

# 嘉实多盈债券型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 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                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 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 | 13        |
| 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       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 18        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 41        |
| 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       | 42        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 44        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 .....    | 44        |
| 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 ..... | 45        |
| 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 ..... | 45        |
| 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 .....    | 45        |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 45        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 46        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 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 .....      | 47        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>47</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 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 .....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 48        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 48        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 48        |
| 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 .....         | 48        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 48        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 52        |
| <b>§ 11 备查文件目录 .....</b>                    | <b>52</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                           | 52        |
| 11.2 存放地点 .....                             | 52        |
| 11.3 查阅方式 .....                             | 52        |

§ 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<br>额总额      | 138,135,626.62 份 |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基<br>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<br>易代码     | 017717           | 017718          |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 112,027,436.82 份 | 26,108,189.80 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<br>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》                                                  |
| 登载基金中期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<br>据和指标 | 报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日) |            |
|-------------------|-------------------------------------|------------|
|                   | 嘉实多盈债券 A                            | 嘉实多盈债券 C   |
| 本期已实现收益           | 2,903,301.40                        | 694,040.77 |
| 本期利润              | 769,442.99                          | 88,847.70  |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | 0.0054                              | 0.0023     |

|                   |                       |               |
|-------------------|-----------------------|---------------|
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 0.52%                 | 0.22%         |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 0.56%                 | 0.33%         |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |               |
| 期末可供分配利<br>润      | 5,537,637.86          | 999,060.30    |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | 0.0494                | 0.0383        |
| 期末基金资产净<br>值      | 117,565,074.68        | 27,107,250.10 |
| 期末基金份额净<br>值      | 1.0494                | 1.0383        |
| 3.1.3 累计期<br>末指标  | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |               |
| 基金份额累计净<br>值增长率   | 4.94%                 | 3.83%         |

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<br>值增长<br>率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基准<br>收益率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------|------------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去一个月    | 0.49%            | 0.06%               | 0.72%          | 0.07%                 | -0.23% | -0.01% |
| 过去三个月    | 1.31%            | 0.07%               | 1.62%          | 0.11%                 | -0.31% | -0.04% |
| 过去六个月    | 0.56%            | 0.15%               | 1.35%          | 0.13%                 | -0.79% | 0.02%  |
| 过去一年     | 3.39%            | 0.19%               | 6.88%          | 0.14%                 | -3.49% | 0.05%  |
| 自基金合同生效起 | 4.94%            | 0.14%               | 13.62%         | 0.12%                 | -8.68% | 0.02%  |

|    |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 至今 |  |  |  |  |  |  |
|----|--|--|--|--|--|--|

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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月      | 0.45%    | 0.05%       | 0.72%      | 0.07%         | -0.27% | -0.02% |
| 过去三个月      | 1.20%    | 0.07%       | 1.62%      | 0.11%         | -0.42% | -0.04% |
| 过去六个月      | 0.33%    | 0.15%       | 1.35%      | 0.13%         | -1.02% | 0.02%  |
| 过去一年       | 2.92%    | 0.19%       | 6.88%      | 0.14%         | -3.96% | 0.05%  |
| 自基金合同生效起至今 | 3.83%    | 0.14%       | 13.62%     | 0.12%         | -9.79% | 0.02%  |

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：

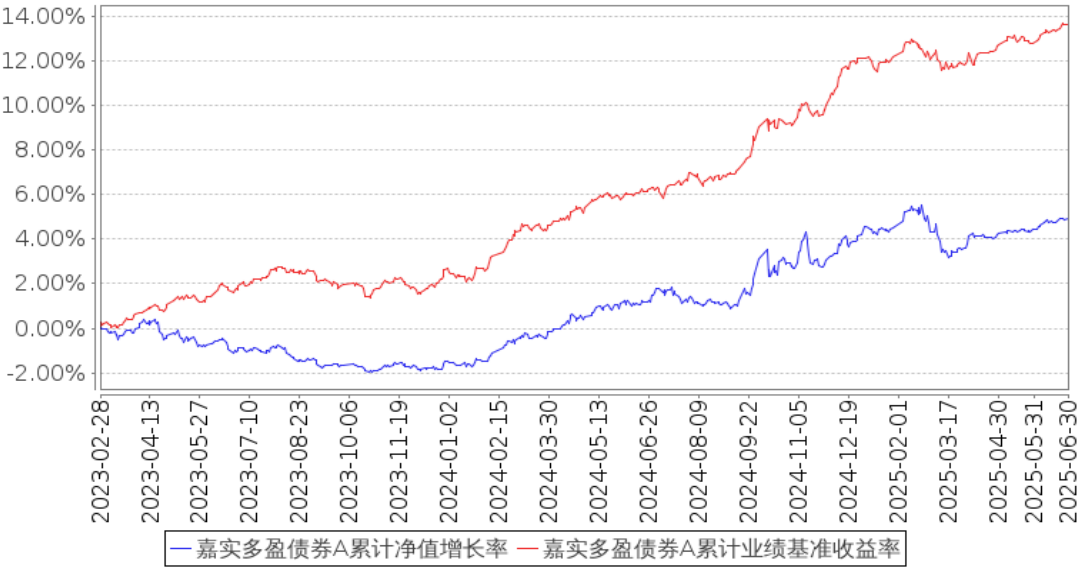
$$\text{Return}(t) = 90\% \times (\text{中债总财富(总值)指数}(t) / \text{中债总财富(总值)指数}(t-1) - 1) + 7\% \times (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 3\% \times (\text{恒生指数(人民币计价)}(t) / \text{恒生指数(人民币计价)}(t-1) - 1)$$

