

# 嘉实多盈债券型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 28 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 24 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。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 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	6
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、基金净值表现及利润分配情况</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	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
8.3 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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
8.6 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	56
8.7 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	57
8.8 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	57
8.9 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	57
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.11 投资组合报告附注	57
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.3 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	59
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	59
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>59</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	60
11.2 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	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4 基金投资策略的改变	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 其他重大事件	65
<b>§ 12 备查文件目录</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实多盈债券型证券投资基金	
基金简称	嘉实多盈债券	
基金主代码	017717	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 28 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	226,903,278.19 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	嘉实多盈债券 A	嘉实多盈债券 C
下属分级基金的交 易代码	017717	017718
报告期末下属分级 基金的份额总额	183,831,830.54 份	43,071,447.65 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，通过债券及股票主动的投资管理，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>资产配置策略：本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化进行动态调整。</p> <p>债券等固定收益类资产投资策略：本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，力争获取较高的投资收益。</p> <p>可转换债券与可交换债券投资策略：本基金将在定量分析与主动研究相结合的基础上，结合可转换债券/可交换债券的交易价格、转换条件以及转股价值，制定相应的投资策略以及选择合适的转换时机。</p> <p>股票投资策略：本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合、精选行业和个股的策略。以公司行业研究员的基本面分析为基础，同时结合基金经理的分析与判断，精选价值被低估的投资品种。</p> <p>本基金其他策略包括：国债期货投资策略、购买信用衍生品规避个券信用风险策略等。</p>
业绩比较基准	中债总财富（总值）指数收益率×90%+中证 800 指数收益率×7%+恒生指数收益率×3%（人民币计价）
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于货

	币市场基金，但低于混合型基金和股票型基金。本基金可投资港股通标的的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
--	---

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	任航
	联系电话	(010)65215588	010-66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65215588	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100020	100031
法定代表人		经雷	谷澍

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）		2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日	
	嘉实多盈债券 A	嘉实多盈债券 C	嘉实多盈债券 A	嘉实多盈债券 C
本期已实现收益	24,141,996.80	5,442,884.76	-28,034,035.87	-10,926,541.48
本期利润	32,158,865.90	9,177,141.11	-32,998,437.68	-12,448,422.18
加权平均基	0.0550	0.0524	-0.0177	-0.0216

金份额本期利润				
本期加权平均净值利润率	5.48%	5.26%	-1.79%	-2.18%
本期基金份额净值增长率	5.95%	5.47%	-1.50%	-1.88%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	8,012,385.71	1,502,861.07	-17,609,781.04	-6,973,679.83
期末可供分配基金份额利润	0.0436	0.0349	-0.0150	-0.0188
期末基金资产净值	191,844,216.25	44,574,308.72	1,156,474,048.39	363,656,580.52
期末基金份额净值	1.0436	1.0349	0.9850	0.9812
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	4.36%	3.49%	-1.50%	-1.88%

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

嘉实多盈债券 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
过去三个月	1.21%	0.26%	2.80%	0.17%	-1.59%	0.09%
过去六个月	2.82%	0.22%	5.46%	0.15%	-2.64%	0.07%
过去一年	5.95%	0.17%	9.19%	0.13%	-3.24%	0.04%

自基金合同生效 起至今	4.36%	0.14%	12.11%	0.11%	-7.75%	0.03%
----------------	-------	-------	--------	-------	--------	-------

嘉实多盈债券 C

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
过去三个月	1.11%	0.26%	2.80%	0.17%	-1.69%	0.09%
过去六个月	2.59%	0.22%	5.46%	0.15%	-2.87%	0.07%
过去一年	5.47%	0.17%	9.19%	0.13%	-3.72%	0.04%
自基金合同生效 起至今	3.49%	0.14%	12.11%	0.11%	-8.62%	0.03%

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：

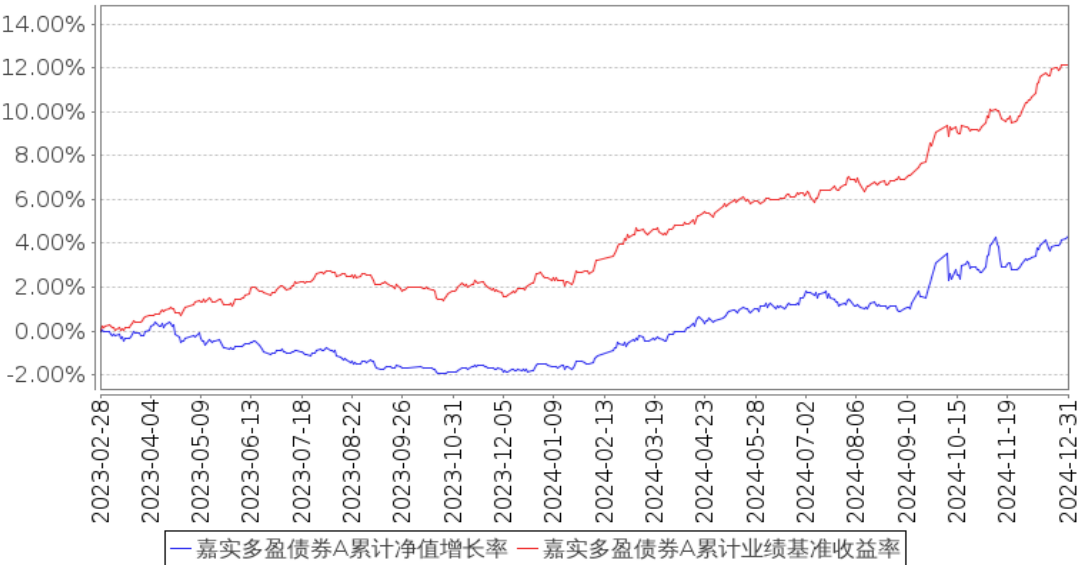
$$\text{Return}(t) = 90\% \times (\text{中债总财富(总值)指数}(t) / \text{中债总财富(总值)指数}(t-1) - 1) + 7\% \times (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 3\% \times (\text{恒生指数(人民币计价)}(t) / \text{恒生指数(人民币计价)}(t-1) - 1)$$

