

嘉实多元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：中国工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。

基金托管人中国工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。

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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.11 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	62
§ 11 备查文件目录	62
11.1 备查文件目录	62
11.2 存放地点	62
11.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实多元收益债券型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,321,779,912.72 份	
基金合同存续期	不定期	
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	1,111,913,964.48 份	209,865,948.24 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下，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）；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。

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	中国工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	郭明 (010)66105799

电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010)65215588	(010)66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	经雷	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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	嘉实基金管理有限公司	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

§ 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 01 月 01 日-2022 年 06 月 30 日)	
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B
本期已实现收益	-53,998,165.35	-26,029,831.17
本期利润	-59,089,813.06	-44,746,419.33
加权平均基金份额本期利润	-0.0434	-0.0775
本期加权平均净值利润率	-3.51%	-6.30%
本期基金份额净值增长率	-1.74%	-1.98%
3.1.2 期末数据	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	

和指标		
期末可供分配利润	47,571,543.65	7,757,351.96
期末可供分配基金份额利润	0.0428	0.0370
期末基金资产净值	1,401,710,732.21	263,451,570.63
期末基金份额净值	1.261	1.255
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	132.63%	122.61%

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

嘉实多元债券 A

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	3.36%	0.21%	-0.05%	0.04%	3.41%	0.17%
过去三个月	3.53%	0.51%	0.93%	0.06%	2.60%	0.45%
过去六个月	-1.74%	0.53%	1.54%	0.08%	-3.28%	0.45%
过去一年	1.00%	0.47%	5.12%	0.08%	-4.12%	0.39%
过去三年	27.28%	0.46%	13.73%	0.11%	13.55%	0.35%

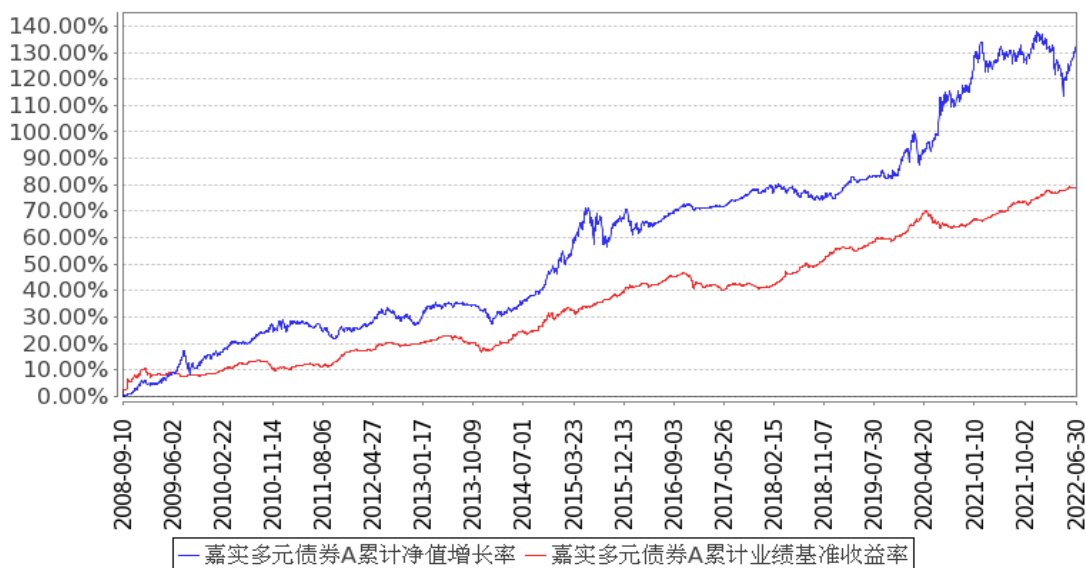
自基金合同生效起 至今	132.63%	0.35%	78.88%	0.12%	53.75%	0.23%
----------------	---------	-------	--------	-------	--------	-------

嘉实多元债券 B

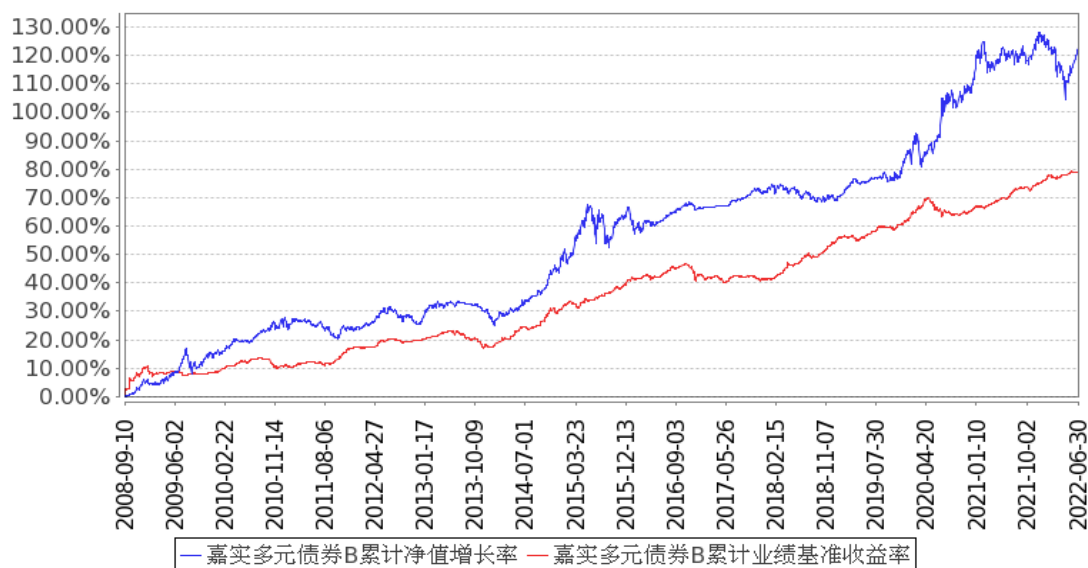
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.21%	0.21%	-0.05%	0.04%	3.26%	0.17%
过去三个月	3.38%	0.51%	0.93%	0.06%	2.45%	0.45%
过去六个月	-1.98%	0.54%	1.54%	0.08%	-3.52%	0.46%
过去一年	0.63%	0.47%	5.12%	0.08%	-4.49%	0.39%
过去三年	26.19%	0.46%	13.73%	0.11%	12.46%	0.35%
自基金合同生效起 至今	122.61%	0.35%	78.88%	0.12%	43.73%	0.23%

