

# 嘉实同舟债券型证券投资基金

## 2023 年第 4 季度报告

2023 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 嘉实同舟债券   |
| 基金主代码      | 018562   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式   |
| 基金合同生效日    | 2023 年 7 月 24 日  |
| 报告期末基金份额总额 | 860,372,244.05 份   |
| 投资目标       | 本基金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，力争实现基金资产的长期稳健增值。   |
| 投资策略       | <p>资产配置策略：本基金将根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、政策面、资金面等多种因素综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，在控制风险的前提下，确定组合中股票、债券、基金、货币市场工具及其他金融工具的比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。</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，并在此基础之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：本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选信用违约风险小的可转换债券/可交换债券进行投资。本基</p> |

|                 |  |                  |
|-----------------|--|------------------|
|                 | <p>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分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种。</p> <p>基金投资策略：按管理模式分类，主要包括主动管理型基金和被动管理型基金两大类。主动管理型基金筛选流程包括初选和精选两个阶段，本基金首先根据基金历史业绩、基金风险调整后的收益（信息比率、Sharpe 比率）、基金的规模和流动性等一系列量化指标对基金进行初步筛选并确定适选基金。之后通过对适选基金的定性及定量分析再次精选基金，力求寻找到投资风格稳定、业绩持续优秀并具有良好的风险管理能力的投资品种。对于指数基金及指数增强基金等被动管理的产品，本基金将根据基金的指数标的、基金的规模和流动性、跟踪误差等量化指标筛选，并结合本基金的投资目标及基金投资策略进行投资，作为基金投资策略的有效补充。</p> <p>衍生品投资策略：本基金的衍生品投资将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用国债期货、信用衍生品等衍生工具，将根据风险管理的原则，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。</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。  |                  |
| 基金管理人           | 嘉实基金管理有限公司   |                  |
| 基金托管人           | 中国民生银行股份有限公司   |                  |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉实同舟债券 A   | 嘉实同舟债券 C         |
| 下属分级基金的交易代码     | 018562   | 018563           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 651,263,291.00 份   | 209,108,953.05 份 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

|        |                                       |          |
|--------|---------------------------------------|----------|
| 主要财务指标 | 报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日） |          |
|        | 嘉实同舟债券 A                              | 嘉实同舟债券 C |

|                 |                |                |
|-----------------|----------------|----------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1,535,902.62   | 218,876.04     |
| 2. 本期利润         | 1,935,718.02   | 292,049.25     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0021         | 0.0009         |
| 4. 期末基金资产净值     | 654,981,183.42 | 209,931,061.24 |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0057         | 1.0039         |

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实同舟债券 A

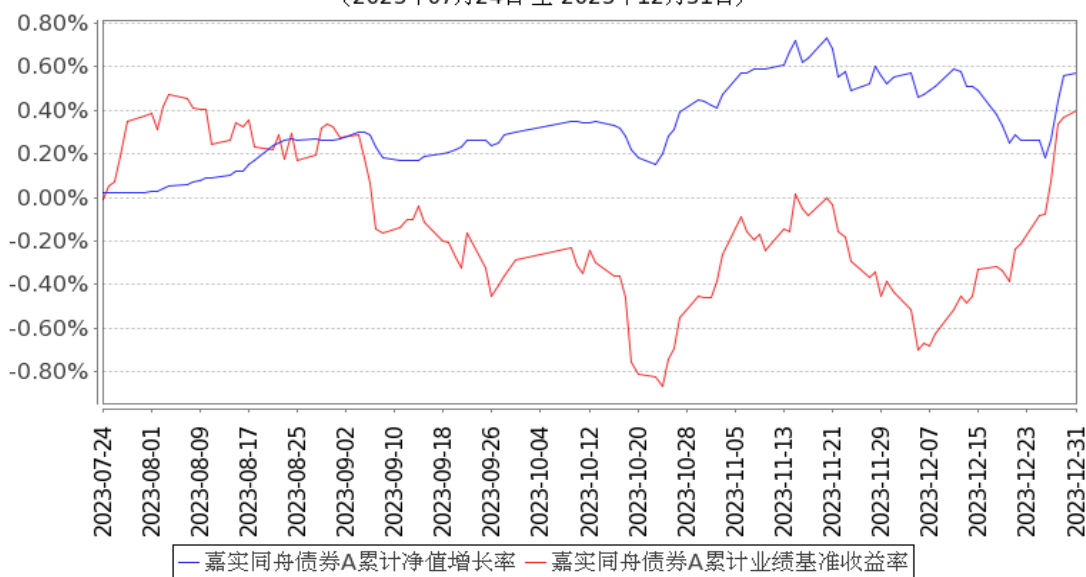
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.27%  | 0.06%     | 0.69%      | 0.10%         | -0.42% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.57%  | 0.05%     | 0.40%      | 0.09%         | 0.17%  | -0.04% |