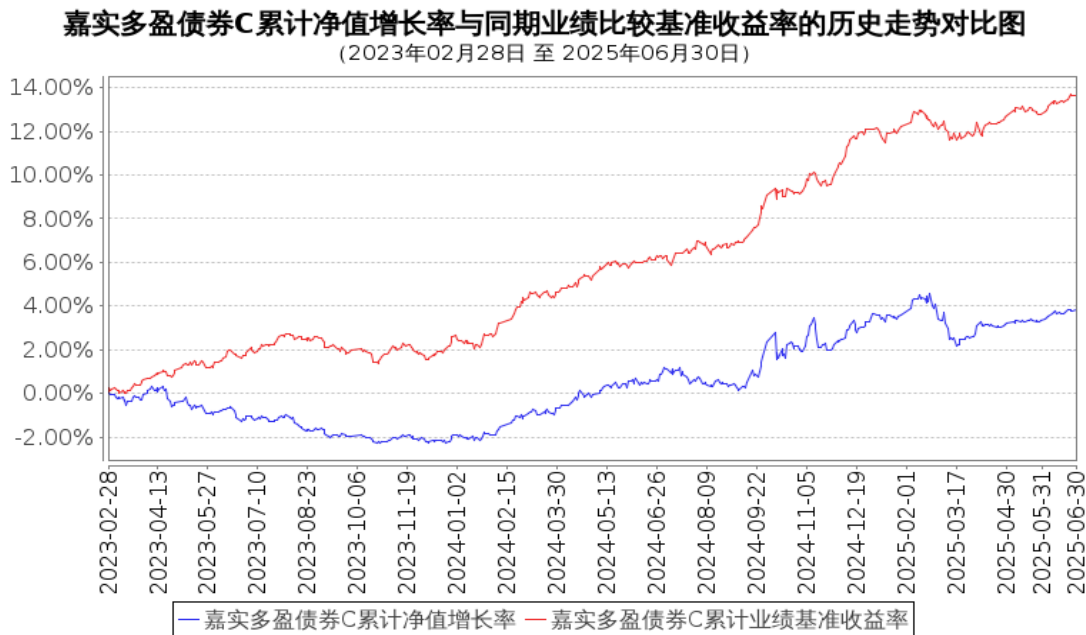
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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2025年06月30日)





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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 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 |        |                                      |
| 赖礼辉 | 本基金、嘉实新起 | 2023 年 2 月 28 日 | -    | 18 年   | 曾任长城证券有限责任公司金融研究所股票行业研究员、瑞银证券有限责任公司财 |

|  |                                                                                  |  |  |  |                                                                         |
|--|----------------------------------------------------------------------------------|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------|
|  | 点混合、嘉实新趋势混合、嘉实安益混合、嘉实稳宏债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实润泽量化定期混合、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 |  |  |  | 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遵规守信情况的说明

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

上半年国内资本市场整体表现较好，股债均有投资机会，尽管期间波动较大。本组合适时调整资产配置，上半年取得了较好的收益。上半年国内经济平稳运行，海外环境变化多端，是波动的主要来源，中央适时调整国内政策，同时外交上取得积极进展，展现了中国国力提升，市场信心好转，风险偏好持续提升，推动资本市场走强。

开年之初美国新任总统上任，引发了市场对不确定性的担忧，股市快速下跌、债市上涨。随后国产大模型 DeepSeek 引起国内外广泛关注，国产电影爆火，权益市场上兴起了科技热潮，春节前后至 3 月中旬，AI 和机器人为主的科技板块一枝独秀。本组合在此期间权益资产保持了相对较高的仓位，结构上价值与成长均衡配置，重点参与了港股科技互联网等成长板块的投资，3 月下旬之后，由于科技板块估值偏高，组合整体降低了权益仓位。

二季度全球冲突加剧，4 月初美国发动对全球的关税战，印度与巴基斯坦军事冲突，以及以色列与伊朗之间的冲突，全球资本市场经历了 risk-off 到 risk-on 的过程。中国在随后的对美反制和谈判中，展现出的大国风范和底线思维，争取到了更多主动权。央行则迅速释放流动性，降准降息，稳定金融市场，股市风险偏好持续回升至今。本组合 4 月大跌初期，权益仓位较低，受影响较小，但我们低估了之后市场风险偏好回升幅度，加仓缓慢。5 月份中美关税谈判开始后，组合陆续加仓了大金融、港股创新药、资源品等板块股票，以及转债中高等级银行转债，6 月份适当加仓 A 股医药、高端制造业板块，总体权益仓位中等水平。

上半年债市波动明显大于去年，年初因央行收紧流动性而调整，关税战后迅速修复，中美谈判开启后债市下跌，之后由于央行降准降息，债市逐步回到低点。整个上半年债券资产的持有收益仍不错，但由于波动大，对交易要求很高。本组合一季度前期为短债+长债的哑铃型结构配置，低杠杆策略，但在 3 月份债市第二波调整中组合久期仍偏长，导致出现一定亏损，为控制回撤，组合及时调整了策略，减持长端利率和利用国债期货套保，久期回归中性。5、6 月份降准降息后组合适当加仓了 3-5 中等期限的高等级信用债，减持了短期限低票息的资产以及超长端利率债。

##### 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 1.0494 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.56%；截至本报告期末嘉实多盈债券 C 基金份额净值为 1.0383 元，本报告期基金份额净值增长

率为 0.33%；业绩比较基准收益率为 1.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计下半年国内资本市场仍可为，波动性可能会弱于上半年，经济基本面数据环比会有所回落，但宽裕的流动性和市场信心修复，预计权益资产的性价比会好于纯债资产。

按上半年总量经济数据来推演，下半年保全年 5%经济增长目标的压力不大，中央出台增量财政政策的必要性不强，更可能是推进“反内卷”等产业政策，继续经济高质量发展。下半年海外环境较上半年也有望对中国更有利，中美关税谈判有望取得积极进展，全球制造业 PMI 正回升，支撑中国对外出口韧性。下半年美联储降息概率较大，国内央行货币政策再放松的条件成熟，金融市场流动性有望维持较宽裕。