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2022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		
李宇昂	本基金基金经理	2022年5月21日	-	6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。
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、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、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、嘉实兴锐优选一年持有期混合基金经理	2019年8月1日	-	23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。上海财经大学金融学硕士，具有基金从业资格。中国国籍。
董福焱	本基金、嘉实策略混合、嘉实致安3个月定期债券、嘉实稳福混合、嘉实精选平衡混合基金经理	2022年5月21日	-	12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。
王茜	本基金基金经理	2009年2月13日	2022年5月21日	19年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理，中信证券固定收益部，长盛基金管理有限公司。2008年11月加入嘉实基金管理有限公司，曾任策略组组长。现任养老金投资总监。工商管理硕士，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 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

回顾 2022 年上半年，经济先后受到俄乌冲突、疫情、地产等因素冲击，在政策的应对下，呈现先探底后回升的态势，经济整体承压后弱复苏，部分行业呈现一定的改善趋势。

债券方面，伴随上半年货币政策的边际放松和经济的边际走弱，债券市场呈现震荡走强的局面，波动率相比于 21 年进一步降低。基于宏观和政策的判断，组合在上半年维持相对中性偏高久期和高杠杆水平，积极参与利率债的交易和 1-3y 高等级信用债的配置，部分仓位寻找有一定利差机会的利率债和二级资本债进行交易，并辅以可转债投资增厚组合的收益。

转债上半年受到俄乌冲突、经济下行和流动性宽松等多重因素影响，呈现出总体偏弱，但结构显著分化的行情特征，中证转债指数上半年下跌 4.07%。组合转债配置以低价策略为主，股性转债配置和交易为辅的策略，并根据市场情况适当左侧调整组合的转债仓位，以获取优于指数的

收益水平。

股票方面，一季度，我们基于衰退的预期，对 PPI 相关的周期股做了减仓，增加了价值股、稳增长、地产的配置。二季度市场出现巨幅波动，按照交易纪律，对部分股票做了止损操作。二季度增配了火电、养殖、地产、航空等困境反转行业。同时继续加大对基建的配置。二季度还配置了基本面改善趋势向好、估值在低位的国企改革标的。

4.4.2 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 1.261 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.74%；截至本报告期末嘉实多元债券 B 基金份额净值为 1.255 元，本报告期基金份额净值增长率为 -1.98%；业绩比较基准收益率为 1.54%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

22 年下半年，我们认为经济虽然仍然面临较大的压力，外部形势的不确定性将一定程度加大国内形势的压力，但随着稳增长政策、地产政策将逐步发力起效，经济复苏的方向较为确定，货币政策将维持流动性充裕配合其他政策，经济增速将出现一定的改善。通胀在下半年会有一些的抬升，但短期内对国内货币政策的影响有限。但海外地缘政治局势的多变、外部形势的变化需要着重关注。

对债券市场而言，由于流动性充裕，依然可以沿用配置为主、交易为辅的思维，但随着经济的复苏，某个阶段债券可能存在一定的上行压力。由于目前流动性极为宽松的格局不可能长期持续，半年维度，认为债券的风险可能略会大于收益。资产类别上，随着稳增长政策的逐步落地，高等级信用债、短久期资产可能会存在一定的相对价值。

对于转债市场，我们认为整体已经处于估值偏高的区间，中期维度获取较大收益的机会有限，因此整体会采取相对保守的操作思路，等待整体回调之后的布局机会。

针对股票市场，复盘 5 月以来的反弹，可以看到大致两个阶段：

1) 在货币非常宽松的背景下，资金开始回场，叠加解封利好，场内相对收益型资金开始加仓。对于目前仍掌握市场定价权的场内相对收益型资金，踏空的压力远远大于亏钱的压力，在这一激励导向下，在市场形成这个位置下跌空间、时间有限的一致预期后，场内被套机构开始回补仓位，同时为了避免在反弹阶段跑输，将持仓从低弹性标的调到高弹性标的。盘面上成长和价值的跷跷板效应是这一判断的依据，同时公布的基金季报持仓情况也佐证了这一判断。

