

嘉实多元收益债券型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	1,063,483,304.53 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	715,848,555.42 份	347,634,749.11 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）	
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
1. 本期已实现收益	17,379,907.60	6,695,374.35
2. 本期利润	26,385,949.43	9,893,148.27
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0323	0.0290
4. 期末基金资产净值	889,409,343.49	429,073,430.65
5. 期末基金份额净值	1.242	1.234

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	2.48%	0.23%	0.67%	0.04%	1.81%	0.19%
过去六个月	1.89%	0.28%	0.93%	0.09%	0.96%	0.19%
过去一年	1.97%	0.34%	3.44%	0.08%	-1.47%	0.26%
过去三年	20.64%	0.43%	9.51%	0.10%	11.13%	0.33%
过去五年	28.18%	0.38%	26.95%	0.11%	1.23%	0.27%
自基金合同	129.12%	0.35%	83.33%	0.12%	45.79%	0.23%

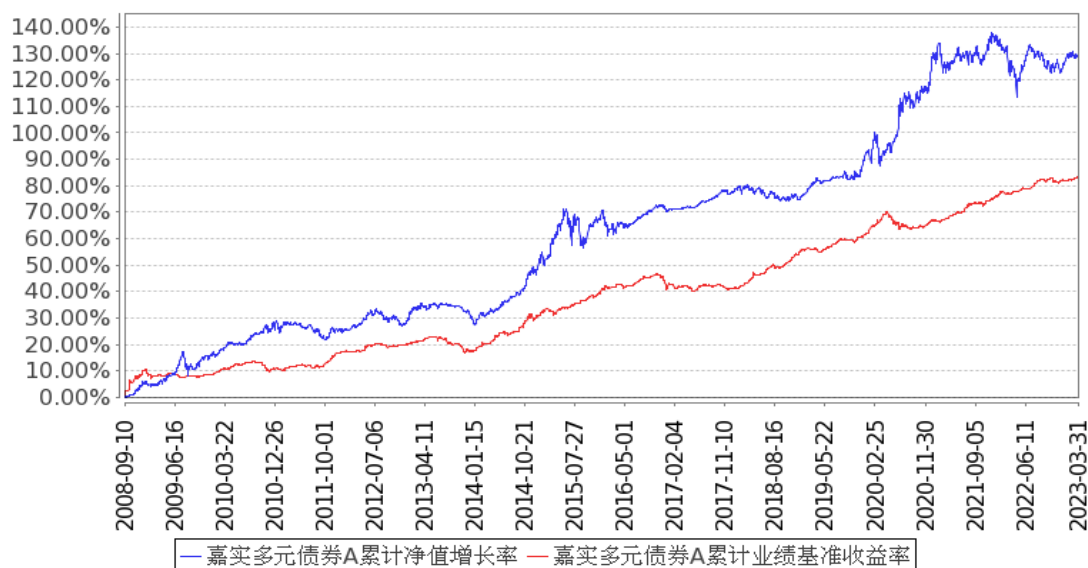
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

嘉实多元债券 B

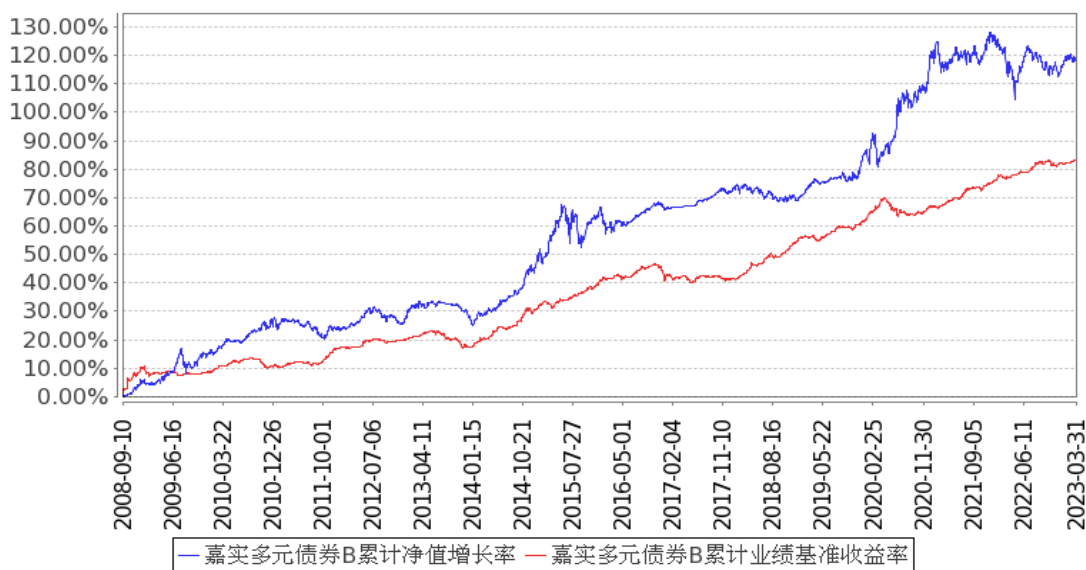
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.41%	0.23%	0.67%	0.04%	1.74%	0.19%
过去六个月	1.82%	0.28%	0.93%	0.09%	0.89%	0.19%
过去一年	1.65%	0.35%	3.44%	0.08%	-1.79%	0.27%
过去三年	19.58%	0.44%	9.51%	0.10%	10.07%	0.34%
过去五年	26.38%	0.39%	26.95%	0.11%	-0.57%	0.28%
自基金合同生效起至今	118.89%	0.35%	83.33%	0.12%	35.56%	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03月31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		
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	本基金基金经理	2022 年 5 月 21 日	-	7 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 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