下半年重点需要关注的是产能过剩行业“反内卷”推进，对 PPI 的影响，若进展顺利，PPI 有望见底回升，6 月份 PPI 可能是这一轮下行周期的低点，后续 GDP 平减指数向上修复。实际利率回落，可能刺激企业新增投资，后续可以从 M1 数据是否能持续回升来验证，同时对整个金融市场影响深远，债券市场名义利率则难以下行，权益市场上涨的基本面逻辑也更顺畅。当然仅靠供给端的反内卷无法支撑经济周期向上拐点，还需需求端配合，可能来自于资产价格上涨后的私人部门信心修复，以及“十五五”规划落地对总需求的拉动等。

基于上述判断，本组合下半年资产配置将更重视权益资产，纯债控制久期和杠杆。权益结构上会更关注与反内卷相关的周期板块，当前低 PB 向上修复空间将来自于 ROE 回升，可能需要较长时间来验证，同时继续关注与出海相关的医药、与长期自主可控相关的科技成长等。转债资产当前估值略偏高，重点从正股基本面有支撑的个券中挖掘机会。纯债资产下半年将回归到票息策略，长端利率债仅配合国债期货工具进行交易，配置谨慎，组合久期中性。

#### 4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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中期报告中的财务指标、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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 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：嘉实多盈债券型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产   | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：  |         |                        |                          |
| 货币资金  | 6.4.7.1 | 3,382,353.65           | 3,751,250.41             |
| 结算备付金 |         | 2,682,661.96           | 2,578,015.76             |

|               |            |                                |                                  |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金         |            | 351,650.07                     | 250,042.43                       |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 166,389,200.48                 | 269,451,626.12                   |
| 其中：股票投资       |            | 9,375,223.38                   | 23,126,104.73                    |
| 基金投资          |            | —                              | —                                |
| 债券投资          |            | 157,013,977.10                 | 246,325,521.39                   |
| 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         |            | 1,451,442.72                   | 1,493,645.96                     |
| 应收股利          |            | 8,183.35                       | 10,800.00                        |
| 应收申购款         |            | 330.00                         | 3,750.58                         |
| 递延所得税资产       |            | —                              | —                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | —                              | —                                |
| 资产总计          |            | 174,265,822.23                 | 277,539,131.26                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>   |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | —                              | —                                |
| 交易性金融负债       |            | —                              | —                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | —                              | —                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | 23,071,000.00                  | 34,210,255.34                    |
| 应付清算款         |            | 151,622.58                     | 625,072.05                       |
| 应付赎回款         |            | 6,175,853.93                   | 5,888,517.99                     |
| 应付管理人报酬       |            | 75,787.26                      | 122,565.12                       |
| 应付托管费         |            | 12,631.21                      | 20,427.55                        |
| 应付销售服务费       |            | 10,958.30                      | 18,676.46                        |
| 应付投资顾问费       |            | —                              | —                                |
| 应交税费          |            | 2,203.69                       | 11,369.42                        |
| 应付利润          |            | —                              | —                                |
| 递延所得税负债       |            | —                              | —                                |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 93,440.48                      | 223,722.36                       |
| 负债合计          |            | 29,593,497.45                  | 41,120,606.29                    |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 138,135,626.62                 | 226,903,278.19                   |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 6,536,698.16                   | 9,515,246.78                     |
| 净资产合计         |            | 144,672,324.78                 | 236,418,524.97                   |

|          |  |                |                |
|----------|--|----------------|----------------|
| 负债和净资产总计 |  | 174,265,822.23 | 277,539,131.26 |
|----------|--|----------------|----------------|

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，嘉实多盈债券 A 基金份额净值 1.0494 元，基金份额总额 112,027,436.82 份，嘉实多盈债券 C 基金份额净值 1.0383 元，基金份额总额 26,108,189.80 份，基金份额总额合计为 138,135,626.62 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实多盈债券型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|------------------------------------------|-----------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |            | 1,935,738.12                             | 42,110,347.04                                 |
| 1. 利息收入                |            | 18,373.00                                | 227,300.33                                    |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 18,373.00                                | 227,300.33                                    |
| 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             |            | -                                        | -                                             |
| 其他利息收入                 |            | -                                        | -                                             |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 4,655,242.67                             | 14,588,796.40                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | 891,830.53                               | -6,121,890.52                                 |
| 基金投资收益                 |            | -                                        | -                                             |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15   | 4,975,218.91                             | 21,356,754.30                                 |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.16   | -                                        | -                                             |
| 收益                     |            | -                                        | -                                             |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.17   | -                                        | -                                             |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.18   | -1,433,831.39                            | -1,641,255.20                                 |
| 股利收益                   | 6.4.7.19   | 222,024.62                               | 995,187.82                                    |
| 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   | -2,739,051.48                            | 27,294,215.35                                 |
| 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   | 1,173.93                                 | 34.96                                         |
| 减：二、营业总支出              |            | 1,077,447.43                             | 8,817,969.11                                  |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 561,272.23                               | 3,438,357.07                                  |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -                                        | -                                             |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 93,545.31                                | 573,059.54                                    |

|                     |            |            |               |
|---------------------|------------|------------|---------------|
| 3. 销售服务费            | 6.4.10.2.3 | 91,001.17  | 632,581.04    |
| 4. 投资顾问费            |            | -          | -             |
| 5. 利息支出             |            | 217,311.04 | 3,998,672.74  |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | 217,311.04 | 3,998,672.74  |
| 6. 信用减值损失           | 6.4.7.22   | -          | -             |
| 7. 税金及附加            |            | 1,894.41   | 28,587.10     |
| 8. 其他费用             | 6.4.7.23   | 112,423.27 | 146,711.62    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | 858,290.69 | 33,292,377.93 |
| 减：所得税费用             |            | -          | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | 858,290.69 | 33,292,377.93 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |            | -          | -             |
| 六、综合收益总额            |            | 858,290.69 | 33,292,377.93 |

