

嘉实多元收益债券型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告

2025 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2025 年 7 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 2025 年 07 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 2025 年 04 月 01 日起至 2025 年 06 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 | 1,490,119,576.97 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, 129, 314, 490. 17 份 | 360, 805, 086. 80 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（2025 年 4 月 1 日-2025 年 6 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 | 16, 949, 481. 62 | 4, 175, 313. 74 |
| 2. 本期利润 | 22, 278, 132. 94 | 5, 863, 218. 01 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 0170 | 0. 0169 |
| 4. 期末基金资产净值 | 1, 485, 947, 304. 05 | 470, 981, 235. 21 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1. 316 | 1. 305 |

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 | 1. 31% | 0. 20% | 1. 53% | 0. 11% | -0. 22% | 0. 09% |
| 过去六个月 | 0. 69% | 0. 19% | 0. 74% | 0. 13% | -0. 05% | 0. 06% |
| 过去一年 | 9. 88% | 0. 35% | 5. 10% | 0. 12% | 4. 78% | 0. 23% |
| 过去三年 | 9. 40% | 0. 30% | 16. 28% | 0. 10% | -6. 88% | 0. 20% |
| 过去五年 | 27. 45% | 0. 39% | 25. 28% | 0. 09% | 2. 17% | 0. 30% |
| 自基金合同 | 154. 50% | 0. 34% | 108. 00% | 0. 12% | 46. 50% | 0. 22% |

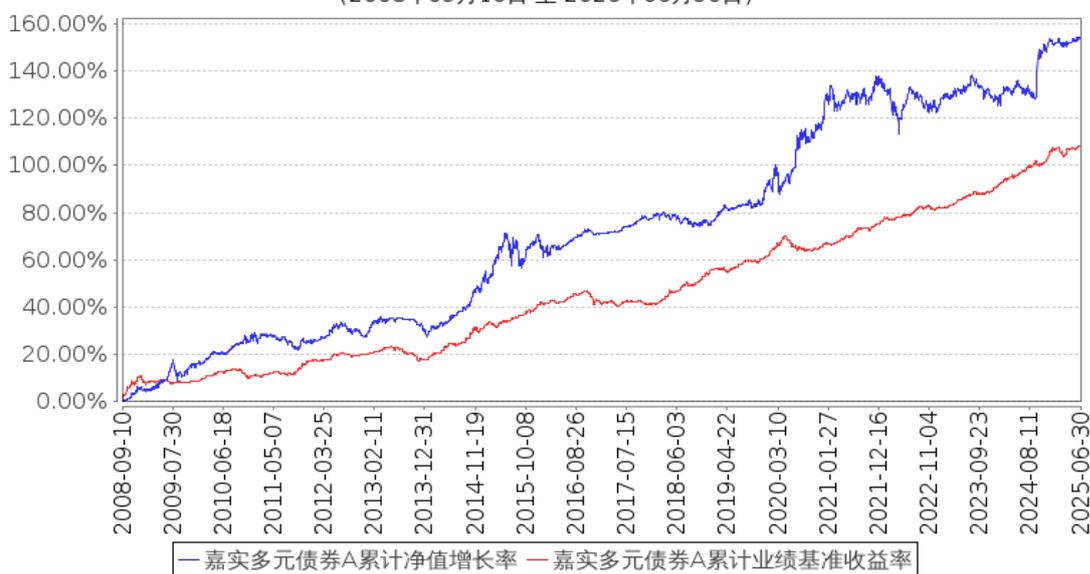
| | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|
| 生效起至今 | | | | | | |
|-------|--|--|--|--|--|--|