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

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

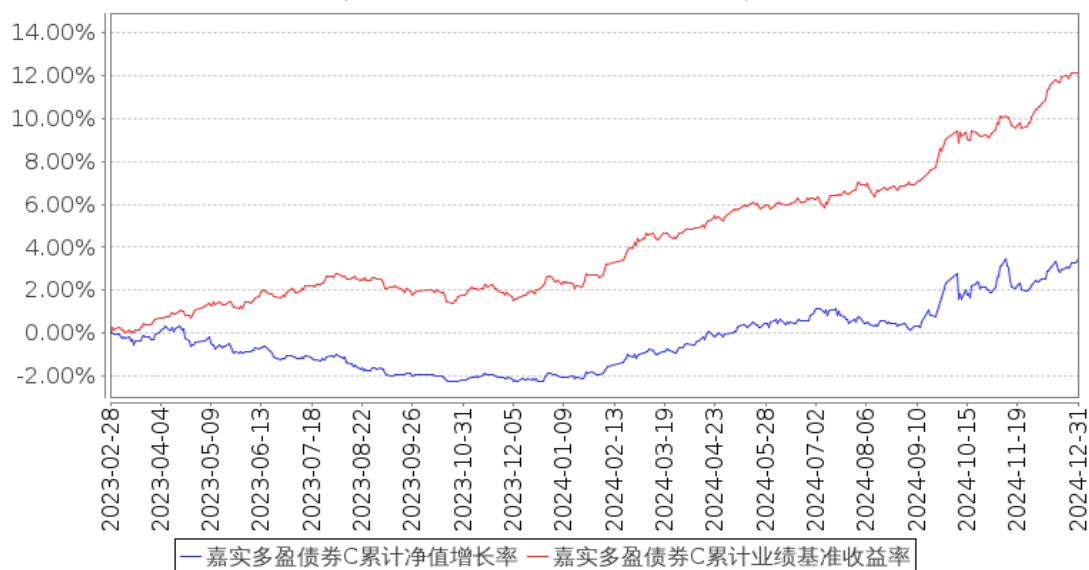
嘉实多盈债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2023年02月28日至2024年12月31日)





嘉实多盈债券C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

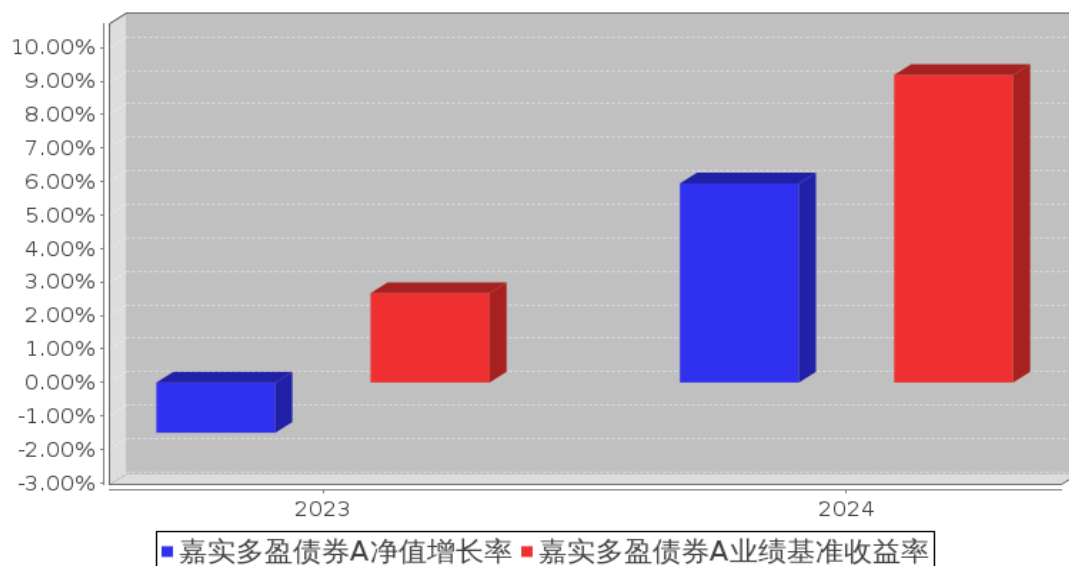
(2023年02月28日至2024年12月31日)

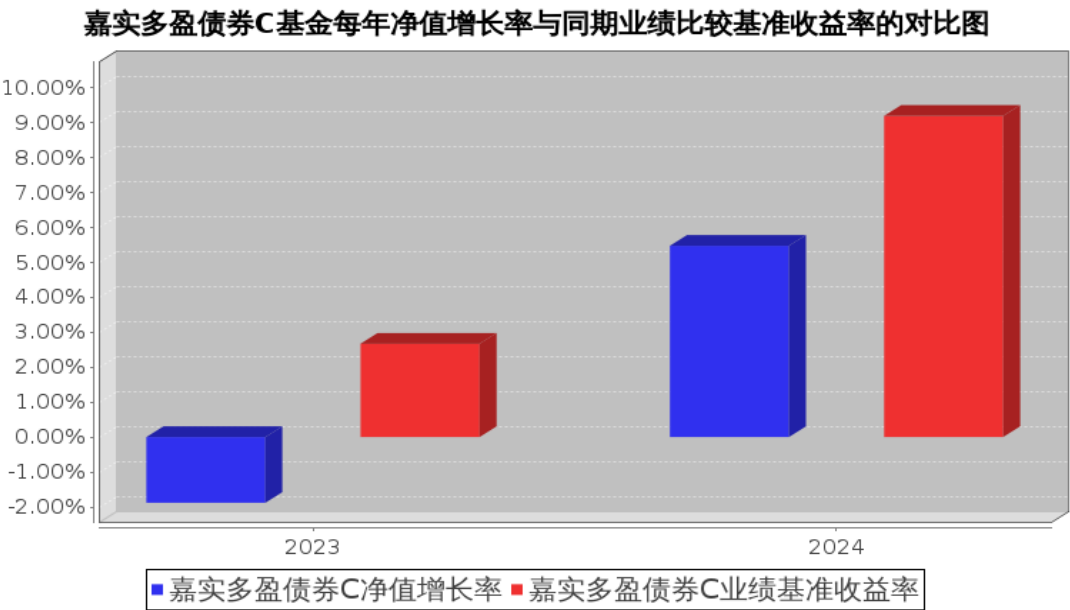


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实多盈债券A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图