2) 6 月中上旬，在外围商品出现暴跌后，部分场外资金基于通胀压力改善、货币紧缩压力减缓的预期开始入市，彼时成交量较前段时间明显放大是这一判断的依据之一。

后续如何演绎？

1) 场内相对收益型资金, 由于目前新基金发行仍然低迷, 当其仓位上来, 或高弹性标的持仓占比上来后, 就将后继无力。从公布的基金半年报看, 公募基金的权益持仓在高位, 其对新能源赛道的持仓集中度也再创新高。经过 2019 年以来的大规模扩容, 当前我国基民数量达到 7.2 亿人, 占全国城镇人口的 80%。

2) 对于基于外围商品下跌入市的资金, 外围商品下跌主要原因是海外衰退预期, 而不是供给端的瓶颈得到解决, 在一波价格上行的趋势中, 需求端的波动会导致价格回踩, 但不改变价格波浪式前进的大方向, 因为印钱可以吹大泡沫, 却不能变出产能。而从海外基本面的实际情况看, 产能利用率、劳动参与率、资本开支都在高位, 只是消费端因为基数效应数据较差, 贸然断言海外迅速衰退是有较大风险的。因此, 当商品价格过度反应悲观预期而反弹后, 就会令这类资金的判断依据发生变化。事实上, 本轮商品价格上涨的本质, 是实物资产相对于金融资产价值的均值回归, 回归的原因, 是持续的低价格令实物资产供给端充分出清。这不仅体现在长期资本开支不足带来的资源品的产能不足, 也体现在长期低利率环境下, 创造实物资产的、挣得短久期回报的劳动者与拥有金融资产的、赚取长久期资产泡沫的投机者之间的贫富差距日益加大, 带来全球范围的劳动力供给不足。历史上, 真正打破通胀趋势的力量, 是全要素生产率的提升。上一轮通胀趋势的扭转, 靠的是信息技术革命的兴起, 和以中国融入全球供应链体系为代表的全球化对比较优势淋漓尽致的发挥。目前并没有看到全要素生产率提升的路径。

因此, 判断 5 月以来是反弹而不是反转。本轮调整的时间不够, 2015 年四季度也有类似的快速反弹, 其本质是市场主流情绪仍滞留在贪婪区间, 场内被套资金利用市场肌肉记忆的自救行为。当前市场仍未完成熵减, 长达三年的市场一致性教育和逆向淘汰下, 拥挤的赛道仍挤满了急于赚钱的人。

在这一判断下, 目前看好的方向主要在:

- 1) 短久期资产——随着不确定性的增大和贴现率的提升, 短久期资产具备较大估值修复空间。
- 2) 困境反转 (地产、火电、航空、养殖) ——这类资产当前既不拥挤, 同时又有较清晰的明年展望。
- 3) 能够创造可持续的自由现金流以战胜通胀的价值股——滞涨环境下, 相较于远期的梦想, 实实在在的到手的现金流更货真价实。
- 4) 国企改革——既有自下而上的验证, 也有自上而下的逻辑推演。
- 5) 关注下半年出现需求有支撑供给有瓶颈的资源品的抄底机会。

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，本基金实施了利润分配，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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：嘉实多元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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	688,312.87	26,339,550.18
结算备付金		7,292,218.66	6,715,564.11
存出保证金		347,476.07	316,731.19
交易性金融资产	6.4.7.2	1,919,132,437.80	3,040,741,769.65
其中：股票投资		289,923,067.59	588,462,685.50
基金投资		-	-
债券投资		1,629,209,370.21	2,452,279,084.15
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	-	-
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		16,381,677.00	8,472,581.19
应收股利		-	-
应收申购款		2,357,658.92	510,282.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	31,597,660.27
资产总计		1,946,199,781.32	3,114,694,138.99
负债和净资产			
负债：			
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		278,089,433.63	76,019,834.97
应付清算款		-	26,346,419.42
应付赎回款		789,817.66	1,677,526.90
应付管理人报酬		939,281.43	1,436,795.98
应付托管费		268,366.10	410,513.12
应付销售服务费		55,981.83	226,617.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		85,273.28	76,276.69

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	809,324.55	1,077,420.75
负债合计		281,037,478.48	107,271,405.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,321,779,912.72	2,303,440,493.84
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	343,382,390.12	703,982,239.66
净资产合计		1,665,162,302.84	3,007,422,733.50
负债和净资产总计		1,946,199,781.32	3,114,694,138.99

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，嘉实多元债券 A 基金份额净值 1.261 元，基金份额总额 1,111,913,964.48 份，嘉实多元债券 B 基金份额净值 1.255 元，基金份额总额 209,865,948.24 份，基金份额总额合计为 1,321,779,912.72 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实多元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	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-87,855,681.95	80,551,200.87
1. 利息收入		158,309.40	31,980,152.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	129,243.70	149,229.26
债券利息收入		-	31,766,920.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,065.70	64,002.74
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-64,235,736.80	60,771,596.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-102,203,782.88	37,924,113.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	35,225,035.63	19,946,768.70
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	2,743,010.45	2,900,714.20
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	-23,808,235.87	-12,261,059.56
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	29,981.32	60,511.74
减：二、营业总支出		15,980,550.44	18,917,342.36
1. 管理人报酬		8,373,382.71	9,134,641.47
2. 托管费		2,392,395.05	2,609,897.60
3. 销售服务费		1,075,018.52	2,391,511.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,940,230.42	2,339,908.50
其中：卖出回购金融资产支出		3,940,230.42	2,339,908.50
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		55,956.91	50,240.02
8. 其他费用	6.4.7.23	143,566.83	2,391,143.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-103,836,232.39	61,633,858.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-103,836,232.39	61,633,858.51
五、其他综合收益的税后净额			-
六、综合收益总额		-103,836,232.39	61,633,858.51