2023 年 1 季度随着疫情的过去、政策的发力及消费的恢复，经济出现一定程度的修复，1、2 月均出现信贷数据的大幅增长，社融开始企稳，地产需求端出现明显改善，但经济也存在中期隐忧，如拍地数据依然不佳等。海外局面则相对混乱，在美通胀数据高企，联储加息的背景下，硅谷银行、瑞信银行等金融机构出现风险，导致政策边际转松预期提升。国内政策端延续 23 年中央工作会议的定调，两会期间也对今年的精神做出了较为清晰的传导，今年经济目标 5%左右，政策基于经济潜力做安排。1 季度有一次降准，货币政策稳健灵活的基调下，资金利率有所抬升。总的来看，基本面出现一定程度的改善，政策保持稳健的定调。

债券部分，23 年 Q1 债券市场走出震荡的行情，信用债大幅走强，信用利差显著压缩，大幅回补了去年 12 月份事件冲击带来的利率的上升。其中，信用债指数上涨 1.45%，国债指数上涨 0.68%，10y 国债收益率先上后下，季末收益率小幅上行，较年初上行约 4bp。信用债则基本走出单边上涨的走势，除一月初小幅调整外，一季度几乎没有调整。

基于宏观和政策的判断，认为信用债在去年 4 季度因为事件冲击出现了严重的超调，信用债在年初时点具有极佳的配置价值，因此在一季度增配并大幅提高信用债的配置比例。基于全年稳增长的判断，降低利率债的配置比例并根据是否超调做交易，在 2 月中大幅增配二级资本债和利率债等品种。随着 3 月的降准，降低利率债的仓位和二级资本债的仓位进行止盈操作。转债方面，在 1 月大幅加仓参与市场的反弹，2 月中适当降仓，3 月中下旬认为市场可能存在反弹机会而大幅调高转债仓位，品种上，还是选择公用事业、银行、医药相关的中低价可转债投资，并灵活参与新能源、养殖、信创、军工转债的投资和交易。

股票部分，在本产品 2022 年年报对证券市场展望中，我们写到“看好低估值价值股”。一季度，我们配置的高股息价值股和央国企资产有较明显的超额收益，基于绝对收益目标，我们对其做了部分止盈，换仓到低估值的地产、非银金融、电力等板块。一季度表现亮眼的还有 AIGC 概念下催化的 TMT 板块行情，尤其是三月份以来，可以用“一枝独秀”来形容。很多人用十年前智能手机或者 5 年前新能源车的趋势性行情来类比当前 AIGC 所引领的 TMT 行情，我们对此看法谨慎，

只小仓位阶段性参与，理由是我们认为宏观层面存在如下 3 个重大区别，导致上述类比很可能并不恰当：

1) 资金成本不可同日而语。高企的美国国债利率水平和利率曲线深度倒挂下，宏观金融条件是去杠杆而非加杠杆、是挤泡沫而非吹泡沫（e. g. 硅谷银行等事件）。而人口、社会、地缘政治等深层次原因，构成大周期级别拐点，令通胀持续，从而令上述金融条件持续。所以我们看到在 AIGC 真正取得突破的美股，相关板块并没有突出表现，两相对比，可以判断 A 股的 AIGC 行情更多是情绪和博弈因素在推动。

2) 全球化的发展方向不同。无论是智能手机还是新能源车的发展，都受益于全球化的环境，比如制造端的全球供应链分工，和销售端的全球大市场。当前，前述全球化环境发生逆转，而本土 AIGC 的发展在算力端、算法端、数据端又仰赖于全球化，这其中的矛盾，以及由此衍生出的断供等风险，可能在其发展道路上构成约束。