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 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                           | 226,903,278.19                        | -      | 9,515,246.78  | 236,418,524.97  |
| 二、本期期初净资产                           | 226,903,278.19                        | -      | 9,515,246.78  | 236,418,524.97  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -88,767,651.57                        | -      | -2,978,548.62 | -91,746,200.19  |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 858,290.69    | 858,290.69      |
| （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） | -88,767,651.57                        | -      | -3,836,839.31 | -92,604,490.88  |
| 其中：1. 基金申购款                         | 31,969,630.51                         | -      | 1,012,917.13  | 32,982,547.64   |
| 2. 基金赎回款                            | -120,737,282.08                       | -      | -4,849,756.44 | -125,587,038.52 |

|                                          |                                            |        |                |                  |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| （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                                | 138,135,626.62                             | -      | 6,536,698.16   | 144,672,324.78   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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                                | 1,544,714,089.78                           | -      | -24,583,460.87 | 1,520,130,628.91 |
| 二、本期期初净资产                                | 1,544,714,089.78                           | -      | -24,583,460.87 | 1,520,130,628.91 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -893,103,479.41                            | -      | 33,566,234.66  | -859,537,244.75  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | -      | 33,292,377.93  | 33,292,377.93    |
| （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）      | -893,103,479.41                            | -      | 273,856.73     | -892,829,622.68  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 60,555,494.38                              | -      | 532,999.29     | 61,088,493.67    |
| 2. 基金赎回款                                 | -953,658,973.79                            | -      | -259,142.56    | -953,918,116.35  |
| （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                                | 651,610,610.37                             | -      | 8,982,773.79   | 660,593,384.16   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷梁凯李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实多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。

### 6.4.2 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。

### 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

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。

### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 3,382,353.65           |
| 等于：本金          | 3,382,034.54           |
| 加：应计利息         | 319.11                 |
| 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             | 3,382,353.65           |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |      | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |            |               |            |
|---------------|------|------------------------|------------|---------------|------------|
|               |      | 成本                     | 应计利息       | 公允价值          | 公允价值变动     |
| 股票            |      | 8,966,338.20           | -          | 9,375,223.38  | 408,885.18 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |      | -                      | -          | -             | -          |
| 债券            | 交易所市 | 46,190,181.64          | 317,166.21 | 47,457,516.65 | 950,168.80 |

|        |       |                |              |                |              |
|--------|-------|----------------|--------------|----------------|--------------|
|        | 场     |                |              |                |              |
|        | 银行间市场 | 107,201,162.52 | 1,181,060.45 | 109,556,460.45 | 1,174,237.48 |
|        | 合计    | 153,391,344.16 | 1,498,226.66 | 157,013,977.10 | 2,124,406.28 |
| 资产支持证券 |       | -              | -            | -              | -            |
| 基金     |       | -              | -            | -              | -            |
| 其他     |       | -              | -            | -              | -            |
| 合计     |       | 162,357,682.36 | 1,498,226.66 | 166,389,200.48 | 2,533,291.46 |

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

单位：人民币元

| 项目        | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |      |    |    |
|-----------|------------------------|------|----|----|
|           | 合同/名义<br>金额            | 公允价值 |    | 备注 |
|           |                        | 资产   | 负债 |    |
| 利率衍生工具    | -9,620,300.00          | -    | -  | -  |
| 其中：国债期货投资 | -9,620,300.00          | -    | -  | -  |
| 货币衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 权益衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 其他衍生工具    | -                      | -    | -  | -  |
| 合计        | -9,620,300.00          | -    | -  | -  |

6.4.7.3.2 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     |
|------------|--------|----------|---------------|------------|
| TL2509     | TL2509 | -5.00    | -6,020,000.00 | 24,000.00  |
| TL2512     | TL2512 | -3.00    | -3,607,800.00 | -31,500.00 |
| 合计         |        |          |               | -7,500.00  |
| 减：可抵销期货暂收款 |        |          |               | -7,500.00  |
| 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。

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<br>2025 年 6 月 30 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    | 9,137.92  |
| 其中：交易所市场  | 6,130.88  |
| 银行间市场     | 3,007.04  |
| 应付利息      | -         |
| 预提费用      | 84,302.56 |
| 合计        | 93,440.48 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实多盈债券 A

| 项目            | 本期                              |                |
|---------------|---------------------------------|----------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额           |
| 上年度末          | 183,831,830.54                  | 183,831,830.54 |
| 本期申购          | 2,685,331.42                    | 2,685,331.42   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -74,489,725.14                  | -74,489,725.14 |
| 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           | 112,027,436.82                  | 112,027,436.82 |

嘉实多盈债券 C

| 项目            | 本期                              |                |
|---------------|---------------------------------|----------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |                |
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额           |
| 上年度末          | 43,071,447.65                   | 43,071,447.65  |
| 本期申购          | 29,284,299.09                   | 29,284,299.09  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -46,247,556.94                  | -46,247,556.94 |
| 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           | 26,108,189.80                   | 26,108,189.80  |

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 | 10,371,448.59 | -2,359,062.88 | 8,012,385.71 |

|                |               |               |               |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | 10,371,448.59 | -2,359,062.88 | 8,012,385.71  |
| 本期利润           | 2,903,301.40  | -2,133,858.41 | 769,442.99    |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -4,707,538.52 | 1,463,347.68  | -3,244,190.84 |
| 其中：基金申购款       | 167,426.98    | -35,313.28    | 132,113.70    |
| 基金赎回款          | -4,874,965.50 | 1,498,660.96  | -3,376,304.54 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 8,567,211.47  | -3,029,573.61 | 5,537,637.86  |