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实多元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）	2,303,440,493.84	-	703,982,239.66	3,007,422,733.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-

更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	2,303,440,493.84	-	703,982,239.66	3,007,422,733.50
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“- ” 号 填 列)	-981,660,581.12	-	-360,599,849.54	-1,342,260,430.66
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-103,836,232.39	-103,836,232.39
(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)	-981,660,581.12	-	-204,461,617.31	-1,186,122,198.43
其中:1. 基 金 申 购 款	350,520,589.13	-	88,110,960.05	438,631,549.18
2 .基 金 赎 回 款	-1,332,181,170.25	-	-292,572,577.36	-1,624,753,747.61
(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)	-	-	-52,301,999.84	-52,301,999.84

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,321,779,912.72	-	343,382,390.12	1,665,162,302.84
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)	1,249,762,171.39	-	372,253,026.50	1,622,015,197.89
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)	1,249,762,171.39	-	372,253,026.50	1,622,015,197.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	979,016,172.06	-	305,990,151.54	1,285,006,323.60
(一)、综合收益总额	-	-	61,633,858.51	61,633,858.51
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	979,016,172.06	-	313,550,629.02	1,292,566,801.08

“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	2,000,233,995.40	-	630,884,984.20	2,631,118,979.60
2. 基金赎回款	-1,021,217,823.34	-	-317,334,355.18	-1,338,552,178.52
(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)	-	-	-69,194,335.99	-69,194,335.99
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	2,228,778,343.45	-	678,243,178.04	2,907,021,521.49

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

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实多元收益债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2008]865号《关于核准嘉实多元收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实多元收

益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实多元收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 9 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,579,775,847.06 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工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》、《嘉实多元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业务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、托管费等费用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、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 26,339,550.18 元、6,715,564.11 元、316,731.19 元、31,597,660.27 元、8,472,581.19 元和 510,282.40 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、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 26,343,851.91 元、6,718,586.21 元、316,873.69 元、0.00 元、8,472,581.19 元和 510,282.40 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 3,040,741,769.65 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 3,072,331,963.59 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、应付销售服务费、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 76,019,834.97 元、26,346,419.42 元、1,677,526.90 元、1,436,795.98 元、410,513.12 元、226,617.66 元、898,117.34 元、-22,895.40 元和 202,198.81 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、应付销售服务费、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 75,996,939.57 元、26,346,419.42 元、1,677,526.90 元、1,436,795.98 元、410,513.12 元、226,617.66 元、898,117.34 元、0.00 元和 202,198.81 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	688,312.87
等于：本金	686,449.89
加：应计利息	1,862.98
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	688,312.87

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	290,644,327.24	-	289,923,067.59	-721,259.65	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	562,190,173.42	5,241,006.52	561,758,919.18	-5,672,260.76
	银行间市场	1,044,768,552.59	17,528,451.03	1,067,450,451.03	5,153,447.41
	合计	1,606,958,726.01	22,769,457.55	1,629,209,370.21	-518,813.35
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	1,897,603,053.25	22,769,457.55	1,919,132,437.80	-1,240,073.00

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	99.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	627,054.18
其中：交易所市场	591,624.84
银行间市场	35,429.34
应付利息	-
预提费用	182,170.83
合计	809,324.55

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实多元债券 A

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	1,602,516,570.79	1,602,516,570.79
本期申购	62,377,593.66	62,377,593.66
本期赎回（以“-”号填列）	-552,980,199.97	-552,980,199.97
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	1,111,913,964.48	1,111,913,964.48

嘉实多元债券 B

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	700,923,923.05	700,923,923.05
本期申购	288,142,995.47	288,142,995.47
本期赎回（以“-”号填列）	-779,200,970.28	-779,200,970.28
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	209,865,948.24	209,865,948.24

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

嘉实多元债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	171,490,832.56	320,426,795.74	491,917,628.30
本期利润	-53,998,165.35	-5,091,647.71	-59,089,813.06
本期基金份额交易产生的变动数	-33,391,873.59	-73,109,923.95	-106,501,797.54
其中：基金申购款	5,060,181.96	10,954,478.81	16,014,660.77
基金赎回款	-38,452,055.55	-84,064,402.76	-122,516,458.31
本期已分配利润	-36,529,249.97	-	-36,529,249.97
本期末	47,571,543.65	242,225,224.08	289,796,767.73

嘉实多元债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	71,447,639.40	140,616,971.96	212,064,611.36
本期利润	-26,029,831.17	-18,716,588.16	-44,746,419.33
本期基金份额交易产生的变动数	-21,887,706.40	-76,072,113.37	-97,959,819.77
其中：基金申购款	18,125,865.58	53,970,433.70	72,096,299.28
基金赎回款	-40,013,571.98	-130,042,547.07	-170,056,119.05
本期已分配利润	-15,772,749.87	-	-15,772,749.87
本期末	7,757,351.96	45,828,270.43	53,585,622.39

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	70,762.11
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	55,665.41
其他	2,816.18
合计	129,243.70

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	-102,203,782.88
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	-102,203,782.88

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	1,038,401,912.31
减：卖出股票成本总额	1,138,141,779.29
减：交易费用	2,463,915.90
买卖股票差价收入	-102,203,782.88

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	29,297,330.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,927,705.29
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	35,225,035.63