3) 产业周期的阶段不同。被用来类比的智能手机、新能源车等是“从 1 到 n”，是始于上世纪 80 年代的信息技术革命在中后期的硬件落地，瓜熟蒂落，一马平川；而 AI 是“从 0 到 1”，虽是下一轮康波周期技术革命的主要方向，但难以一蹴而就。就像上一轮康波周期的驱动力信息技术革命在诞生前经历了上世纪 70 年代的滞涨一样，在新一轮技术革命正式落地前，也需要经历春天前的冬天，元亨利贞，这是事物发展的客观规律。而在路径依赖下，以秋天收获的心态过冬，违时甚矣。

总之，从历史经验看，一条真正的投资主线，往往具备天时地利人和等因素的共振，才能持续正反馈加强，才能行稳致远。目前看，AIGC 板块还有待接受上述宏观风险检验。而相反，“高自由现金流创造能力的央国企估值重估”是对上述资金成本拐点、全球化变化等宏观新趋势的应对，更有可能成为主线。

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 1.242 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.48%；截至本报告期末嘉实多元债券 B 基金份额净值为 1.234 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.41%；业绩比较基准收益率为 0.67%。

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	258,739,777.60	16.34
	其中：股票	258,739,777.60	16.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,282,763,534.83	81.01
	其中：债券	1,282,763,534.83	81.01
	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	17,470,573.20	1.10
8	其他资产	24,514,327.32	1.55
9	合计	1,583,488,212.95	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	50,710,278.20	3.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,885,596.00	2.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,095,687.20	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	17,676,439.00	1.34
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	73,627,465.20	5.58
K	房地产业	55,486,096.00	4.21
L	租赁和商务服务业	2,752,000.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	1,506,216.00	0.11
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	258,739,777.60	19.62
----	----------------	-------

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	000002	万科 A	2,000,400	30,486,096.00	2.31
2	601628	中国人寿	700,000	23,303,000.00	1.77
3	600863	内蒙华电	6,000,000	19,920,000.00	1.51
4	600376	首开股份	4,000,000	18,240,000.00	1.38
5	300750	宁德时代	44,300	17,988,015.00	1.36
6	600958	东方证券	1,826,940	17,885,742.60	1.36
7	603939	益丰药房	299,960	17,343,687.20	1.32
8	601318	中国平安	300,000	13,680,000.00	1.04
9	600029	南方航空	1,600,000	12,592,000.00	0.96
10	600487	亨通光电	800,000	12,080,000.00	0.92

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	137,856,950.57	10.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	307,552,961.40	23.33
	其中：政策性金融债	30,074,506.85	2.28
4	企业债券	60,864,774.81	4.62
5	企业短期融资券	61,135,745.20	4.64
6	中期票据	364,608,874.99	27.65
7	可转债（可交换债）	350,744,227.86	26.60
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,282,763,534.83	97.29

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	019638	20 国债 09	700,000	71,270,605.48	5.41
2	102103356	21 湘高速 MTN008	500,000	50,414,646.58	3.82
3	2028038	20 中国银行二级 01	400,000	41,866,980.82	3.18
4	2028018	20 交通银行二级	400,000	41,246,772.60	3.13
5	2128042	21 兴业银行二级	400,000	40,635,059.73	3.08

		02			
--	--	----	--	--	--

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，兴业银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通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。

5.10.2 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	265,006.62

2	应收证券清算款	23,685,595.75
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	563,724.95
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	24,514,327.32

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	110079	杭银转债	16,302,439.53	1.24
2	110053	苏银转债	9,789,446.58	0.74
3	127073	天赐转债	9,602,778.56	0.73
4	123085	万顺转 2	7,134,059.41	0.54
5	127055	精装转债	7,101,975.76	0.54
6	123151	康医转债	6,857,586.40	0.52
7	113505	杭电转债	6,851,192.56	0.52
8	113535	大业转债	6,790,297.56	0.52
9	128017	金禾转债	6,599,955.77	0.50
10	123071	天能转债	6,447,887.17	0.49
11	128109	楚江转债	6,216,679.60	0.47
12	113048	晶科转债	5,748,934.97	0.44
13	118014	高测转债	5,432,825.79	0.41
14	128074	游族转债	5,378,529.29	0.41
15	113050	南银转债	5,215,700.70	0.40
16	128141	旺能转债	5,185,496.46	0.39
17	113055	成银转债	5,150,830.86	0.39
18	113618	美诺转债	4,985,856.51	0.38
19	128023	亚太转债	4,953,409.08	0.38
20	113025	明泰转债	4,826,408.22	0.37
21	123114	三角转债	4,701,360.21	0.36
22	128048	张行转债	4,694,423.38	0.36
23	113641	华友转债	4,639,268.46	0.35
24	128095	恩捷转债	4,625,668.95	0.35
25	128119	龙大转债	4,604,496.78	0.35
26	113637	华翔转债	4,535,758.77	0.34
27	123100	朗科转债	4,523,787.92	0.34
28	113051	节能转债	4,417,031.68	0.34
29	128066	亚泰转债	4,383,945.52	0.33
30	123080	海波转债	4,320,046.61	0.33
31	128137	洁美转债	4,151,384.79	0.31
32	123131	奥飞转债	3,955,072.11	0.30