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           | 2,044,153.97  | -541,292.90  | 1,502,861.07  |
| 本期期初           | 2,044,153.97  | -541,292.90  | 1,502,861.07  |
| 本期利润           | 694,040.77    | -605,193.07  | 88,847.70     |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,042,472.78 | 449,824.31   | -592,648.47   |
| 其中：基金申购款       | 1,667,899.77  | -787,096.34  | 880,803.43    |
| 基金赎回款          | -2,710,372.55 | 1,236,920.65 | -1,473,451.90 |
| 本期已分配利润        | -             | -            | -             |
| 本期末            | 1,695,721.96  | -696,661.66  | 999,060.30    |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 9,385.75                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 7,767.79                              |
| 其他        | 1,219.46                              |
| 合计        | 18,373.00                             |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------|----------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 891,830.53                 |
| 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               | 891,830.53                 |

## 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 33,986,989.22                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 33,041,232.81                         |
| 减：交易费用     | 53,925.88                             |
| 买卖股票差价收入   | 891,830.53                            |

## 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 2,473,178.27               |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 2,502,040.64               |
| 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                           | 4,975,218.91               |

## 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 163,792,197.28             |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 159,422,606.43             |
| 减：应计利息总额               | 1,863,627.73               |
| 减：交易费用                 | 3,922.48                   |
| 买卖债券差价收入               | 2,502,040.64               |

## 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

单位：人民币元

| 项目       | 本期                              |
|----------|---------------------------------|
|          | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 国债期货投资收益 | -1,433,831.39                   |

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 222,024.62                      |
| 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 | 222,024.62 |
|----|------------|

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | -2,833,108.62                         |
| 股票投资                   | -424,380.69                           |
| 债券投资                   | -2,408,727.93                         |
| 资产支持证券投资               | -                                     |
| 基金投资                   | -                                     |
| 贵金属投资                  | -                                     |
| 其他                     | -                                     |
| 2. 衍生工具                | 94,057.14                             |
| 权证投资                   | -                                     |
| 期货投资                   | 94,057.14                             |
| 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                     | -2,739,051.48                         |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 1,149.51                              |
| 基金转出费收入 | 24.42                                 |
| 合计      | 1,173.93                              |

#### 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用      | 24,795.19                             |
| 信息披露费     | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金   | -                                     |
| 银行划款手续费   | 9,413.86                              |
| 债券托管账户维护费 | 18,000.00                             |
| 其他        | 600.00                                |
| 深港通证券组合费  | 106.85                                |
| 合计        | 112,423.27                            |

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   |
| 中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”） | 基金托管人   |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 561,272.23                            | 3,438,357.07                               |

|                  |            |              |
|------------------|------------|--------------|
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 254,531.90 | 1,673,772.29 |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 306,740.33 | 1,764,584.78 |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|--------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 93,545.31                             | 573,059.54                                 |

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。

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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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     | -                                          | 646.80     | 646.80     |
| 中国农业银行         | -                                          | 35,767.87  | 35,767.87  |
| 合计             | -                                          | 36,414.67  | 36,414.67  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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     | -                                          | 32.57      | 32.57      |
| 中国农业银行         | -                                          | 390,492.66 | 390,492.66 |
| 合计             | -                                          | 390,525.23 | 390,525.23 |

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称           | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |          | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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    |
| 中国农业银行股份有限公司_活期 | 3,382,353.65                          | 9,385.75 | 1,017,940.40                               | 14,090.29 |

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2025 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 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 23,071,000.00 元，于 2025 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1    | -                      | -                        |
| A-1 以下 | -                      | -                        |
| 未评级    | 7,030,851.78           | 2,510,944.52             |
| 合计     | 7,030,851.78           | 2,510,944.52             |

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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA    | 88,310,180.56          | 134,163,054.90           |
| AAA 以下 | 11,721,064.69          | 31,226,268.62            |
| 未评级    | 49,951,880.07          | 78,425,253.35            |
| 合计     | 149,983,125.32         | 243,814,576.87           |

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。

#### 6.4.13.3.1 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 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<br>2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内         | 1-5 年         | 5 年以上         | 不计息           | 合计             |
|------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|
| 资产                     |               |               |               |               |                |
| 货币资金                   | 3,382,353.65  | -             | -             | -             | 3,382,353.65   |
| 结算备付金                  | 2,682,661.96  | -             | -             | -             | 2,682,661.96   |
| 存出保证金                  | 14,677.07     | -             | -             | 336,973.00    | 351,650.07     |
| 交易性金融资产                | 19,268,387.58 | 95,964,604.38 | 41,780,985.14 | 9,375,223.38  | 166,389,200.48 |
| 衍生金融资产                 | -             | -             | -             | -             | -              |
| 买入返售金融资产               | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应收清算款                  | -             | -             | -             | 1,451,442.72  | 1,451,442.72   |
| 债权投资                   | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应收股利                   | -             | -             | -             | 8,183.35      | 8,183.35       |
| 应收申购款                  | -             | -             | -             | 330.00        | 330.00         |
| 递延所得税资产                | -             | -             | -             | -             | -              |
| 其他资产                   | -             | -             | -             | -             | -              |
| 资产总计                   | 25,348,080.26 | 95,964,604.38 | 41,780,985.14 | 11,172,152.45 | 174,265,822.23 |
| 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              | 23,071,000.00 | -             | -             | -             | 23,071,000.00  |
| 应付清算款                  | -             | -             | -             | 151,622.58    | 151,622.58     |
| 应付赎回款                  | -             | -             | -             | 6,175,853.93  | 6,175,853.93   |
| 应付管理人报酬                | -             | -             | -             | 75,787.26     | 75,787.26      |
| 应付托管费                  | -             | -             | -             | 12,631.21     | 12,631.21      |
| 应付销售服务费                | -             | -             | -             | 10,958.30     | 10,958.30      |
| 应付投资顾问费                | -             | -             | -             | -             | -              |
| 应交税费                   | -             | -             | -             | 2,203.69      | 2,203.69       |
| 应付利润                   | -             | -             | -             | -             | -              |
| 递延所得税负债                | -             | -             | -             | -             | -              |
| 其他负债                   | -             | -             | -             | 93,440.48     | 93,440.48      |
| 负债总计                   | 23,071,000.00 | -             | -             | 6,522,497.45  | 29,593,497.45  |
| 利率敏感度缺口                | 2,277,080.26  | 95,964,604.38 | 41,780,985.14 | 4,649,655.00  | 144,672,324.78 |

| 上年度末<br>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 |

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 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |

|  |               |                  |                  |
|--|---------------|------------------|------------------|
|  | 市场利率上升 25 个基点 | -1, 608, 462. 94 | -4, 150, 536. 76 |
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 1, 655, 354. 64  | 4, 356, 528. 66  |

