		
韩同利	本基金基金经理	2022 年 6 月 23 日	-	21 年	曾任中国银行总行和香港分行交易员、组合投资经理, 美国太平洋投资管理公司基金经理、交银国际资产管理有限公司固定收益主管、复兴国际资产管理公司首席执行官、深蓝全球资产管理有限公司首席投资官。2021 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司, 现任固定收益部策略投资总监。纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士, CFA, 具有基金从业资格。中国香港籍。
罗伟卿	本基金基金经理	2020 年 11 月 28 日	-	10 年	历任嘉实基金管理有限公司宏观研究员, 北京高华证券有限责任公司固定收益投资主办, 嘉实基金管理有限公司固收投研体系债券投资经理。博士研究生, 具有基金从业资格。中国国籍。
王汉博	本基金基金经理	2020 年 11 月 28 日	2022 年 6 月 23 日	13 年	2008 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司, 历任研究部行业研究员、研究部新兴产业组组长、基金经理。现任资产配置负责人。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。

(3) 2022 年 7 月 19 日, 本基金管理人发布《关于新增嘉实多利收益债券基金经理的公告》, 聘请高群山先生担任本基金基金经理, 与韩同利先生、罗伟卿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、《嘉实多利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 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 4 次, 其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易, 另 3 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 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

2022 年上半年, 国内疫情出现反复, 上海等一二线城市严格的疫情防控对于 4-5 月份经济基本面产生了明显的负面影响, 叠加外围俄乌战事引发通货膨胀高企以及美联储货币政策持续收紧, 风险偏好明显下行且处于低位水平, 而 4 月下旬开始, 各方面政策旨在稳增长稳预期稳市场, 权益市场跌势企稳并且有所反弹, 债券收益率窄幅震荡。受制于内外形势, 政策面偏宽松, 尤其是货币政策方面, 4 月份降准幅度虽然低于市场预期但仍然有指向性作用, 银行间流动性维持宽松格局, 资金价格处于低位同时较为稳定。在报告期内, 多利的权益持仓风格从由以成长主导向风格与行业均衡方向进行了一定的切换, 买入部分资质较优且估值合理的品种作为中期配置仓位, 同时优选当年业绩确定性较强品种进行换仓。出于我们对于可转债估值总体处于高估状态的

判断，在开年和 5 月份反弹中对于可转债仓位进行了适度下调，减持部分正股估值较贵或者转债自身估值较贵的品种。纯债部分主要配置与交易利率债，由于收益率总体处于低位，同时波动幅度不大，交易空间有限，因此纯债操作以配置为主，在基金规模有所提高后，买入部分中短久期好资质的信用品种，适度提升了组合静态收益率，同时维持组合久期略低于市场中性水平。

#### 4.4.2 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 1.1080 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.19%，业绩比较基准收益率为-1.11%。

#### 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 2022 年下半年，随着大宗商品价格回落，全球面临的滞胀格局预计将会有所缓解，联储加息节奏对于全球流动性以及金融市场的负面影响有可能逐步缓解。国内来看，疫情大概率出现好转，至少疫情防控将会更加灵活，其对于社会经济活动的干扰预计也不会非常严重，经济基本面将会出现向潜在增长率的自然回复，企业盈利也将逐步见到底部，而大宗商品价格方面压力的缓解，除了能够缓解企业的成本压力之外，也会对权益市场估值形成一定的支撑。虽然年初制定的 5.5% 的 GDP 目标应当不会成为政策的硬约束，内外的诸多因素很可能会使得流动性总体处于合理充裕状态，信用扩张的进程并不一定会很顺利。从资产配置的角度来看，权益相比起债券更加具备配置价值，但是把握结构性行情机会会更为重要，政策的力度以及基本面回暖的时间与幅度都具有不确定性，因此超额回报大概率来自于业绩确定性较高的行业与标的，与稳增长有关的行业与板块可能存在阶段性行情；债券收益率水平总体处于低位区间，距离 2020 年货币极度宽松带来的收益率低点距离仅有 30bps 左右，目前很难看到债券收益率具备大幅下行的逻辑和空间；可转债的估值处于历史高位，也比较充分的反映了对于未来充裕流动性的预期，中长期配置价值有限。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利