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	8,694,783,349.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,599,787,421.07
减：应计利息总额	88,796,144.28
减：交易费用	272,078.36

买卖债券差价收入	5,927,705.29
----------	--------------

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	2,743,010.45
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	2,743,010.45

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	-23,808,235.87
股票投资	-13,506,568.96
债券投资	-10,301,666.91
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	-23,808,235.87

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	28,861.50
基金转出费收入	1,119.82
合计	29,981.32

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	40,663.46
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	25,096.00
债券托管账户维护费	17,700.00

其他	600.00
合计	143,566.83

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	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	8,373,382.71	9,134,641.47
其中：支付销售机构的客户维护费	464,754.64	118,588.14

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	2,392,395.05	2,609,897.60

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	-	932,294.11	932,294.11
中国工商银行	-	31,483.20	31,483.20
嘉实财富	-	937.92	937.92
合计	-	964,715.23	964,715.23
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	嘉实多元债券 A	嘉实多元债券 B	合计
嘉实基金管理有限公司	-	2,084,090.23	2,084,090.23
中国工商银行	-	33,850.06	33,850.06
嘉实财富	-	105.43	105.43
合计	-	2,118,045.72	2,118,045.72

注：（1）本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，每日计提，逐日累计至每月月末，

按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：B 类基金份额日销售服务费=B 类基金份额前一日基金资产净值×0.30%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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自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
中国工商银行股份有限公司_活期	688,312.87	70,762.11	44,235,173.01	120,900.36

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

单位：人民币元

嘉实多元债券 A

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 19 日	-	2022 年 1 月 19 日	0.235	24,534,7 13.77	11,994,536 .20	36,529,2 49.97	2021 年 年度收 益分配 于 2022 年实施
合计	-	-	-	0.235	24,534,7 13.77	11,994,536 .20	36,529,2 49.97	-
嘉实多元债券 B								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 1 月 19 日	-	2022 年 1 月 19 日	0.225	14,452,1 72.47	1,320,577. 40	15,772,7 49.87	2021 年 年度收 益分配 于 2022 年实施
合计	-	-	-	0.225	14,452,1 72.47	1,320,577. 40	15,772,7 49.87	-

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

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 113,017,082.57 元, 是以如下债券作为质押:

金额单位: 人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量(张)	期末估值总额
102101347	21 华发集 团 MTN008	2022 年 7 月 1 日	106.13	148,000	15,707,207.56
1828007	18 浦发银 行二级 01	2022 年 7 月 6 日	106.86	100,000	10,685,875.62
2028044	20 广发银 行二级 01	2022 年 7 月 6 日	106.25	489,000	51,956,678.71
2128028	21 邮储银	2022 年 7 月 6	103.26	200,000	20,652,478.90

	行二级 01	日			
2128033	21 建设银行二级 03	2022 年 7 月 6 日	103.12	200,000	20,623,271.23
2128049	21 建设银行二级 05	2022 年 7 月 6 日	102.19	54,000	5,518,144.01
合计				1,191,000	125,143,656.03

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 165,072,351.06 元，于 2022 年 9 月 26 日前先后到期。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，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控制风险和保持资产流动性的前提下，通过谋求较高的当期收益，力争资产的长期稳定增值。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风险管理制度，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	71,098,983.56	30,033,000.00
合计	71,098,983.56	30,033,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

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	644,201,920.36	738,336,789.14
AAA 以下	527,220,933.08	671,723,295.01
未评级	123,203,375.34	70,640,000.00
合计	1,294,626,228.78	1,480,700,084.15

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	688,312.87	-	-	-	688,312.87
结算备付金	7,292,218.66	-	-	-	7,292,218.66
存出保证金	347,476.07	-	-	-	347,476.07
交易性金融资产	337,278,696.03	849,968,068.21	441,962,605.97	289,923,067.59	1,919,132,437.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	16,381,677.00	16,381,677.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,357,658.92	2,357,658.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	345,606,703.63	849,968,068.21	441,962,605.97	308,662,403.51	1,946,199,781.32
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	278,089,433.63	-	-	-	278,089,433.63
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	789,817.66	789,817.66
应付管理人报酬	-	-	-	939,281.43	939,281.43
应付托管费	-	-	-	268,366.10	268,366.10
应付销售服务费	-	-	-	55,981.83	55,981.83
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	85,273.28	85,273.28
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	809,324.55	809,324.55
负债总计	278,089,433.63	-	-	2,948,044.85	281,037,478.48
利率敏感度缺口	67,517,270.00	849,968,068.21	441,962,605.97	305,714,358.66	1,665,162,302.84
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	26,339,550.18	-	-	-	26,339,550.18
结算备付金	6,715,564.11	-	-	-	6,715,564.11
存出保证金	316,731.19	-	-	-	316,731.19
交易性金融资产	324,811,512.40	1,438,325,398.15	689,142,173.60	588,462,685.50	3,040,741,769.65
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	8,472,581.19	8,472,581.19
应收利息	-	-	-	31,597,660.27	31,597,660.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	510,282.40	510,282.40
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	358,183,357.88	1,438,325,398.15	689,142,173.60	629,043,209.36	3,114,694,138.99
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	76,019,834.97	-	-	-	76,019,834.97
应付证券清算款	-	-	-	26,346,419.42	26,346,419.42
应付赎回款	-	-	-	1,677,526.90	1,677,526.90
应付管理人报酬	-	-	-	1,436,795.98	1,436,795.98
应付托管费	-	-	-	410,513.12	410,513.12
应付销售服务费	-	-	-	226,617.66	226,617.66
应付交易费用	-	-	-	898,117.34	898,117.34
应付税费	-	-	-	76,276.69	76,276.69
应付利息	-	-	-	-22,895.40	-22,895.40
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	202,198.81	202,198.81
负债总计	76,019,834.97	-	-	31,251,570.52	107,271,405.49
利率敏感度缺口	282,163,522.91	1,438,325,398.15	689,142,173.60	597,791,638.84	3,007,422,733.50