注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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。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 2024 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 355 只公募基金，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、基础设施基金等不同类别。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		
赖礼	本基金、	2023 年 2	-	17 年	曾任长城证券有限责任公司金融研究所股

辉	嘉实新起点混合、嘉实新趋势混合、嘉实安益混合、嘉实稳宏债券、嘉实鑫泰一年持有混合、嘉实稳健添翼一年持有混合、嘉实稳健兴享 6 个月持有期债券基金经理	月 28 日			票行业研究员、瑞银证券有限责任公司财富管理部证券分析师，2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部，历任信用研究员、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、《嘉实多盈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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交

易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 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 11 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 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

2024 年全球经济环境复杂多变，国内经济在中央政策及时调整后，仍实现了全年 5% 左右的增长目标。经济和政策变化，导致资本市场波动较大，最终股债仍实现了双牛。

年初经济开局较好，工业部门和制造业投资对经济拉动作用较大，但通胀低迷。一季度初股票市场由于雪球和量化产品陆续暴雷，整个资本市场风险偏好大幅回落，市场缺乏流动性，股指创出最近两年新低；债市则迎来了一波年初配置潮，长债收益率下行较快，引发了央行监管加强。本组合在此期间保持股票低仓位，并阶段性利用股指期货进行了部分对冲，结构上主要聚焦在资源开采、运营商、公用事业等红利资产上。债券资产则久期偏短，未能有效抓住机会。

二季度经济回落，主要受地产下行的拖累，517 地产新政出台，但政策效果不明显。权益市场在地产新政前后见顶回落，重新回到下行趋势。市场极度厌恶风险，以红利和长期国债为首的低风险资产表现最好。组合权益资产整体降仓，增加了港股红利和互联网配置，防御策略为主。

债券则加仓了长端利率和中等期限信用债，高杠杆，久期调整至中性偏多。

居民和企业信心不足持续到三季度后期，中央为扭转预期，自 9 月 24 日开始推出一系列经济刺激政策，货币宽松政策先行，财政持续加码，房地产政策根本性反转，从大幅降低首付比例，到存量、增量房贷利率大幅调降，房地产销售数据自四季度开始真正好转，并带动经济向上修复。股票市场自政策推出后，吸引了场外资金入场，量价以前所未有的速度上升，尽管中间有波折，整个四季度市场表现很好，特别是 AI 加持的科技板块，明显强于价值蓝筹。组合 10 月份开始调整权益持仓结构至均衡配置，减持红利、加仓半导体、信创、AI 应用、军工等，整体仓位抬升。

政策转变引发了债市调整，9 月底债市收益率调整至上半年低点位置，组合在四季度重点加仓了 10 年以上超长端国债和地方政府债，整体久期拉长，杠杆下降至中性。

回顾整个 2024 年组合操作，权益资产前三季度以红利为主的策略基本正确，四季度市场风格转变之后，及时调整结构，抓住了港股科技板块的机会；债券上半年偏保守，下半年也调整到位。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实多盈债券 A 基金份额净值为 1.0436 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.95%；截至本报告期末嘉实多盈债券 C 基金份额净值为 1.0349 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.47%；业绩比较基准收益率为 9.19%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年国内经济承前启后，新旧动能转换稳步推进，虽然面临着美国加征关税的风险，但总体趋势仍有望向好。全球科技革命提高全要素生产率，国内有望逐步走出低位通胀，带动部分行业盈利触底回升，且国内货币政策适度宽松，资本市场仍有望稳中向好，我们将尽量积极把握结构性投资机会，为投资者实现资产增值。

诚然中国人口总量下降和老龄化将制约长期经济发展，但当前市场是否过于定价其中、短期的影响。人口因素对地产和消费影响最直接，回顾过去三年，国内经济经历了房地产市场快速调整引发的阵痛期，但总量经济并没有出现海外发达国家类似的快速衰退，逐步崛起的高端制造部分对冲了房地产的拖累，包括汽车、电新、造船等制造业在全球市场份额不断提升，AI 科技紧随美国。

展望 2025 年，对症下药的内需政策延续，中央加杠杆对冲居民和企业去杠杆，消费补贴、稳资产价格、稳就业，以及可能出台的生育补贴，产能过剩行业供给侧反内卷式改革在即。最大的不确定性是外需，美国关税不仅仅针对中国，而是掀起全球贸易重构，当前市场更多关注其中的风险，而忽视中国在非美市场的潜在机遇。

对冲风险的积极政策，将支撑 25 年国内资本市场风险偏好，海外环境变化和国内政策预期变

动会有阶段性扰动。权益资产经历了 24 年四季度以来的整体估值抬升，25 年非主题行业的上涨需要看到基本面真正见底回升，消费、供给侧改革相关行业和海外制造业投资相关的部分资源品等，有望见到盈利修复。而 AI 不断迭代，带动上游国产算力、下游应用、智驾、机器人等进展加速，主题机会可能贯穿全年。本组合权益投资将围绕上述资产进行布局，以胜率为先，及时止盈止损。关于转债，由于纯债资产的机会成本降低，转债估值可能系统性高于 24 年，但我们仍需要关注阶段性估值下杀风险，灵活调整仓位。

25 年债券资产投资难度则大幅增加，低票息叠加监管风险，纯债进入高波动低赔率区间。由于保险等长期资金的资产、负债期限仍错配，在真正走出通缩之前，国内长债的胜率仍在，中、短期限债券机会则更取决于货币政策。本组合 25 年债券资产投资将更注重交易而非配置，久期和杠杆策略更加灵活。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