益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易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，本基金未实施利润分配，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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：嘉实多利收益债券型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,043,644.14	21,466,767.82
结算备付金		410,784.86	313,329.30
存出保证金		32,129.37	11,284.55
交易性金融资产	6.4.7.2	242,050,859.45	137,059,668.86

其中：股票投资		24,935,196.76	22,469,690.05
基金投资		-	-
债券投资		217,115,662.69	114,589,978.81
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	-	6,000,000.00
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		649,008.01	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,085,218.98	58,790.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,493,126.85
资产总计		247,271,644.81	166,402,967.42
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		9,400,000.00	3,609,874.58
应付清算款		2,349,992.75	21,032,807.24
应付赎回款		498,030.71	20,331.29
应付管理人报酬		77,806.00	48,457.49
应付托管费		22,230.28	13,845.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		274.08	370.12
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	151,232.45	152,153.12
负债合计		12,499,566.27	24,877,838.84
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	139,242,821.68	81,267,125.37
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	95,529,256.86	60,258,003.21
净资产合计		234,772,078.54	141,525,128.58
负债和净资产总计		247,271,644.81	166,402,967.42

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1080 元，基金份额总额 211,878,925.96 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实多利收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-5,266,838.67	505,493.56
1. 利息收入		19,278.79	729,912.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	14,037.40	4,637.95
债券利息收入		-	723,899.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,241.39	1,374.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,256,041.39	1,201,646.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,273,254.58	885,909.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-66,238.25	159,401.56
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	83,451.44	156,335.88
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-48,170.57	-1,437,168.29
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	18,094.50	11,103.20
<b>减：二、营业总支出</b>		842,880.87	426,181.69
1. 管理人报酬		495,199.97	180,134.04
2. 托管费		141,485.65	51,466.78
3. 销售服务费		-	-

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		116,364.93	63,394.96
其中：卖出回购金融资产支出		116,364.93	63,394.96
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		193.32	18.22
8. 其他费用	6.4.7.23	89,637.00	131,167.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,109,719.54	79,311.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,109,719.54	79,311.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,109,719.54	79,311.87

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实多利收益债券型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	81,267,125.37	-	60,258,003.21	141,525,128.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	81,267,125.37	-	60,258,003.21	141,525,128.58
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	57,975,696.31	-	35,271,253.65	93,246,949.96

(一)、综合收益总额	-	-	-6,109,719.54	-6,109,719.54
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	57,975,696.31	-	41,380,973.19	99,356,669.50
其中:1.基金申购款	91,201,087.84	-	62,237,613.30	153,438,701.14
2.基金赎回款	-33,225,391.53	-	-20,856,640.11	-54,082,031.64
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	139,242,821.68	-	95,529,256.86	234,772,078.54
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021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(基金净值)	33,607,681.53	-	18,767,331.49	52,375,013.02
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	33,607,681.53	-	18,767,331.49	52,375,013.02
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	7,499,534.52	-	4,481,238.19	11,980,772.71
(一)、综合收益总额	-	-	79,311.87	79,311.87
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	7,499,534.52	-	4,401,926.32	11,901,460.84
其中:1.基金申购款	19,759,923.42	-	11,366,169.14	31,126,092.56
2.基金赎回款	-12,260,388.90	-	-6,964,242.82	-19,224,631.72
(三)、本期向基金份额持有	-	-	-	-

人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	41,107,216.05	-	23,248,569.68	64,355,785.73

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

嘉实多利收益债券型证券投资基金是根据原嘉实多利分级债券型证券投资基金(以下简称“嘉实多利”)基金份额持有人大会决议通过的《关于嘉实多利分级债券型证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]421号《关于准予嘉实多利分级债券型证券投资基金变更注册的批复》，由原嘉实多利转型而来。根据《关于嘉实多利分级债券型证券投资基金之嘉实多利优先份额、嘉实多利进取份额终止上市公告》和《嘉实基金管理有限公司关于嘉实多利分级债券型证券投资基金实施转型的公告》等有关规定，嘉实多利优先份额和嘉实多利进取份额于2020年11月26日终止上市。自2020年11月27日起，原嘉实多利正式变更为嘉实多利收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)。原《嘉实多利分级债券型证券投资基金基金合同》失效，《嘉实多利收益债券型证券投资基金基金合同》生效。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实多利收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