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	-10,831,512.68	-19,397,033.79
	市场利率下降 25 个基点	11,003,003.21	19,670,236.45

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	289,923,067.59	17.41	588,462,685.50	19.57
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	289,923,067.59	17.41	588,462,685.50	19.57

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%	27,253,625.34	44,873,847.21
	业绩比较基准下降5%	-27,253,625.34	-44,873,847.21

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	609,625,861.29	1,172,338,769.65
第二层次	1,309,506,576.51	1,868,403,000.00
第三层次	-	-

合计	1,919,132,437.80	3,040,741,769.65
----	------------------	------------------

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	289,923,067.59	14.90
	其中：股票	289,923,067.59	14.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,629,209,370.21	83.71
	其中：债券	1,629,209,370.21	83.71
	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	7,980,531.53	0.41
8	其他各项资产	19,086,811.99	0.98
9	合计	1,946,199,781.32	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	6,928,000.00	0.42
B	采矿业	7,687,453.50	0.46
C	制造业	93,742,212.26	5.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,643,075.00	1.24
E	建筑业	21,280,000.00	1.28
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,366,590.00	1.58
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	894,179.44	0.05
J	金融业	32,340,000.00	1.94
K	房地产业	62,622,354.39	3.76
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,445,907.00	0.81
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	3,973,296.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	289,923,067.59	17.41

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	600519	贵州茅台	17,210	35,194,450.00	2.11
2	601658	邮储银行	6,000,000	32,340,000.00	1.94

3	000002	万 科 A	1,500,000	30,750,000.00	1.85
4	601006	大秦铁路	4,001,000	26,366,590.00	1.58
5	601668	中国建筑	4,000,000	21,280,000.00	1.28
6	600325	华发股份	2,300,000	17,411,000.00	1.05
7	601155	新城控股	568,673	14,461,354.39	0.87
8	603259	药明康德	129,300	13,445,907.00	0.81
9	600027	华电国际	3,000,000	11,790,000.00	0.71
10	603501	韦尔股份	60,300	10,433,709.00	0.63
11	002791	坚朗五金	78,800	10,221,936.00	0.61
12	300450	先导智能	144,857	9,152,065.26	0.55
13	600104	上汽集团	500,000	8,905,000.00	0.53
14	600863	内蒙华电	2,425,500	8,853,075.00	0.53
15	601899	紫金矿业	823,950	7,687,453.50	0.46
16	002311	海大集团	120,200	7,213,202.00	0.43
17	600975	新五丰	800,000	6,928,000.00	0.42
18	600720	祁连山	500,000	6,200,000.00	0.37
19	002415	海康威视	164,800	5,965,760.00	0.36
20	601098	中南传媒	420,900	3,973,296.00	0.24
21	300496	中科创达	6,853	894,179.44	0.05
22	300428	立中集团	13,800	456,090.00	0.03

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	601225	陕西煤业	39,988,219.90	1.33
2	002812	恩捷股份	32,965,146.96	1.10
3	601658	邮储银行	31,769,173.00	1.06
4	002180	纳思达	27,778,494.96	0.92
5	000002	万 科 A	27,435,621.00	0.91
6	300390	天华超净	27,327,436.16	0.91
7	601006	大秦铁路	26,330,750.00	0.88
8	002142	宁波银行	23,665,913.08	0.79
9	601668	中国建筑	21,780,000.00	0.72
10	601877	正泰电器	21,439,073.00	0.71
11	300054	鼎龙股份	21,375,796.88	0.71
12	601677	明泰铝业	21,365,218.12	0.71
13	300014	亿纬锂能	20,679,252.90	0.69
14	600519	贵州茅台	19,924,294.13	0.66
15	601899	紫金矿业	19,849,833.50	0.66
16	605117	德业股份	19,650,494.00	0.65
17	002179	中航光电	16,400,263.75	0.55

18	600809	山西汾酒	16,142,379.20	0.54
19	601155	新城控股	15,999,541.71	0.53
20	600325	华发股份	15,124,707.00	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	300390	天华超净	65,119,682.26	2.17
2	601677	明泰铝业	52,836,964.73	1.76
3	601225	陕西煤业	51,821,828.07	1.72
4	300316	晶盛机电	41,327,222.22	1.37
5	300750	宁德时代	38,061,695.09	1.27
6	600519	贵州茅台	34,448,017.00	1.15
7	600745	闻泰科技	32,081,026.65	1.07
8	002812	恩捷股份	31,250,431.00	1.04
9	002484	江海股份	26,985,447.99	0.90
10	601888	中国中免	23,553,861.69	0.78
11	002180	纳思达	23,238,090.00	0.77
12	600887	伊利股份	21,652,749.37	0.72
13	002142	宁波银行	21,256,452.10	0.71
14	300054	鼎龙股份	20,537,113.03	0.68
15	605117	德业股份	19,096,191.00	0.63
16	688116	天奈科技	18,003,421.85	0.60
17	300014	亿纬锂能	17,585,167.00	0.58
18	601877	正泰电器	16,745,070.75	0.56
19	002371	北方华创	16,665,765.73	0.55
20	002179	中航光电	16,422,838.56	0.55