（4）基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关

指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

#### 4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——嘉实基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发

现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(25)第 P00517 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实多盈债券型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了嘉实多盈债券型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了嘉实多盈债券型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实多盈债券型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括嘉实多盈债券型证券投资基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。</p>



	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实多盈债券型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实多盈债券型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实多盈债券型证券投资基金的财务报告过程。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实多盈债券型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实多盈债券型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	汪芳	姜金玲
会计师事务所的地址	中国上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼	
审计报告日期	2025 年 03 月 26 日	

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实多盈债券型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	3,751,250.41	8,789,024.29
结算备付金		2,578,015.76	36,002,177.16
存出保证金		250,042.43	2,222,442.66
交易性金融资产	7.4.7.2	269,451,626.12	1,950,524,218.02
其中：股票投资		23,126,104.73	93,530,093.00
基金投资		—	—
债券投资		246,325,521.39	1,856,994,125.02
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
其他投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
债权投资	7.4.7.5	—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资	7.4.7.6	—	—
其他权益工具投资	7.4.7.7	—	—
应收清算款		1,493,645.96	—
应收股利		10,800.00	—
应收申购款		3,750.58	134.57
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.8	—	—
资产总计		277,539,131.26	1,997,537,996.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		34,210,255.34	456,278,036.46
应付清算款		625,072.05	6,720,400.12
应付赎回款		5,888,517.99	12,954,734.07

应付管理人报酬		122,565.12	803,126.60
应付托管费		20,427.55	133,854.42
应付销售服务费		18,676.46	145,595.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11,369.42	66,209.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	223,722.36	305,411.32
负债合计		41,120,606.29	477,407,367.79
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	226,903,278.19	1,544,714,089.78
未分配利润	7.4.7.12	9,515,246.78	-24,583,460.87
净资产合计		236,418,524.97	1,520,130,628.91
负债和净资产总计		277,539,131.26	1,997,537,996.70

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，嘉实多盈债券 A 基金份额净值 1.0436 元，基金份额总额 183,831,830.54 份，嘉实多盈债券 C 基金份额净值 1.0349 元，基金份额总额 43,071,447.65 份，基金份额总额合计为 226,903,278.19 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实多盈债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		52,830,283.15	-21,344,959.62
1. 利息收入		303,138.16	3,115,689.05
其中：存款利息收入	7.4.7.13	301,203.34	967,106.91
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,934.82	2,148,582.14
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		40,769,448.94	-17,974,389.94
其中：股票投资收益	7.4.7.14	7,714,697.30	-84,919,105.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	33,327,917.09	67,323,530.24
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-2,243,852.48	-3,329,267.93
股利收益	7.4.7.19	1,970,687.03	2,950,453.24
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	11,751,125.45	-6,486,282.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	6,570.60	23.78
减：二、营业总支出		11,494,276.14	24,101,900.24
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,615,786.67	12,169,127.43
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	769,297.85	2,028,187.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	814,575.56	2,202,042.84
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,997,232.23	7,358,625.68
其中：卖出回购金融资产支出		4,997,232.23	7,358,625.68
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		40,609.53	45,322.79
8. 其他费用	7.4.7.23	256,774.30	298,593.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,336,007.01	-45,446,859.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,336,007.01	-45,446,859.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		41,336,007.01	-45,446,859.86

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实多盈债券型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	1,544,714,089.78	-	-24,583,460.87	1,520,130,628.91
二、本期期初净资产	1,544,714,089.	-	-24,583,460.87	1,520,130,628.9

	78			1
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,317,810,811.59	-	34,098,707.65	-1,283,712,103.94
(一)、综合收益总额	-	-	41,336,007.01	41,336,007.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,317,810,811.59	-	-7,237,299.36	-1,325,048,110.95
其中：1. 基金申购款	88,617,310.99	-	1,375,539.71	89,992,850.70
2. 基金赎回款	-1,406,428,122.58	-	-8,612,839.07	-1,415,040,961.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	226,903,278.19	-	9,515,246.78	236,418,524.97
项目	上年度可比期间			
	2023 年 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	3,358,117,059.55	-	-	3,358,117,059.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,813,402,969.77	-	-24,583,460.87	-1,837,986,430.64
(一)、综合收益总额	-	-	-45,446,859.86	-45,446,859.86
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,813,402,969.77	-	20,863,398.99	-1,792,539,570.78
其中：1. 基金申购款	741,388.89	-	-6,620.84	734,768.05

2. 基金赎回款	-1, 814, 144, 358. 66	-	20, 870, 019. 83	-1, 793, 274, 338. 83
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1, 544, 714, 089. 78	-	-24, 583, 460. 87	1, 520, 130, 628. 91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实多盈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[2022]3170 号《关于准予嘉实多盈债券型证券投资基金注册的批复》注册，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《嘉实多盈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，《嘉实多盈债券型证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3, 358, 117, 059. 55 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2023 年 2 月 28 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求, 本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产, 暂无金融资产划分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。

金融资产的合同条款规定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, 且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标, 则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件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。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外, 其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

###### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的, 在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债, 或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产, 取得时发生的相关交易费用计入当期损益; 以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额; 支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或

债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产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，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为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。除购买或源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形的，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若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风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的新金融负债）之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层



次。第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值原则如下：

(1) 对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市价不能真实反映公允价值的，应对市价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当投资品种不存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

(3) 经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整，确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指

在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

##### (2) 投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本与相关交易费用的差额确认。

债券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖债券价差收入。除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括以票面利率计算的利息以及买卖资产支持证券价差收入。资产支持证券利息收入在持有期内，按资产支持证券的票面价值和预计收益率计算的利息逐日确认资产支持证券利息收入。在收到资产支持证券支付的款项时，其中属于证券投资收益的部分冲减应计利息(若有)后的差额，确认资产支持证券利息收入。买卖资产支持证券价差收入为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应计利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本、相关交易费用与税费后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认，由上市公司代扣代缴的个人所得税于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