除下述变更的会计政策外,本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

#### 新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

#### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金

融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应

取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权

益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.4 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收申购款，金额分别为 21,466,767.82 元、313,329.30 元、11,284.55 元、6,000,000.00 元、1,493,126.85 元和 58,790.04 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收申

购款，金额分别为 21,467,244.28 元、313,484.40 元、11,290.05 元、6,000,000.00 元、0.00 元和 59,970.77 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 137,059,668.86 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 138,550,977.92 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,609,874.58 元、21,032,807.24 元、20,331.29 元、48,457.49 元、13,845.00 元、15,746.86 元、1,388.97 元和 135,017.29 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 3,611,263.55 元、21,032,807.24 元、20,331.29 元、48,457.49 元、13,845.00 元、15,746.86 元、0.00 元和 135,017.29 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按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。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

## 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022 年 6 月 30 日	
活期存款	2,043,644.14	
等于：本金	2,042,947.94	
加：应计利息	696.20	
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	2,043,644.14	

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	23,959,332.85	-	24,935,196.76	975,863.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	61,005,792.60	469,953.07	62,205,720.24	729,974.57
	银行间市场	152,187,231.91	2,818,942.45	154,909,942.45	-96,231.91
	合计	213,193,024.51	3,288,895.52	217,115,662.69	633,742.66
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	237,152,357.36	3,288,895.52	242,050,859.45	1,609,606.57	

## 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
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	186.71
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	29,101.08
其中：交易所市场	27,701.04
银行间市场	1,400.04
应付利息	-
预提费用	121,944.66
合计	151,232.45

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,659,287.74	81,267,125.37
本期申购	138,775,976.89	91,201,087.84
本期赎回（以“-”号填列）	-50,556,338.67	-33,225,391.53
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	211,878,925.96	139,242,821.68

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	59,767,304.68	490,698.53	60,258,003.21
本期利润	-6,061,548.97	-48,170.57	-6,109,719.54
本期基金份额交易产生的变动数	38,434,392.28	2,946,580.91	41,380,973.19
其中：基金申购款	61,826,633.12	410,980.18	62,237,613.30
基金赎回款	-23,392,240.84	2,535,600.73	-20,856,640.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	92,140,147.99	3,389,108.87	95,529,256.86

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	3,537.01
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	7,166.75
其他	3,333.64
合计	14,037.40

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-5,273,254.58
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	-5,273,254.58

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	26,630,353.40
减：卖出股票成本总额	31,832,097.95
减：交易费用	71,510.03
买卖股票差价收入	-5,273,254.58

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,436,437.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,502,676.24
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	-66,238.25

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	348,143,460.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	347,949,320.68
减：应计利息总额	1,681,223.84
减：交易费用	15,592.33
买卖债券差价收入	-1,502,676.24

## 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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	83,451.44
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	83,451.44

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-48,170.57
股票投资	695,076.90
债券投资	-743,247.47
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	-48,170.57

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	18,094.50
合计	18,094.50

## 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,092.34
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	89,637.00

## 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	495,199.97	180,134.04
其中：支付销售机构的客户维护费	41,330.42	20,759.87

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 0.70%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×0.70%/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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	141,485.65	51,466.78

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

无。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
招商银行股份有限公司活期	2,043,644.14	3,537.01	4,372,556.08	1,745.97

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

本期(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2022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

无。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 9,400,000.00 元，于 2022 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

本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。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 risk 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，还有董事会风险控制与内审委员会、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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

**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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	100,730,847.26	2,566,876.00
AAA 以下	12,088,398.49	38,498,617.11
未评级	-	-
合计	112,819,245.75	41,065,493.11

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

**6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

无。

**6.4.13.3.2 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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受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 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,043,644.14	-	-	-	2,043,644.14
结算备付金	410,784.86	-	-	-	410,784.86
存出保证金	32,129.37	-	-	-	32,129.37