嘉实多元债券 B

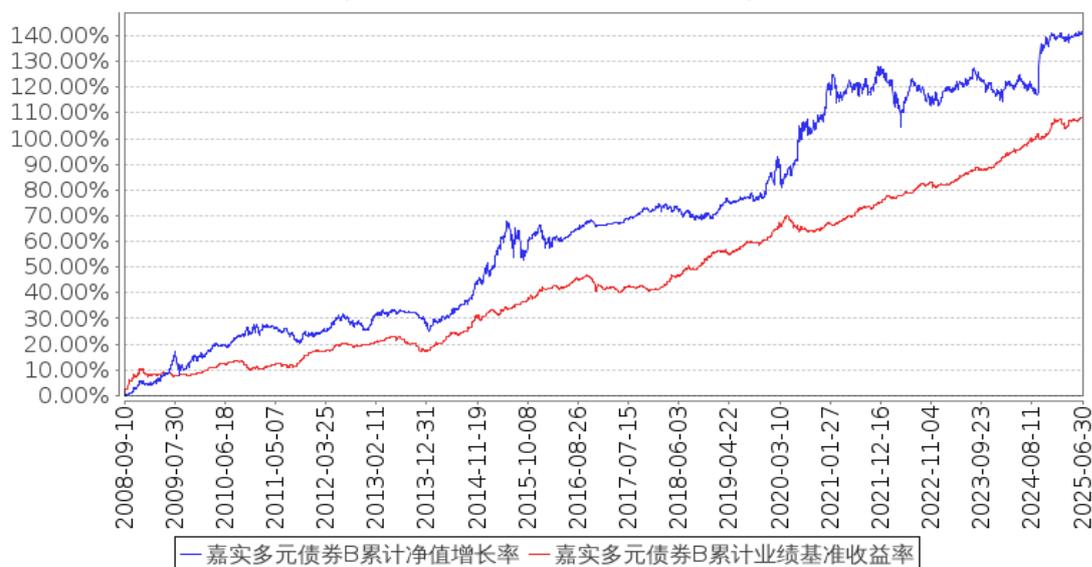
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | 1.24% | 0.21% | 1.53% | 0.11% | -0.29% | 0.10% |
| 过去六个月 | 0.54% | 0.20% | 0.74% | 0.13% | -0.20% | 0.07% |
| 过去一年 | 9.60% | 0.36% | 5.10% | 0.12% | 4.50% | 0.24% |
| 过去三年 | 8.47% | 0.30% | 16.28% | 0.10% | -7.81% | 0.20% |
| 过去五年 | 25.54% | 0.39% | 25.28% | 0.09% | 0.26% | 0.30% |
| 自基金合同生效起至今 | 141.48% | 0.34% | 108.00% | 0.12% | 33.48% | 0.22% |

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2025年06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2025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 | | |
| 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 | - | 15 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、嘉实新思路混合、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实 | 2022 年 5 月 21 日 | - | 9 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。 |

| | | | | | |
|-----|---|-----------------|---|------|--|
| | 稳福混合、嘉实双季瑞享 6 个月持有债券、嘉实季季惠享 3 个月持有期纯债基金经理 | | | | |
| 李卓锴 | 本基金、嘉实新思路混合、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实稳福混合、嘉实双季瑞享 6 个月持有债券、嘉实季季惠享 3 个月持有期纯债基金经理 | 2025 年 3 月 22 日 | - | 16 年 | 曾任职于国家开发银行资金局,从事债券投资工作。2017 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司任配置策略组投资经理,现任策略投资总监。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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|-----|----------|---------|-------------------|-----------------|
| 董福焱 | 公募基金 | 4 | 11,033,223,346.97 | 2019 年 8 月 23 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 100,144,798.43 | 2025 年 4 月 10 日 |

| | | | | |
|--|------|---|-----------------------|---|
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 5 | 11, 133, 368, 145. 40 | - |

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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 4 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 2 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

2025 年二季度，宏观冲突事件频发，国内基本面在中美关税战等因素的影响下依然保持平稳向好态势，展现了很强的韧性，高质量发展逐步推进，其中消费、制造业投资、进出口均保持良好态势，但地产相关产业偏弱。海外局面复杂，美国数据有强有弱，部分西方国家先后降息。二季度货币政策降息降准，汇率兑美元升值，在央行货币政策稳健灵活的基调下，资金整体保持宽松。财政继续稳步发力。