##### (3) 公允价值变动收益

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。

#### (4) 信用减值损失

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信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

#### 7.4.4.10 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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 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。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局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[2014]81

号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金管理人为增值税纳税人, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税;

(2) 对证券投资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, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不缴纳企业所得税;

(3) 对基金取得的股票股息、红利收入, 由上市公司代扣代缴个人所得税; 从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 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, 股息红利所得暂免征收个人所得税。其中, 对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股, 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。对基金通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利, H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请, 由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册, H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利, 由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税;

(4) 对于基金从事 A 股买卖, 出让方按 0.10% 的税率缴纳证券(股票)交易印花税, 对受让方不

再缴纳印花税；对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税；

(5) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	3,751,250.41	8,789,024.29
等于：本金	3,750,450.07	8,787,803.35
加：应计利息	800.34	1,220.94
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	3,751,250.41	8,789,024.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		22,292,838.86	-	23,126,104.73	833,265.87
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	32,756,581.39	377,843.02	34,088,793.02	954,368.61
	银行间市场	207,055,334.40	1,602,628.37	212,236,728.37	3,578,765.60
	合计	239,811,915.79	1,980,471.39	246,325,521.39	4,533,134.21

资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		262,104,754.65	1,980,471.39	269,451,626.12	5,366,400.08
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		98,048,785.26	-	93,530,093.00	-4,518,692.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	604,640,709.32	8,004,923.43	610,872,463.43	-1,773,169.32
	银行间市场	1,228,233,420.93	17,298,461.59	1,246,121,661.59	589,779.07
	合计	1,832,874,130.25	25,303,385.02	1,856,994,125.02	-1,183,390.25
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,930,922,915.51	25,303,385.02	1,950,524,218.02	-5,702,082.51

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-5,839,442.86	-	-	-
其中：国债期货投资	-5,839,442.86	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-5,839,442.86	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	

利率衍生工具	-136,778,600.00	-	-	-
其中：国债期货投资	-136,778,600.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-136,778,600.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
TL2503	TL2503	-5.00	-5,941,000.00	-101,557.14
合计				-101,557.14
减：可抵销期货暂收款				-101,557.14
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的利率衍生工具为国债期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。



7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	53,722.36	98,247.32
其中：交易所市场	42,006.03	80,901.99
银行间市场	11,716.33	17,345.33
应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	207,164.00
合计	223,722.36	305,411.32

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实多盈债券 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,174,083,829.43	1,174,083,829.43
本期申购	79,112,573.55	79,112,573.55
本期赎回（以“-”号填列）	-1,069,364,572.44	-1,069,364,572.44
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	183,831,830.54	183,831,830.54

嘉实多盈债券 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	370,630,260.35	370,630,260.35
本期申购	9,504,737.44	9,504,737.44
本期赎回（以“-”号填列）	-337,063,550.14	-337,063,550.14
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	43,071,447.65	43,071,447.65

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实多盈债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-16,365,059.23	-1,244,721.81	-17,609,781.04
本期期初	-16,365,059.23	-1,244,721.81	-17,609,781.04
本期利润	24,141,996.80	8,016,869.10	32,158,865.90
本期基金份额交易产生的变动数	2,594,511.02	-9,131,210.17	-6,536,699.15
其中：基金申购款	62,528.57	1,122,039.71	1,184,568.28
基金赎回款	2,531,982.45	-10,253,249.88	-7,721,267.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,371,448.59	-2,359,062.88	8,012,385.71

嘉实多盈债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,578,517.98	-395,161.85	-6,973,679.83
本期期初	-6,578,517.98	-395,161.85	-6,973,679.83
本期利润	5,442,884.76	3,734,256.35	9,177,141.11
本期基金份额交易产生的变动数	3,179,787.19	-3,880,387.40	-700,600.21
其中：基金申购款	128,694.06	62,277.37	190,971.43
基金赎回款	3,051,093.13	-3,942,664.77	-891,571.64

本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,044,153.97	-541,292.90	1,502,861.07

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	33,435.38	568,392.08
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	266,683.86	395,336.30
其他	1,084.10	3,378.53
合计	301,203.34	967,106.91

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	7,714,697.30	-84,919,105.49
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	7,714,697.30	-84,919,105.49

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	233,376,940.66	1,025,239,752.83
减：卖出股票成本总额	225,155,276.30	1,107,260,104.88
减：交易费用	506,967.06	2,898,753.44
买卖股票差价收	7,714,697.30	-84,919,105.49

入		
---	--	--

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入  
无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年2月28日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	31,285,362.71	69,628,086.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,042,554.38	-2,304,556.33
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	33,327,917.09	67,323,530.24

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年2月28日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,898,054,830.72	1,771,534,223.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,860,595,891.53	1,749,290,554.62
减：应计利息总额	35,396,424.72	24,518,876.81
减：交易费用	19,960.09	29,348.16
买卖债券差价收入	2,042,554.38	-2,304,556.33

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入  
无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入  
无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-2,243,852.48	-3,329,267.93

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利	1,970,687.03	2,950,453.24

收益		
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	1,970,687.03	2,950,453.24

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	11,068,482.59	-5,702,082.51
股票投资	5,351,958.13	-4,518,692.26
债券投资	5,716,524.46	-1,183,390.25
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	682,642.86	-784,200.00
权证投资	-	-
期货投资	682,642.86	-784,200.00
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	11,751,125.45	-6,486,282.51

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	6,421.17	22.22
基金转出费收入	149.43	1.56
合计	6,570.60	23.78

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
----	---	---

审计费用	50,000.00	81,000.00
信息披露费	120,000.00	126,164.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	47,873.33	69,825.32
债券托管账户维护费	36,000.00	18,000.00
其他	1,200.00	1,000.00
深港通证券组合费	1,700.97	2,604.27
合计	256,774.30	298,593.59

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
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

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,615,786.67	12,169,127.43
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,246,300.24	5,887,622.42
应支付基金管理人的净管理费	2,369,486.43	6,281,505.01