交易性金融资产	57,946,574.20	86,642,113.08	72,526,975.41	24,935,196.76	242,050,859.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	649,008.01	649,008.01
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,085,218.98	2,085,218.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,433,132.57	86,642,113.08	72,526,975.41	27,669,423.75	247,271,644.81
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	9,400,000.00	-	-	-	9,400,000.00
应付清算款	-	-	-	2,349,992.75	2,349,992.75
应付赎回款	-	-	-	498,030.71	498,030.71
应付管理人报酬	-	-	-	77,806.00	77,806.00
应付托管费	-	-	-	22,230.28	22,230.28
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	274.08	274.08
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	151,232.45	151,232.45
负债总计	9,400,000.00	-	-	3,099,566.27	12,499,566.27
利率敏感度缺口	51,033,132.57	86,642,113.08	72,526,975.41	24,569,857.48	234,772,078.54
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,466,767.82	-	-	-	21,466,767.82
结算备付金	313,329.30	-	-	-	313,329.30
存出保证金	11,284.55	-	-	-	11,284.55
交易性金融资产	13,334,501.67	59,844,177.88	41,411,299.26	22,469,690.05	137,059,668.86
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,493,126.85	1,493,126.85
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	58,790.04	58,790.04
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	41,125,883.34	59,844,177.88	41,411,299.26	24,021,606.94	166,402,967.42
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	3,609,874.58	-	-	-	3,609,874.58
应付证券清算款	-	-	-	21,032,807.24	21,032,807.24
应付赎回款	-	-	-	20,331.29	20,331.29
应付管理人报酬	-	-	-	48,457.49	48,457.49
应付托管费	-	-	-	13,845.00	13,845.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	15,746.86	15,746.86
应付税费	-	-	-	370.12	370.12
应付利息	-	-	-	1,388.97	1,388.97
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	135,017.29	135,017.29
负债总计	3,609,874.58	-	-	21,267,964.26	24,877,838.84
利率敏感度缺口	37,516,008.76	59,844,177.88	41,411,299.26	2,753,642.68	141,525,128.58

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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,363,115.48	-1,197,762.79
	市场利率下降 25 个基点	1,382,627.78	1,218,809.15

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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

无。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	24,935,196.76	10.62	22,469,690.05	15.88
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	24,935,196.76	10.62	22,469,690.05	15.88

##### 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		
	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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	39,543,170.41	9,696,082.09

	业绩比较基准下降 5%	-39,543,170.41	-9,696,082.09
--	----------------	----------------	---------------

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	55,668,858.96	63,535,183.16
第二层次	186,382,000.49	73,524,485.70
第三层次	-	-
合计	242,050,859.45	137,059,668.86

###### 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。对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

## § 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	24,935,196.76	10.08
	其中：股票	24,935,196.76	10.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	217,115,662.69	87.80
	其中：债券	217,115,662.69	87.80
	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	2,454,429.00	0.99
8	其他各项资产	2,766,356.36	1.12
9	合计	247,271,644.81	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

金额单位：人民币元

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	19,724,787.36	8.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,640,562.00	0.70

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	726,958.00	0.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	793,210.00	0.34
J	金融业	893,237.40	0.38
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	512,446.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	643,996.00	0.27
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	24,935,196.76	10.62

### 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

金额单位：人民币元

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	600483	福能股份	116,600	1,640,562.00	0.70
2	002938	鹏鼎控股	52,600	1,589,046.00	0.68
3	688122	西部超导	14,683	1,353,772.60	0.58
4	002025	航天电器	17,700	1,235,814.00	0.53
5	600038	中直股份	25,000	1,130,000.00	0.48
6	300725	药石科技	9,600	950,304.00	0.40
7	002182	云海金属	37,600	943,008.00	0.40
8	603369	今世缘	18,000	918,000.00	0.39
9	603345	安井食品	5,400	906,498.00	0.39
10	300750	宁德时代	1,600	854,400.00	0.36
11	688006	杭可科技	11,993	840,229.58	0.36
12	002013	中航机电	60,000	741,000.00	0.32
13	300416	苏试试验	26,200	643,996.00	0.27
14	600958	东方证券	59,940	611,987.40	0.26
15	600702	舍得酒业	3,000	611,970.00	0.26
16	002984	森麒麟	18,700	581,757.00	0.25
17	600399	抚顺特钢	30,000	537,000.00	0.23
18	601888	中国中免	2,200	512,446.00	0.22