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。

6. 4. 13. 4. 2. 1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                 |               |                 |
|----------|------------------------|-----------------|---------------|-----------------|
|          | 美元<br>折合人民币            | 港币<br>折合人民币     | 其他币种<br>折合人民币 | 合计              |
| 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  | -                      | 2, 574, 599. 02 | -             | 2, 574, 599. 02 |
| 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     | -                      | 2, 574, 599. 02 | -             | 2, 574, 599. 02 |
| 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 | -                        | 2,574,599.02 | -             | 2,574,599.02 |
| 项目            | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |              |               |              |
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币  | 其他币种<br>折合人民币 | 合计           |
| 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 |

6. 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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 所有外币相对人民币升值 5%   | 128, 729. 95                | 225, 956. 77           |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -128, 729. 95               | -225, 956. 77          |

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<br>2025 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2024年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 9,375,223.38           | 6.48             | 23,126,104.73       | 9.78             |
| 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            | 9,375,223.38           | 6.48             | 23,126,104.73       | 9.78             |

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 |                             |                        |
|----|--------------------|-----------------------------|------------------------|
| 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（2025 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2024 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%        | 5,868,987.32                | 10,435,441.13          |
|    | 业绩比较基准下降 5%        | -5,868,987.32               | -10,435,441.13         |

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<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 18,670,045.87          | 24,376,119.80            |
| 第二层次          | 147,719,154.61         | 245,075,506.32           |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 166,389,200.48         | 269,451,626.12           |

6.4.14.2.2 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。

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

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。

6.4.15 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。

§ 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   | 9,375,223.38   | 5.38          |
|    | 其中：股票  | 9,375,223.38   | 5.38          |
| 2  | 基金投资   | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资 | 157,013,977.10 | 90.10         |
|    | 其中：债券  | 157,013,977.10 | 90.10         |
|    | 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      | 6,065,015.61   | 3.48   |
| 8 | 其他各项资产            | 1,811,606.14   | 1.04   |
| 9 | 合计                | 174,265,822.23 | 100.00 |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 2,574,599.02 元，占基金资产净值的比例为 1.78%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | 1,251,471.00 | 0.87         |
| C  | 制造业              | 658,631.36   | 0.46         |
| 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      | -            | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -            | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 308,554.00   | 0.21         |
| J  | 金融业              | 3,214,116.00 | 2.22         |
| 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       | 1,144,298.00 | 0.79         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 223,554.00   | 0.15         |
| 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               | 6,800,624.36 | 4.70         |

### 7.2.2 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   | 336,427.48 | 0.23         |
| 非必需消费品 | 558,952.40 | 0.39         |
| 必需消费品  | -          | -            |

|      |              |      |
|------|--------------|------|
| 能源   | 36,933.98    | 0.03 |
| 金融   | 147,480.55   | 0.10 |
| 医疗保健 | 1,157,975.88 | 0.80 |
| 工业   | -            | -    |
| 信息技术 | 336,828.73   | 0.23 |
| 原材料  | -            | -    |
| 房地产  | -            | -    |
| 公用事业 | -            | -    |
| 合计   | 2,574,599.02 | 1.78 |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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  | 601229 | 上海银行   | 140,100 | 1,486,461.00 | 1.03         |
| 2  | 300347 | 泰格医药   | 15,800  | 842,456.00   | 0.58         |
| 3  | 603993 | 洛阳钼业   | 93,700  | 788,954.00   | 0.55         |
| 4  | 600000 | 浦发银行   | 56,800  | 788,384.00   | 0.54         |
| 5  | 03759  | 康龙化成   | 30,000  | 453,603.93   | 0.31         |
| 5  | 300759 | 康龙化成   | 12,300  | 301,842.00   | 0.21         |
| 6  | 601939 | 建设银行   | 71,600  | 675,904.00   | 0.47         |
| 7  | 00013  | 和黄医药   | 30,000  | 644,292.68   | 0.45         |
| 8  | 601728 | 中国电信   | 39,400  | 305,350.00   | 0.21         |
| 8  | 00728  | 中国电信   | 38,000  | 193,369.88   | 0.13         |
| 9  | 09988  | 阿里巴巴-W | 4,900   | 490,647.34   | 0.34         |
| 10 | 01347  | 华虹半导体  | 10,000  | 316,446.65   | 0.22         |
| 11 | 01398  | 工商银行   | 26,000  | 147,480.55   | 0.10         |
| 11 | 601398 | 工商银行   | 18,700  | 141,933.00   | 0.10         |
| 12 | 601857 | 中国石油   | 25,100  | 214,605.00   | 0.15         |
| 12 | 00857  | 中国石油股份 | 6,000   | 36,933.98    | 0.03         |
| 13 | 601088 | 中国神华   | 5,600   | 227,024.00   | 0.16         |
| 14 | 000888 | 峨眉山 A  | 15,900  | 223,554.00   | 0.15         |
| 15 | 688722 | 同益中    | 6,823   | 145,125.21   | 0.10         |
| 16 | 00700  | 腾讯控股   | 300     | 137,613.26   | 0.10         |
| 17 | 000932 | 华菱钢铁   | 30,000  | 132,000.00   | 0.09         |
| 18 | 601658 | 邮储银行   | 22,200  | 121,434.00   | 0.08         |
| 19 | 688127 | 蓝特光学   | 3,975   | 102,197.25   | 0.07         |
| 20 | 600480 | 凌云股份   | 7,670   | 93,343.90    | 0.06         |
| 21 | 600761 | 安徽合力   | 4,600   | 81,604.00    | 0.06         |
| 22 | 02015  | 理想汽车-W | 700     | 68,305.06    | 0.05         |
| 23 | 09688  | 再鼎医药   | 2,400   | 60,079.27    | 0.04         |
| 24 | 600019 | 宝钢股份   | 8,400   | 55,356.00    | 0.04         |
| 25 | 603596 | 伯特利    | 700     | 36,883.00    | 0.03         |