二季度债券市场震荡走牛，利率大幅下行，伴随降息降准，信用债收益率水平创近几年的新低。利率债虽然波动较大，但久期策略效果最优。其中，中债总财富指数上涨 1.53%，中债信用债总财富指数上涨 1.02%，10y 国债收益率最终下行至 1.65% 附近。机构行为，宏观事件的反复成

为债券波动加大的重要原因。信用债供给量较为有限，在供不应求的环境下收益率大幅下行，部分品种信用利差已经降至历史最低水平。利率方面，超长期国债发行放量，收益率震荡下行。可转债二季度上涨 3.77%，受到宽松流动性的影响，各类转债出现普涨行情。二季度权益市场在事件冲击下震荡，除少数权重板块如银行外，热点主要集中在主题领域，市场整体呈现交易量下滑特征。

组合层面，债券部分基于宏观和政策的判断，积极对组合的久期和仓位进行调整。组合以中短期高等级债券为主，并部分仓位参与利率债的交易。考虑到流动性相对宽松，从二季度起维持中性偏高的杠杆和组合久期水平。转债方面，仓位进行灵活调整，考虑到市场情绪改善，转债溢价率水平中性偏高，仓位维持中性水平，季末起逐步小幅降低转债仓位。品种上，还是选择银行、公用事业、有色、半导体、化工、汽车零部件等相关的平衡型和偏股型可转债。权益部分二季度加仓了建材、化工、农林牧渔，减仓了电力、保险、银行。

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 1.316 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.31%；截至本报告期末嘉实多元债券 B 基金份额净值为 1.305 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.24%；业绩比较基准收益率为 1.53%。

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 | 334,892,388.23 | 13.37 |
| | 其中：股票 | 334,892,388.23 | 13.37 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 2,145,756,683.77 | 85.67 |
| | 其中：债券 | 2,145,756,683.77 | 85.67 |
| | 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 | 13,063,427.48 | 0.52 |

| | | | |
|---|------|------------------|--------|
| 8 | 其他资产 | 10,879,094.13 | 0.43 |
| 9 | 合计 | 2,504,591,593.61 | 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 | 14,420,000.00 | 0.74 |
| B | 采矿业 | 29,237,008.00 | 1.49 |
| C | 制造业 | 120,326,525.99 | 6.15 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,040,000.00 | 0.92 |
| E | 建筑业 | 17,310,000.00 | 0.88 |
| F | 批发和零售业 | 14,658,377.00 | 0.75 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 35,690,870.00 | 1.82 |
| 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 | 54,549,607.24 | 2.79 |
| K | 房地产业 | 30,660,000.00 | 1.57 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | 334,892,388.23 | 17.11 |

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 | 601878 | 浙商证券 | 4,999,964 | 54,549,607.24 | 2.79 |
| 2 | 600029 | 南方航空 | 6,049,300 | 35,690,870.00 | 1.82 |
| 3 | 600585 | 海螺水泥 | 1,389,000 | 29,821,830.00 | 1.52 |
| 4 | 002064 | 华峰化学 | 3,000,079 | 19,830,522.19 | 1.01 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 703,900 | 19,624,732.00 | 1.00 |
| 6 | 002035 | 华帝股份 | 3,000,000 | 18,870,000.00 | 0.96 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7 | 000883 | 湖北能源 | 4,000,000 | 18,040,000.00 | 0.92 |
| 8 | 000560 | 我爱我家 | 6,000,000 | 17,820,000.00 | 0.91 |
| 9 | 601668 | 中国建筑 | 3,000,000 | 17,310,000.00 | 0.88 |
| 10 | 300783 | 三只松鼠 | 540,700 | 14,658,377.00 | 0.75 |

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 | 658,758,727.27 | 33.66 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 908,690,423.66 | 46.43 |
| | 其中：政策性金融债 | 199,808,106.84 | 10.21 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 419,701,728.78 | 21.45 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 158,605,804.06 | 8.10 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,145,756,683.77 | 109.65 |