19	688390	固德威	1,525	477,340.25	0.20
20	600309	万华化学	4,900	475,251.00	0.20
21	300454	深信服	4,500	467,010.00	0.20
22	600388	ST 龙净	35,500	461,855.00	0.20
23	603707	健友股份	16,300	459,660.00	0.20
24	002036	联创电子	29,900	459,264.00	0.20
25	601111	中国国航	38,500	446,985.00	0.19
26	002216	三全食品	22,000	430,980.00	0.18
27	601633	长城汽车	11,000	407,440.00	0.17
28	603517	绝味食品	6,400	370,048.00	0.16
29	601012	隆基绿能	5,400	359,802.00	0.15
30	603668	天马科技	17,400	356,526.00	0.15
31	000519	中兵红箭	12,100	352,715.00	0.15
32	688187	时代电气	5,309	345,031.91	0.15
33	300496	中科创达	2,500	326,200.00	0.14
34	600600	青岛啤酒	3,000	311,760.00	0.13
35	000858	五粮液	1,500	302,895.00	0.13
36	603363	傲农生物	15,302	283,240.02	0.12
37	600029	南方航空	38,300	279,973.00	0.12
38	300724	捷佳伟创	3,000	268,050.00	0.11
39	600316	洪都航空	7,000	211,680.00	0.09
40	002559	亚威股份	27,000	198,450.00	0.08
41	601601	中国太保	6,000	141,180.00	0.06
42	601318	中国平安	3,000	140,070.00	0.06

## 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	600483	福能股份	2,162,591.00	1.53
2	002938	鹏鼎控股	1,572,285.00	1.11
3	600038	中直股份	1,520,958.00	1.07
4	603290	斯达半导	1,130,780.00	0.80
5	300496	中科创达	1,044,760.00	0.74
6	002182	云海金属	935,313.42	0.66
7	300750	宁德时代	925,300.00	0.65
8	300725	药石科技	881,303.00	0.62
9	688187	时代电气	869,783.56	0.61
10	603369	今世缘	825,662.00	0.58
11	002013	中航机电	790,646.00	0.56
12	688006	杭可科技	786,156.79	0.56
13	600958	东方证券	771,502.40	0.55

14	601633	长城汽车	764,524.00	0.54
15	603517	绝味食品	750,045.00	0.53
16	600760	中航沈飞	744,029.00	0.53
17	603668	天马科技	741,228.60	0.52
18	600399	抚顺特钢	729,211.00	0.52
19	688408	中信博	723,080.71	0.51
20	000858	五粮液	704,633.00	0.50

#### 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	600760	中航沈飞	1,816,685.60	1.28
2	603290	斯达半导	1,676,593.00	1.18
3	300775	三角防务	916,381.00	0.65
4	002013	中航机电	818,568.00	0.58
5	300496	中科创达	787,647.00	0.56
6	002371	北方华创	663,486.00	0.47
7	600893	航发动力	638,308.00	0.45
8	002179	中航光电	606,000.00	0.43
9	688019	安集科技	605,976.81	0.43
10	688408	中信博	593,188.37	0.42
11	600585	海螺水泥	575,235.00	0.41
12	300083	创世纪	565,927.00	0.40
13	603668	天马科技	536,945.00	0.38
14	688363	华熙生物	505,483.41	0.36
15	300351	永贵电器	476,342.00	0.34
16	000858	五粮液	457,993.00	0.32
17	603583	捷昌驱动	453,581.00	0.32
18	603517	绝味食品	453,475.00	0.32
19	300373	扬杰科技	453,093.00	0.32
20	603327	福蓉科技	415,803.00	0.29