|    |        |      |     |           |      |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 26 | 600938 | 中国海油 | 800 | 20,888.00 | 0.01 |
| 27 | 00981  | 中芯国际 | 500 | 20,382.08 | 0.01 |
| 28 | 300567 | 精测电子 | 200 | 12,122.00 | 0.01 |
| 29 | 00772  | 阅文集团 | 200 | 5,444.34  | 0.00 |
| 30 | 600050 | 中国联通 | 600 | 3,204.00  | 0.00 |

#### 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  | 00013  | 和黄医药   | 1,513,172.84 | 0.64           |
| 2  | 601229 | 上海银行   | 1,511,801.00 | 0.64           |
| 3  | 000988 | 华工科技   | 1,463,790.00 | 0.62           |
| 4  | 600941 | 中国移动   | 1,113,168.00 | 0.47           |
| 5  | 300567 | 精测电子   | 1,082,774.00 | 0.46           |
| 6  | 002475 | 立讯精密   | 1,051,878.00 | 0.44           |
| 7  | 02015  | 理想汽车-W | 1,019,381.59 | 0.43           |
| 8  | 600761 | 安徽合力   | 984,871.00   | 0.42           |
| 9  | 000063 | 中兴通讯   | 868,697.00   | 0.37           |
| 10 | 300347 | 泰格医药   | 783,717.00   | 0.33           |
| 11 | 600000 | 浦发银行   | 755,556.00   | 0.32           |
| 12 | 603993 | 洛阳钼业   | 755,112.00   | 0.32           |
| 13 | 603214 | 爱婴室    | 748,884.00   | 0.32           |
| 14 | 03759  | 康龙化成   | 440,668.79   | 0.19           |
| 14 | 300759 | 康龙化成   | 306,325.00   | 0.13           |
| 15 | 06186  | 中国飞鹤   | 693,539.82   | 0.29           |
| 16 | 603019 | 中科曙光   | 634,418.00   | 0.27           |
| 17 | 600398 | 海澜之家   | 633,661.00   | 0.27           |
| 18 | 002371 | 北方华创   | 605,741.00   | 0.26           |
| 19 | 09988  | 阿里巴巴-W | 513,719.44   | 0.22           |
| 20 | 688127 | 蓝特光学   | 407,833.96   | 0.17           |

##### 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  | 00981  | 中芯国际 | 2,557,840.25 | 1.08           |
| 2  | 600941 | 中国移动 | 2,396,251.00 | 1.01           |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 2,379,722.60 | 1.01           |
| 4  | 000988 | 华工科技 | 1,413,983.00 | 0.60           |
| 5  | 600050 | 中国联通 | 1,391,701.00 | 0.59           |
| 6  | 601939 | 建设银行 | 1,297,529.00 | 0.55           |
| 7  | 300567 | 精测电子 | 1,138,765.00 | 0.48           |

|    |        |        |              |      |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 8  | 002371 | 北方华创   | 1,106,076.00 | 0.47 |
| 9  | 00700  | 腾讯控股   | 1,097,214.94 | 0.46 |
| 10 | 600028 | 中国石化   | 1,081,928.00 | 0.46 |
| 11 | 02015  | 理想汽车-W | 1,045,111.13 | 0.44 |
| 12 | 601728 | 中国电信   | 993,266.00   | 0.42 |
| 13 | 601658 | 邮储银行   | 972,267.00   | 0.41 |
| 14 | 002475 | 立讯精密   | 971,259.00   | 0.41 |
| 15 | 601857 | 中国石油   | 954,132.00   | 0.40 |
| 16 | 09988  | 阿里巴巴-W | 911,789.66   | 0.39 |
| 17 | 00013  | 和黄医药   | 901,344.95   | 0.38 |
| 18 | 603596 | 伯特利    | 894,793.00   | 0.38 |
| 19 | 688361 | 中科飞测   | 875,368.06   | 0.37 |
| 20 | 600761 | 安徽合力   | 817,257.00   | 0.35 |

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 | 19,714,732.15 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 33,986,989.22 |

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      | 38,423,533.58  | 26.56        |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 71,407,111.22  | 49.36        |
|    | 其中：政策性金融债 | 10,120,054.79  | 7.00         |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 26,223,977.81  | 18.13        |
| 7  | 可转债（可交换债） | 9,294,822.49   | 6.42         |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | 11,664,532.00  | 8.06         |
| 10 | 合计        | 157,013,977.10 | 108.53       |

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  | 240004    | 24 付息国债 04     | 100,000 | 10,608,795.58 | 7.33         |
| 2  | 102382262 | 23 吉林高速 MTN003 | 100,000 | 10,493,889.86 | 7.25         |
| 3  | 102103232 | 21 拉萨城投        | 100,000 | 10,483,078.36 | 7.25         |

|   |         |              |         |               |      |
|---|---------|--------------|---------|---------------|------|
|   |         | MTN001       |         |               |      |
| 4 | 2028042 | 20 兴业银行永续债   | 100,000 | 10,421,508.49 | 7.20 |
| 5 | 2028049 | 20 工商银行二级 02 | 100,000 | 10,348,476.71 | 7.15 |