33	110043	无锡转债	3,797,123.90	0.29
34	113057	中银转债	3,658,948.83	0.28
35	118013	道通转债	3,628,889.37	0.28
36	127049	希望转 2	3,553,217.98	0.27
37	127047	帝欧转债	3,496,050.68	0.27
38	110067	华安转债	3,420,155.59	0.26
39	113534	鼎胜转债	3,356,534.15	0.25
40	113655	欧 22 转债	3,336,117.06	0.25
41	113046	金田转债	3,283,961.93	0.25
42	113605	大参转债	3,170,336.53	0.24
43	110076	华海转债	3,059,153.96	0.23
44	123109	昌红转债	3,051,184.80	0.23
45	113052	兴业转债	3,040,598.63	0.23
46	123067	斯莱转债	2,934,243.46	0.22
47	127065	瑞鹄转债	2,918,937.73	0.22
48	113530	大丰转债	2,914,181.70	0.22
49	123012	万顺转债	2,897,728.08	0.22
50	132018	G 三峡 EB1	2,867,995.89	0.22
51	127019	国城转债	2,816,793.31	0.21
52	123090	三诺转债	2,780,691.05	0.21
53	110087	天业转债	2,755,993.04	0.21
54	110048	福能转债	2,736,612.92	0.21
55	113033	利群转债	2,697,591.60	0.20
56	113537	文灿转债	2,682,568.36	0.20
57	128101	联创转债	2,603,526.92	0.20
58	123132	回盛转债	2,575,367.64	0.20
59	123154	火星转债	2,522,631.41	0.19
60	127060	湘佳转债	2,442,901.30	0.19
61	113626	伯特转债	2,359,197.12	0.18
62	111000	起帆转债	2,311,991.22	0.18
63	123064	万孚转债	2,233,822.80	0.17
64	128044	岭南转债	2,193,805.75	0.17
65	123108	乐普转 2	2,152,198.90	0.16
66	127052	西子转债	2,119,892.81	0.16
67	113654	永 02 转债	2,108,444.93	0.16
68	128087	孚日转债	2,006,323.29	0.15
69	123120	隆华转债	1,985,956.19	0.15
70	123121	帝尔转债	1,913,845.09	0.15
71	113625	江山转债	1,837,557.78	0.14
72	113640	苏利转债	1,756,917.95	0.13
73	127050	麒麟转债	1,622,167.09	0.12
74	123157	科蓝转债	1,554,008.55	0.12

75	128083	新北转债	1,465,137.66	0.11
76	111004	明新转债	1,412,403.35	0.11
77	127053	豪美转债	1,412,377.32	0.11
78	128135	洽洽转债	1,320,755.42	0.10
79	128097	奥佳转债	1,250,398.02	0.09
80	110068	龙净转债	1,248,205.97	0.09
81	113638	台 21 转债	1,149,236.97	0.09
82	123088	威唐转债	1,138,749.82	0.09
83	128090	汽模转 2	1,072,212.49	0.08
84	127033	中装转 2	1,054,883.55	0.08
85	128037	岩土转债	1,002,377.20	0.08
86	128129	青农转债	943,282.56	0.07
87	113059	福莱转债	844,113.13	0.06
88	113524	奇精转债	839,972.58	0.06
89	113519	长久转债	833,154.38	0.06
90	123145	药石转债	769,365.04	0.06
91	113629	泉峰转债	694,379.77	0.05
92	113549	白电转债	362,493.75	0.03
93	118015	芯海转债	343,582.25	0.03
94	127051	博杰转债	228,595.07	0.02

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	841,001,680.68	339,158,300.84
报告期期间基金总申购份额	129,172,893.41	21,260,883.67
减：报告期期间基金总赎回份额	254,326,018.67	12,784,435.40
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	715,848,555.42	347,634,749.11

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 4 月 21 日