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 | 2028025 | 20浦发银行二级01 | 1,300,000 | 134,817,913.97 | 6.89 |
| 2 | 2028033 | 20建设银行二级 | 1,200,000 | 124,607,506.85 | 6.37 |
| 3 | 2400001 | 24特别国债01 | 1,000,000 | 114,293,315.22 | 5.84 |
| 4 | 240011 | 24付息国债11 | 900,000 | 94,507,410.33 | 4.83 |
| 5 | 230210 | 23国开10 | 700,000 | 75,641,328.77 | 3.87 |

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，国家开发银行、中国邮政储蓄银行股份有限公司、中国建设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 | 215,359.81 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,024,296.05 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 6,639,438.27 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 10,879,094.13 |

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 | 113065 | 齐鲁转债 | 19,430,856.17 | 0.99 |
| 2 | 132026 | G 三峡 EB2 | 16,709,863.55 | 0.85 |
| 3 | 128129 | 青农转债 | 15,274,183.88 | 0.78 |
| 4 | 113064 | 东材转债 | 9,282,644.80 | 0.47 |
| 5 | 111017 | 蓝天转债 | 6,599,391.81 | 0.34 |
| 6 | 113042 | 上银转债 | 6,384,719.18 | 0.33 |

| | | | | |
|----|--------|---------|--------------|------|
| 7 | 127069 | 小熊转债 | 5,672,356.79 | 0.29 |
| 8 | 110093 | 神马转债 | 5,169,948.84 | 0.26 |
| 9 | 123085 | 万顺转 2 | 5,078,936.31 | 0.26 |
| 10 | 127030 | 盛虹转债 | 4,912,048.35 | 0.25 |
| 11 | 111000 | 起帆转债 | 4,783,863.01 | 0.24 |
| 12 | 127054 | 双箭转债 | 4,513,278.14 | 0.23 |
| 13 | 127088 | 赫达转债 | 3,947,864.14 | 0.20 |
| 14 | 127043 | 川恒转债 | 3,877,257.53 | 0.20 |
| 15 | 113062 | 常银转债 | 3,857,501.92 | 0.20 |
| 16 | 113569 | 科达转债 | 3,854,987.67 | 0.20 |
| 17 | 113066 | 平煤转债 | 3,839,028.49 | 0.20 |
| 18 | 127083 | 山路转债 | 3,587,174.15 | 0.18 |
| 19 | 113067 | 燃 23 转债 | 3,569,475.91 | 0.18 |
| 20 | 127027 | 能化转债 | 3,559,695.34 | 0.18 |
| 21 | 123150 | 九强转债 | 2,540,719.86 | 0.13 |
| 22 | 113056 | 重银转债 | 2,519,052.05 | 0.13 |
| 23 | 113068 | 金铜转债 | 2,432,500.25 | 0.12 |
| 24 | 123142 | 申昊转债 | 2,190,780.69 | 0.11 |
| 25 | 123194 | 百洋转债 | 1,920,335.34 | 0.10 |
| 26 | 127086 | 恒邦转债 | 1,901,474.79 | 0.10 |
| 27 | 123107 | 温氏转债 | 1,845,912.74 | 0.09 |
| 28 | 128121 | 宏川转债 | 1,672,453.15 | 0.09 |
| 29 | 113648 | 巨星转债 | 1,425,723.29 | 0.07 |
| 30 | 110087 | 天业转债 | 1,204,304.20 | 0.06 |
| 31 | 123121 | 帝尔转债 | 1,098,764.38 | 0.06 |
| 32 | 123199 | 山河转债 | 1,097,924.79 | 0.06 |
| 33 | 127075 | 百川转 2 | 1,069,370.14 | 0.05 |
| 34 | 127016 | 鲁泰转债 | 778,216.85 | 0.04 |
| 35 | 113609 | 永安转债 | 722,550.00 | 0.04 |
| 36 | 113037 | 紫银转债 | 280,645.56 | 0.01 |

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 | 1,499,850,824.54 | 383,403,987.06 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 31,642,310.70 | 304,168,712.89 |
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 402,178,645.07 | 326,767,613.15 |
| 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 | 1,129,314,490.17 | 360,805,086.80 |

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《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

2025 年 7 月 21 日