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 0.60%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×0.60%/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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	769,297.85	2,028,187.91

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多盈债券 A	嘉实多盈债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	74.32	74.32
中国农业银行	-	489,879.41	489,879.41
合计	-	489,953.73	489,953.73
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		



方名称	2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实多盈债券 A	嘉实多盈债券 C	合计
嘉实基金管理有限公司	—	151.52	151.52
中国农业银行	—	1,397,838.33	1,397,838.33
合计	—	1,397,989.85	1,397,989.85

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.46%，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：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.46%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 2 月 28 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	3,751,250.41	33,435.38	8,789,024.29	568,392.08

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日），本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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 27,010,617.70 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
2028049	20 工商银行二级 02	2025 年 1 月 2 日	102.68	100,000	10,267,841.10
2471196	24 江苏债 33	2025 年 1 月 2 日	104.61	50,000	5,230,662.98
2471255	24 四川债 66	2025 年 1 月 2 日	104.99	150,000	15,748,928.57
合计				300,000	31,247,432.65

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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 7,199,637.64 元，于 2025 年 1 月 2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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、risk 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	2,510,944.52	234,149,658.29
合计	2,510,944.52	234,149,658.29

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	134,163,054.90	1,332,176,217.91
AAA 以下	31,226,268.62	121,451,093.43
未评级	78,425,253.35	169,217,155.39
合计	243,814,576.87	1,622,844,466.73

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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约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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,751,250.41	-	-	-	3,751,250.41
结算备付金	2,578,015.76	-	-	-	2,578,015.76
存出保证金	42,107.43	-	-	207,935.00	250,042.43
交易性金融资产	43,749,592.19	94,906,844.79	107,669,084.41	23,126,104.73	269,451,626.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	1,493,645.96	1,493,645.96
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	10,800.00	10,800.00
应收申购款	-	-	-	3,750.58	3,750.58
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	50,120,965.79	94,906,844.79	107,669,084.41	24,842,236.27	277,539,131.26
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	34,210,255.34	-	-	-	34,210,255.34
应付清算款	-	-	-	625,072.05	625,072.05
应付赎回款	-	-	-	5,888,517.99	5,888,517.99
应付管理人报酬	-	-	-	122,565.12	122,565.12
应付托管费	-	-	-	20,427.55	20,427.55
应付销售服务费	-	-	-	18,676.46	18,676.46
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,369.42	11,369.42
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	223,722.36	223,722.36
负债总计	34,210,255.34	-	-	6,910,350.95	41,120,606.29
利率敏感度缺口	15,910,710.45	94,906,844.79	107,669,084.41	17,931,885.32	236,418,524.97
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	8,789,024.29	-	-	-	8,789,024.29
结算备付金	36,002,177.16	-	-	-	36,002,177.16
存出保证金	160,289.06	-	-	2,062,153.60	2,222,442.66
交易性金融资产	1,016,500,663.24	506,502,486.37	333,990,975.41	93,530,093.00	1,950,524,218.02
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	134.57	134.57
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,061,452,153.75	506,502,486.37	333,990,975.41	95,592,381.17	1,997,537,996.70
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	456,278,036.46	-	-	-	456,278,036.46
应付清算款	-	-	-	6,720,400.12	6,720,400.12
应付赎回款	-	-	-	12,954,734.07	12,954,734.07
应付管理人报酬	-	-	-	803,126.60	803,126.60
应付托管费	-	-	-	133,854.42	133,854.42
应付销售服务费	-	-	-	145,595.34	145,595.34
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	66,209.46	66,209.46
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	305,411.32	305,411.32
负债总计	456,278,036.46	-	-	21,129,331.33	477,407,367.79
利率敏感度缺口	605,174,117.29	506,502,486.37	333,990,975.41	74,463,049.84	1,520,130,628.91

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。

7.4.13.4.1.2 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		
分析	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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-4,150,536.76	-4,837,742.65
	市场利率下降 25 个基点	4,356,528.66	4,877,204.14

7.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产及负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计

	币			
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	4,519,135.39	-	4,519,135.39
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	4,519,135.39	-	4,519,135.39
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	4,519,135.39	-	4,519,135.39
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计



	币			
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	18,028,068.81	-	18,028,068.81
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	18,028,068.81	-	18,028,068.81
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	18,028,068.81	-	18,028,068.81

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的	

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	225,956.77	901,403.44
	所有外币相对人民币贬值 5%	-225,956.77	-901,403.44

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	23,126,104.73	9.78	93,530,093.00	6.15
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	23,126,104.73	9.78	93,530,093.00	6.15

7.4.13.4.3.2 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	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	10,435,441.13	51,132,476.85
	业绩比较基准下降 5%	-10,435,441.13	-51,132,476.85

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	24,376,119.80	93,530,093.00
第二层次	245,075,506.32	1,856,994,125.02
第三层次	-	-
合计	269,451,626.12	1,950,524,218.02

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，本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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

7.4.14.3 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）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	23,126,104.73	8.33
	其中：股票	23,126,104.73	8.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	246,325,521.39	88.75
	其中：债券	246,325,521.39	88.75
	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	6,329,266.17	2.28
8	其他各项资产	1,758,238.97	0.63
9	合计	277,539,131.26	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 4,519,135.39 元，占基金资产净值的比例为 1.91%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	2,833,546.00	1.20
C	制造业	4,360,650.63	1.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,605.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,662,193.00	1.97
J	金融业	6,082,414.00	2.57
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,060.71	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	661,500.00	0.28
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	18,606,969.34	7.87

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	1,450,363.84	0.61
非必需消费品	923,298.92	0.39
必需消费品	-	-
能源	175,595.71	0.07
金融	125,441.38	0.05
医疗保健	46,450.17	0.02
工业	76,940.03	0.03
信息技术	1,546,023.78	0.65
原材料	175,021.56	0.07
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	4,519,135.39	1.91