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

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。

7.10.2 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。

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，兴业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国进出口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 | 351,650.07   |
| 2  | 应收清算款 | 1,451,442.72 |
| 3  | 应收股利  | 8,183.35     |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 330.00       |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |

|   |    |              |
|---|----|--------------|
| 8 | 其他 | -            |
| 9 | 合计 | 1,811,606.14 |

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  | 113042 | 上银转债 | 2,681,582.05 | 1.85         |
| 2  | 113052 | 兴业转债 | 2,489,830.14 | 1.72         |
| 3  | 128129 | 青农转债 | 1,757,956.85 | 1.22         |
| 4  | 110059 | 浦发转债 | 1,127,467.12 | 0.78         |

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<br>户数<br>（户） | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>（%） | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>（%） |
| 嘉实多盈<br>债券 A | 1,600            | 70,017.15     | 18,117,828.56 | 16.17             | 93,909,608.26  | 83.83             |
| 嘉实多盈<br>债券 C | 3,475            | 7,513.15      | 1,260.54      | 0.00              | 26,106,929.26  | 100.00            |
| 合计           | 4,872            | 28,352.96     | 18,119,089.10 | 13.12             | 120,016,537.52 | 86.88             |

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）。

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<br>理人所有从业<br>人员持有本基 | 嘉实多盈债券 A | 172,612.13 | 0.15        |
|                         | 嘉实多盈债券 C | 120.06     | 0.00        |

|   |    |            |      |
|---|----|------------|------|
| 金 |    |            |      |
|   | 合计 | 172,732.19 | 0.13 |

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 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<br>（2023 年 2 月 28 日）<br>基金份额总额 | 2,590,418,827.14 | 767,698,232.41 |
| 本报告期期初基金份<br>额总额                       | 183,831,830.54   | 43,071,447.65  |
| 本报告期基金总申购<br>份额                        | 2,685,331.42     | 29,284,299.09  |
| 减：本报告期基金总<br>赎回份额                      | 74,489,725.14    | 46,247,556.94  |
| 本报告期基金拆分变<br>动份额                       | -                | -              |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                       | 112,027,436.82   | 26,108,189.80  |

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 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                              |
| 2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任 |

公司副总经理、首席信息官。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本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，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|              |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 中信证券股份有限公司   | 4      | 21,503,417.04 | 40.04            | 10,142.63 | 41.95          | —  |
| 开源证券股份有限公司   | 1      | 19,780,804.37 | 36.83            | 8,621.84  | 35.66          | —  |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 4      | 4,316,480.00  | 8.04             | 1,881.72  | 7.78           | —  |
| 广发证券         | 2      | 4,119,739.51  | 7.67             | 1,796.05  | 7.43           | —  |

|                      |   |              |      |          |      |   |
|----------------------|---|--------------|------|----------|------|---|
| 股份有限公司               |   |              |      |          |      |   |
| 国盛证券<br>有限责任公司       | 1 | 3,065,617.00 | 5.71 | 1,336.17 | 5.53 | - |
| 长江证券<br>股份有限公司       | 2 | 642,091.00   | 1.20 | 279.87   | 1.16 | - |
| 华泰证券<br>股份有限公司       | 1 | 273,572.45   | 0.51 | 119.16   | 0.49 | - |
| 长城证券<br>股份有限公司       | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 东方财富<br>证券股份<br>有限公司 | 2 | -            | -    | -        | -    | - |
| 方正证券<br>股份有限<br>公司   | 2 | -            | -    | -        | -    | - |
| 光大证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 国金证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 国信证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 国元证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 上海证券<br>有限责任<br>公司   | 2 | -            | -    | -        | -    | - |
| 申万宏源<br>证券有限<br>公司   | 2 | -            | -    | -        | -    | - |
| 世纪证券<br>有限责任<br>公司   | 1 | -            | -    | -        | -    | - |
| 中国银河<br>证券股份<br>有限公司 | 2 | -            | -    | -        | -    | - |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投<br>证券股份<br>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. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易          |                 | 债券回购交易           |                   | 权证交易 |                 |
|--------------|---------------|-----------------|------------------|-------------------|------|-----------------|
|              | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 中信证券股份有限公司   | 7,934,219.66  | 10.90           | 75,571,000.00    | 4.43              | -    | -               |
| 开源证券股份有限公司   | 49,513,961.49 | 68.00           | 1,185,000,000.00 | 69.48             | -    | -               |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 12,030,088.35 | 16.52           | -                | -                 | -    | -               |
| 广发证券股份有限公司   | 996,370.00    | 1.37            | 189,800,000.00   | 11.13             | -    | -               |

|                          |                  |      |                    |      |   |   |
|--------------------------|------------------|------|--------------------|------|---|---|
| 国盛证<br>券有限<br>责任公<br>司   | 1,233,320.7<br>2 | 1.69 | 150,200,000.<br>00 | 8.81 | - | - |
| 长江证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 华泰证<br>券股份<br>有限公<br>司   | 1,104,527.2<br>2 | 1.52 | 105,000,000.<br>00 | 6.16 | - | - |
| 长城证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 东方财<br>富证券<br>股份有<br>限公司 | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 方正证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 光大证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国金证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国信证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 国元证<br>券股份<br>有限公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |
| 上海证<br>券有限<br>责任公<br>司   | -                | -    | -                  | -    | - | - |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 申万宏源证券有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 世纪证券有限责任公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                 | 法定披露方式                     | 法定披露日期          |
|----|----------------------|----------------------------|-----------------|
| 1  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告 | 证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 5 月 22 日 |

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

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

2025 年 8 月 29 日