#### 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	33,602,527.76
卖出股票收入（成交）总额	26,630,353.40

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	27,250,405.44	11.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	118,292,614.24	50.39
	其中：政策性金融债	77,046,011.50	32.82
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,838,980.81	17.40
7	可转债（可交换债）	30,733,662.20	13.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	217,115,662.69	92.48

### 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	190408	19 农发 08	200,000	21,290,197.26	9.07
2	1928028	19 中国银行二级 01	200,000	21,098,504.11	8.99
3	200207	20 国开 07	200,000	20,723,178.08	8.83
4	210215	21 国开 15	200,000	20,491,490.41	8.73
5	2028013	20 农业银行二级 01	200,000	20,148,098.63	8.58

### 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，中国银行股份有限公司、中国农业银行股份

有限公司、国家开发银行、中国农业发展银行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。

### 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	32,129.37
2	应收清算款	649,008.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,085,218.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,766,356.36

### 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	110059	浦发转债	9,940,564.38	4.23
2	113042	上银转债	2,395,716.56	1.02
3	123123	江丰转债	2,083,247.67	0.89
4	113637	华翔转债	1,853,636.88	0.79
5	113620	傲农转债	1,670,678.95	0.71
6	128022	众信转债	854,523.81	0.36
7	113530	大丰转债	818,899.32	0.35
8	128140	润建转债	805,004.52	0.34
9	123060	苏试转债	762,443.01	0.32
10	127047	帝欧转债	703,068.67	0.30
11	123107	温氏转债	656,465.07	0.28
12	123085	万顺转 2	561,909.75	0.24
13	128034	江银转债	490,017.97	0.21
14	128046	利尔转债	391,660.36	0.17
15	110068	龙净转债	346,331.42	0.15
16	110079	杭银转债	250,564.82	0.11

### 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

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		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 (%)
2,705	78,328.62	171,552,811.94	80.97	40,326,114.02	19.03

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	4,840.57	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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 11 月 27 日) 基金份额总额	42,865,989.46
本报告期期初基金份额总额	123,659,287.74
本报告期基金总申购份额	138,775,976.89
减：本报告期基金总赎回份额	50,556,338.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	211,878,925.96

## § 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

2022 年 5 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚

康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

2022 年 6 月 23 日本基金管理人发布《关于嘉实多利收益债券基金经理变更的公告》，王汉博先生不再担任本基金基金经理，增聘韩同利先生担任本基金基金经理，与罗伟卿先生共同管理本基金。

(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

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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%)	
中国国际金融股份有限公司	1	28,569,276.72	47.53	19,998.50	50.11	-
中信建投证券股份有限公司	2	15,208,812.36	25.30	9,600.65	24.06	-
方正证券股份有限公司	2	13,547,749.68	22.54	8,552.86	21.43	-
南京证券	1	2,782,396.00	4.63	1,756.55	4.40	-

股份有限 公司						
安信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-

股份有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司	4	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	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) 研究能力较强；

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，本基金新增以下交易单元：首创证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，华鑫证券有限责任公司新增交易单元 1 个，民生证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

## 10.7.2 基金租用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 (%)
中国国际金融股份有限公司	269,900,443.30	43.62	707,700,000.00	94.40	-	-
中信建投证券股份有限公司	30,123,935.27	4.87	42,000,000.00	5.60	-	-
方正证券股份有限公司	288,247,950.77	46.58	-	-	-	-
南京证券	30,518,174.00	4.93	-	-	-	-

股份有限 公司	0					
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中信证券 股份有限 公司						
中银国际 证券股份 有限公司						

## 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	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 5 月 12 日
2	关于嘉实多利收益债券基金经理变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 23 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	2022-06-28 至 2022-06-30	-	90,374,152.73	-	90,374,152.73	42.65
	2	2022-01-01 至 2022-06-30	44,724,663.56	26,583,837.93	-	71,308,501.49	33.66

#### 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实多利分级债券型证券投资基金变更注册为本基金的批复文件；
- (2) 《嘉实多利收益债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实多利收益债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实多利收益债券型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实多利收益债券型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

2022 年 8 月 29 日