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	853,108,730.34
卖出股票收入（成交）总额	1,038,401,912.31

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	191,449,777.05	11.50
2	央行票据	-	-
3	金融债券	416,593,956.16	25.02
	其中：政策性金融债	72,034,380.82	4.33
4	企业债券	96,222,809.31	5.78

5	企业短期融资券	71,098,983.56	4.27
6	中期票据	534,141,050.43	32.08
7	可转债（可交换债）	319,702,793.70	19.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,629,209,370.21	97.84

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	019641	20 国债 11	1,000,000	102,428,986.30	6.15
2	2028044	20 广发银行二级 01	900,000	95,625,789.04	5.74
3	210203	21 国开 03	600,000	61,790,958.90	3.71
4	2128030	21 交通银行二级	500,000	51,913,000.00	3.12
5	102103356	21 湘高速 MTN008	500,000	50,845,764.38	3.05

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，交通银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、国家开发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	347,476.07
2	应收清算款	16,381,677.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,357,658.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,086,811.99

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	113052	兴业转债	15,634,014.80	0.94
2	132018	G 三峡 EB1	15,002,415.18	0.90
3	127042	嘉美转债	7,925,309.56	0.48
4	110079	杭银转债	7,516,944.66	0.45
5	110043	无锡转债	6,699,822.11	0.40
6	113609	永安转债	6,690,546.00	0.40
7	113549	白电转债	6,415,975.82	0.39
8	127041	弘亚转债	6,361,199.39	0.38
9	128074	游族转债	6,342,725.75	0.38
10	128044	岭南转债	6,322,696.96	0.38
11	128129	青农转债	6,300,106.85	0.38
12	123099	普利转债	6,210,182.62	0.37
13	123035	利德转债	6,198,569.47	0.37
14	113048	晶科转债	6,159,748.71	0.37
15	127047	帝欧转债	6,152,594.26	0.37
16	127024	盈峰转债	5,838,333.64	0.35
17	113033	利群转债	5,542,601.75	0.33
18	123004	铁汉转债	5,357,554.79	0.32
19	127040	国泰转债	5,159,894.79	0.31
20	123100	朗科转债	5,097,185.39	0.31
21	113535	大业转债	4,575,285.27	0.27
22	128142	新乳转债	4,544,361.61	0.27
23	123107	温氏转债	4,463,962.47	0.27
24	110045	海澜转债	4,366,547.95	0.26

25	127049	希望转 2	4,265,387.31	0.26
26	123080	海波转债	4,113,940.63	0.25
27	128119	龙大转债	4,106,842.04	0.25
28	128097	奥佳转债	3,972,920.84	0.24
29	113030	东风转债	3,938,459.37	0.24
30	127029	中钢转债	3,920,345.25	0.24
31	123063	大禹转债	3,911,151.89	0.23
32	113537	文灿转债	3,862,525.68	0.23
33	123120	隆华转债	3,765,627.75	0.23
34	110080	东湖转债	3,548,930.14	0.21
35	123125	元力转债	3,539,859.45	0.21
36	128046	利尔转债	3,357,088.77	0.20
37	128100	搜特转债	3,322,450.75	0.20
38	127012	招路转债	3,301,619.98	0.20
39	127033	中装转 2	3,240,849.09	0.19
40	127017	万青转债	3,231,505.61	0.19
41	123025	精测转债	3,179,943.10	0.19
42	113620	傲农转债	2,838,876.71	0.17
43	113637	华翔转债	2,821,805.68	0.17
44	128015	久其转债	2,710,619.83	0.16
45	128066	亚泰转债	2,549,508.87	0.15
46	128017	金禾转债	2,522,031.78	0.15
47	123075	贝斯转债	2,507,738.63	0.15
48	128141	旺能转债	2,485,350.51	0.15
49	110081	闻泰转债	2,463,681.64	0.15
50	127046	百润转债	2,409,506.29	0.14
51	128106	华统转债	2,367,836.71	0.14
52	128037	岩土转债	2,335,921.64	0.14
53	127050	麒麟转债	2,299,634.52	0.14
54	127025	冀东转债	2,201,953.05	0.13
55	113591	胜达转债	1,945,440.00	0.12
56	127018	本钢转债	1,769,122.65	0.11
57	123109	昌红转债	1,765,014.16	0.11
58	128095	恩捷转债	1,732,107.40	0.10
59	123084	高澜转债	1,695,014.52	0.10
60	128021	兄弟转债	1,693,162.19	0.10
61	113044	大秦转债	1,670,769.82	0.10
62	113039	嘉泽转债	1,643,925.57	0.10
63	113604	多伦转债	1,629,920.78	0.10
64	123132	回盛转债	1,575,611.52	0.09
65	128128	齐翔转 2	1,507,942.47	0.09
66	113623	凤 21 转债	1,491,386.71	0.09
67	127021	特发转 2	1,490,633.42	0.09