8.3 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	601398	工商银行	380,800	2,635,136.00	1.11
1	1398 HK	工商银行	26,000	125,441.38	0.05
2	601939	建设银行	225,400	1,981,266.00	0.84
3	981 HK	中芯国际	52,500	1,546,023.78	0.65
4	600941	中国移动	12,300	1,453,368.00	0.61
5	601728	中国电信	169,400	1,223,068.00	0.52
5	728 HK	中国电信	38,000	171,372.96	0.07
6	601857	中国石油	142,100	1,270,374.00	0.54
6	857 HK	中国石油股份	6,000	33,948.63	0.01
7	700 HK	腾讯控股	3,300	1,274,323.64	0.54
8	600028	中国石化	185,900	1,241,812.00	0.53
9	600050	中国联通	226,500	1,202,715.00	0.51
10	601658	邮储银行	206,900	1,175,192.00	0.50
11	688361	中科飞测	10,823	947,553.65	0.40
12	9988 HK	阿里巴巴-W	12,100	923,298.92	0.39
13	600760	中航沈飞	15,500	786,160.00	0.33
14	600150	中国船舶	19,500	701,220.00	0.30
15	600435	北方导航	68,600	669,536.00	0.28
16	000888	峨眉山 A	50,000	661,500.00	0.28
17	603596	伯特利	14,700	655,473.00	0.28
18	002368	太极股份	25,000	592,000.00	0.25
19	002371	北方华创	1,000	391,000.00	0.17
20	600036	招商银行	7,400	290,820.00	0.12
21	601088	中国神华	5,600	243,488.00	0.10
22	300659	中孚信息	11,800	191,042.00	0.08
23	3993 HK	洛阳钼业	36,000	175,021.56	0.07
24	883 HK	中国海洋石油	8,000	141,647.08	0.06
24	600938	中国海油	800	23,608.00	0.01
25	1186 HK	中国铁建	14,500	76,940.03	0.03
26	600480	凌云股份	5,900	63,779.00	0.03
27	600019	宝钢股份	8,400	58,800.00	0.02
28	9688 HK	再鼎医药	2,400	46,450.17	0.02
29	688008	澜起科技	527	35,783.30	0.02
30	000983	山西焦煤	4,200	34,608.00	0.01
31	603986	兆易创新	200	21,360.00	0.01
32	601899	紫金矿业	1,300	19,656.00	0.01
33	688778	厦钨新能	262	11,957.68	0.01
34	000932	华菱钢铁	2,500	10,450.00	0.00
35	600862	中航高科	300	7,578.00	0.00
36	772 HK	阅文集团	200	4,667.24	0.00

37	001391	国货航	500	4,605.00	0.00
38	603018	华设集团	251	2,060.71	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	941 HK	中国移动	6,125,501.22	0.40
1	600941	中国移动	1,417,388.00	0.09
2	9926 HK	康方生物	6,566,235.17	0.43
3	857 HK	中国石油股份	4,734,709.32	0.31
3	601857	中国石油	1,199,851.00	0.08
4	3993 HK	洛阳钼业	5,683,463.34	0.37
5	728 HK	中国电信	4,123,502.75	0.27
5	601728	中国电信	1,189,024.00	0.08
6	1398 HK	工商银行	2,702,154.13	0.18
6	601398	工商银行	2,432,641.00	0.16
7	000983	山西焦煤	4,464,619.03	0.29
8	2601 HK	中国太保	4,392,957.17	0.29
9	600150	中国船舶	4,346,122.00	0.29
10	762 HK	中国联通	4,202,213.81	0.28
11	2628 HK	中国人寿	4,120,550.34	0.27
12	1138 HK	中远海能	4,116,356.93	0.27
13	603018	华设集团	3,836,554.00	0.25
14	9688 HK	再鼎医药	3,822,349.77	0.25
15	1193 HK	华润燃气	3,517,621.11	0.23
16	601699	潞安环能	3,460,090.00	0.23
17	002475	立讯精密	3,121,541.00	0.21
18	601939	建设银行	1,912,530.00	0.13
18	939 HK	建设银行	1,042,974.59	0.07
19	3908 HK	中金公司	2,761,486.66	0.18
20	688036	传音控股	2,693,044.91	0.18

8.4.2 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	883 HK	中国海洋石油	7,210,129.58	0.47
1	600938	中国海油	5,790,989.00	0.38
2	941 HK	中国移动	6,641,101.15	0.44
2	600941	中国移动	5,218,012.00	0.34
3	9926 HK	康方生物	11,020,231.57	0.72
4	601899	紫金矿业	10,864,996.00	0.71

5	762 HK	中国联通	10,210,781.67	0.67
6	601728	中国电信	4,992,553.00	0.33
6	728 HK	中国电信	4,324,034.18	0.28
7	002179	中航光电	6,552,841.40	0.43
8	2601 HK	中国太保	6,418,003.76	0.42
9	3993 HK	洛阳钼业	5,509,761.34	0.36
10	601088	中国神华	5,468,626.00	0.36
11	600050	中国联通	4,822,297.00	0.32
12	2628 HK	中国人寿	4,721,163.08	0.31
13	1138 HK	中远海能	4,683,933.14	0.31
14	857 HK	中国石油股份	4,658,491.95	0.31
15	601975	招商南油	4,639,853.00	0.31
16	300354	东华测试	4,517,786.00	0.30
17	9688 HK	再鼎医药	4,498,437.46	0.30
18	603018	华设集团	4,480,136.19	0.29
19	2269 HK	药明生物	4,294,564.01	0.28
20	1919 HK	中远海控	2,271,187.60	0.15
20	601919	中远海控	1,904,164.00	0.13

8.4.3 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	149,399,329.90
卖出股票收入（成交）总额	233,376,940.66

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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

8.5 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	33,576,847.79	14.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	103,843,793.97	43.92
	其中：政策性金融债	21,134,090.41	8.94
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	62,482,365.61	26.43
7	可转债（可交换债）	1,250,015.07	0.53
8	同业存单	-	-
9	其他	45,172,498.95	19.11
10	合计	246,325,521.39	104.19

8.6 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	149954	22 国信 Y1	200,000	21,126,699.18	8.94
2	102382262	23 吉林高速 MTN003	200,000	20,737,733.70	8.77
3	102103232	21 拉萨城投 MTN001	200,000	20,735,514.52	8.77
4	2028042	20 兴业银行永 续债	200,000	20,667,727.12	8.74
5	2028049	20 工商银行二 级 02	200,000	20,535,682.19	8.69

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.10.1 本期国债期货投资政策

本基金国债期货操作主要以对冲现有持仓的久期风险为主，基于对利率债市场的判断和曲线形态进行择时套期保值。

8.10.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货对组合整体风险影响较小，符合既定的投资政策和目标。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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，兴业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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	250,042.43
2	应收清算款	1,493,645.96

3	应收股利	10,800.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,750.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,758,238.97

8.11.4 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	127039	北港转债	1,250,015.07	0.53

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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）	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 （%）
嘉实多盈 债券 A	1,965	93,553.09	20,221,437.52	11.00	163,610,393.02	89.00
嘉实多盈 债券 C	3,655	11,784.25	-	-	43,071,447.65	100.00
合计	5,435	41,748.53	20,221,437.52	8.91	206,681,840.67	91.09

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	嘉实多盈债券 A	172,612.13	0.09
	嘉实多盈债券 C	1,620.60	0.00

人员持有本基金			
	合计	174,232.73	0.08

9.3 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	嘉实多盈债券 A	0
	嘉实多盈债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实多盈债券 A	10~50
	嘉实多盈债券 C	0
	合计	10~50

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实多盈债券 A	嘉实多盈债券 C
基金合同生效日 （2023 年 2 月 28 日） 基金份额总额	2,590,418,827.14	767,698,232.41
本报告期期初基金份额总额	1,174,083,829.43	370,630,260.35
本报告期基金总申购份额	79,112,573.55	9,504,737.44
减：本报告期基金总赎回份额	1,069,364,572.44	337,063,550.14
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	183,831,830.54	43,071,447.65

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

2024 年 8 月 9 日本基金管理人发布公告，赵学军先生辞任公司董事长，由联席董事长安国勇先生代行公司董事长职责。

2024 年 9 月 19 日本基金管理人发布公告，安国勇先生任公司董事长。

2024 年 12 月 4 日本基金管理人发布公告，张峰先生离任公司副总经理、郭杰先生离任机构首席投资官。

2024 年 12 月 19 日本基金管理人发布公告，鲁令飞先生任公司副总经理、张敏女士任公司副总经理。

#### (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。

### 11.3 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、本基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务，自 2024 年 11 月 16 日起，改聘德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）会计师事务所为本基金提供审计服务。报告年度应支付德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 50,000.00 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.7.1 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(%)	
中信证券股份有限公司	4	159,028,122.39	41.55	92,007.71	42.13	-
广发证券股份有限公司	2	68,206,435.17	17.82	31,243.50	14.30	-
华泰证券股份有限公司	1	52,195,642.14	13.64	28,313.97	12.96	-
中国银河证券股份有限公司	2	36,233,758.68	9.47	25,363.51	11.61	-
国盛证券有限责任公司	1	16,987,482.32	4.44	8,550.97	3.92	-
申万宏源证券有限公司	2	16,332,308.80	4.27	11,432.64	5.23	-
海通证券股份有限公司	2	15,859,458.50	4.14	10,134.77	4.64	-
东方财富证券股份有限公司	2	7,814,155.00	2.04	5,046.97	2.31	-
中信建投证券股份有限公司	1	4,090,206.00	1.07	2,642.01	1.21	-
开源证券股份有限公司	2	3,546,049.00	0.93	2,290.14	1.05	-
长江证券股份有限公司	2	1,446,047.56	0.38	933.99	0.43	-
国泰君安证券股份有限公司	2	1,035,455.00	0.27	451.14	0.21	-

长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
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）合规风控能力较强；
- （4）研究、交易等服务能力较强；

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，本基金退租以下交易单元：国投证券股份有限公司退租交易单元 1 个。开源证

券股份有限公司退租交易单元 1 个。中银国际证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

5. 本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《嘉实基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 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(%)
中信证券股份有限公司	552,088.00	0.08	1,857,000,000.00	7.42	-	-
广发证券股份有限公司	82,788,382.96	11.73	249,500,000.00	1.00	-	-
华泰证券股份有限公司	241,413,190.69	34.19	7,376,000,000.00	29.46	-	-
中国银河证券股份有限公司	117,543,176.91	16.65	2,777,000,000.00	11.09	-	-
国盛证券有限责任公司	16,419,200.55	2.33	839,100,000.00	3.35	-	-
申万宏源证券有限公司	2,451,917.73	0.35	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	35,518,875.75	5.03	2,415,000,000.00	9.65	-	-
东方财富	60,186,600.	8.52	1,700,000,00	6.79	-	-

富证券 股份有 限公司	00		0.00			
中信建 投证券 股份有 限公司	13,092,970. 02	1.85	5,304,000,00 0.00	21.19	—	—
开源证 券股份 有限公 司	134,844,829 .25	19.10	1,705,000,00 0.00	6.81	—	—
长江证 券股份 有限公 司	—	—	811,782,000. 00	3.24	—	—
国泰君 安证券 股份有 限公司	1,244,873.4 9	0.18	—	—	—	—
长城证 券股份 有限公 司	—	—	—	—	—	—
方正证 券股份 有限公 司	—	—	—	—	—	—
光大证 券股份 有限公 司	—	—	—	—	—	—
国金证 券股份 有限公 司	—	—	—	—	—	—
国投证 券股份 有限公 司	—	—	—	—	—	—
国信证 券股份 有限公 司	—	—	—	—	—	—
国元证 券股份	—	—	—	—	—	—



有限公司						
上海证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
世纪证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	2024 年 9 月 19 日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	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	2024 年 11 月 16 日
3	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	2024 年 12 月 4 日
4	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	2024 年 12 月 19 日

§ 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盈债券型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实多盈债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实多盈债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实多盈债券型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实多盈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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 3 月 28 日