68	123121	帝尔转债	1,476,993.15	0.09
69	128069	华森转债	1,454,076.16	0.09
70	118003	华兴转债	1,439,299.73	0.09
71	128108	蓝帆转债	1,425,097.84	0.09
72	113585	寿仙转债	1,392,427.53	0.08
73	128073	哈尔转债	1,316,560.27	0.08
74	113545	金能转债	1,314,698.63	0.08
75	113570	百达转债	1,289,554.79	0.08
76	113534	鼎胜转债	1,288,171.51	0.08
77	123091	长海转债	1,278,254.64	0.08
78	113505	杭电转债	1,223,800.45	0.07
79	113519	长久转债	1,173,958.90	0.07
80	110052	贵广转债	1,161,896.71	0.07
81	123027	蓝晓转债	1,125,233.01	0.07
82	127038	国微转债	1,005,167.41	0.06
83	113636	甬金转债	980,482.21	0.06
84	123076	强力转债	950,199.41	0.06
85	128063	未来转债	942,781.37	0.06
86	113616	韦尔转债	934,926.44	0.06
87	123112	万讯转债	821,993.26	0.05
88	110038	济川转债	734,446.83	0.04
89	127045	牧原转债	644,999.18	0.04
90	123050	聚飞转债	586,212.30	0.04
91	113601	塞力转债	570,852.88	0.03
92	110063	鹰 19 转债	565,572.60	0.03
93	128143	锋龙转债	376,850.88	0.02
94	127031	洋丰转债	353,072.71	0.02
95	127016	鲁泰转债	332,429.47	0.02
96	128131	崇达转 2	295,553.47	0.02

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

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
嘉实多元 债券 A	10,998	101,101.47	959,775,291.30	86.32	152,138,673.18	13.68
嘉实多元 债券 B	2,424	86,578.36	138,259,856.53	65.88	71,606,091.71	34.12
合计	13,082	101,038.06	1,098,035,147.83	83.07	223,744,764.89	16.93

注：(1) 嘉实多元债券 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实多元债券 A 份额占嘉实多元债券 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实多元债券 A 份额占嘉实多元债券 A 总份额比例；

(2) 嘉实多元债券 B: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实多元债券 B 份额占嘉实多元债券 B 总份额比例、个人投资者持有嘉实多元债券 B 份额占嘉实多元债券 B 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实多元债券 A	1,271,192.99	0.11
	嘉实多元债券 B	0.79	0.00
	合计	1,271,193.78	0.10

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	份额级别	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	嘉实多元债券 A	50~100
	嘉实多元债券 B	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	嘉实多元债券 A	50~100
	嘉实多元债券 B	0
	合计	50~100

§9 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
基金合同生效日 (2008 年 9 月 10 日)		
基金份额总额	998,363,495.91	3,581,412,351.15
本报告期期初基金份额总额	1,602,516,570.79	700,923,923.05
本报告期基金总申购份额	62,377,593.66	288,142,995.47
减:本报告期基金总赎回份额	552,980,199.97	779,200,970.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,111,913,964.48	209,865,948.24

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。

§ 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 5 月 21 日本基金管理人发布《关于嘉实多元债券基金经理变更的公告》, 王茜女士不再担任本基金基金经理职务, 增聘李宇昂先生、董福焱先生担任本基金基金经理, 与洪流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 (%)	
东方证券股份有限公司	2	591,251,066.82	31.26	373,255.09	27.28	-
长江证券股份有限公司	3	511,413,014.42	27.04	459,513.61	33.59	-
浙商证券股份有限公司	2	340,398,312.53	18.00	227,960.79	16.66	-
中国国际金融股份有限公司	2	215,159,291.21	11.37	150,612.30	11.01	-
东方财富证券股份有限公司	2	68,666,662.12	3.63	43,350.04	3.17	-
申万宏源证券有限公司	1	46,976,745.00	2.48	32,883.72	2.40	-
东吴证券股份有限公司	1	45,605,927.70	2.41	28,790.96	2.10	-
国都证券股份有限公司	1	43,515,906.85	2.30	30,461.14	2.23	-
安信证券股份有限	1	18,749,074.00	0.99	14,496.31	1.06	-

公司						
光大证券股份有限公司	1	9,774,642.00	0.52	6,842.25	0.50	-
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
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：广发证券股份有限公司新增交易单元 1 个，华金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 (%)
东方证券股份有限公司	2,213,041,123.00	36.36	2,323,400,000.00	41.23	-	-
长江证券股份有限公司	1,691,808,684.22	27.80	7,000,000.00	0.12	-	-
浙商证券股份有限公司	371,796,933.98	6.11	500,404,000.00	8.88	-	-
中国国际金融股份有限公司	807,365,740.33	13.26	107,000,000.00	1.90	-	-
东方财富证券股份有限公司	157,763,247.36	2.59	532,000,000.00	9.44	-	-
申万宏源证券有限公司	289,511,404.19	4.76	1,069,000,000.00	18.97	-	-
东吴证券股份有限公司	95,917,365.67	1.58	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	225,672,422.30	3.71	1,097,071,000.00	19.47	-	-
安信证券股份有限公司	22,875,640.05	0.38	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	22,040,602.60	0.36	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	188,923,000.00	3.10	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中泰证券 股份有限 公司						
中信建投 证券股份 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	嘉实多元收益债券型证券投资基金 2021 年第三次收益分配公告	上海证券报、基金管理 人网站及中国证监会基 金电子披露网站	2022 年 1 月 18 日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员 变更公告	上海证券报、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
3	关于嘉实多元债券基金经理变更的公 告	上海证券报、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 21 日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 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

11.3 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