嘉实同舟债券 C

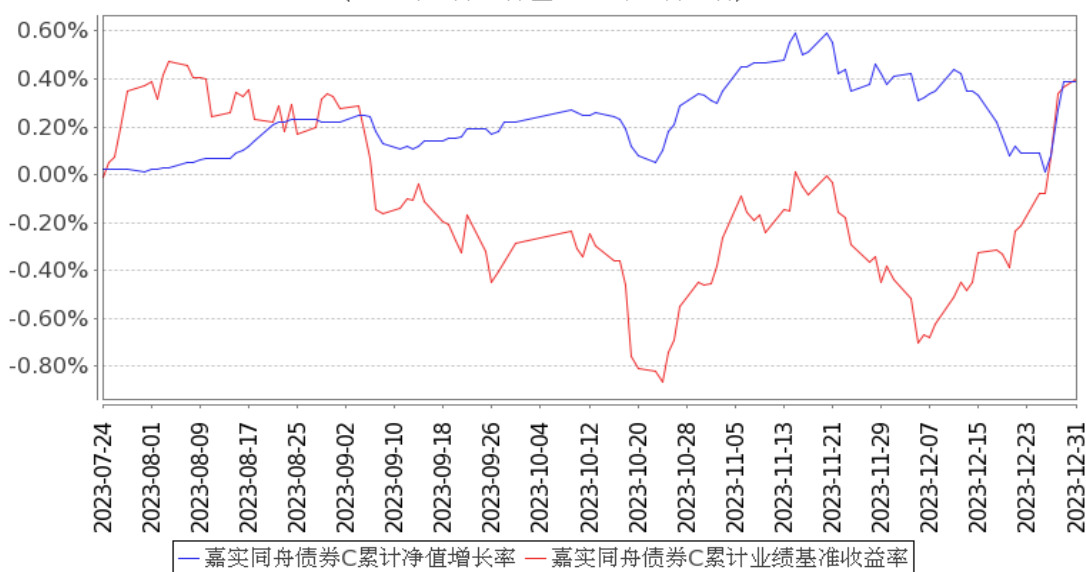
| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 0.17%  | 0.06%     | 0.69%      | 0.10%         | -0.52% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 0.39%  | 0.05%     | 0.40%      | 0.09%         | -0.01% | -0.04% |

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

**嘉实同舟债券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07月24日至2023年12月31日)



**嘉实同舟债券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07月24日至2023年12月31日)



注：(1) 本基金合同生效日 2023 年 07 月 24 日至报告期末未满 1 年。

(2) 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 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

### 3.3 其他指标

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | 证券从业 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

|     |  | 任职日期            | 离任日期 | 年限   |  |
|-----|--|-----------------|------|------|--|
| 顾晶菁 | 本基金、嘉实新添益定期混合、嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起、嘉实方舟一年持有期混合基金经理  | 2023 年 7 月 24 日 | -    | 13 年 | 曾任美国贝莱德集团资产配置基金经理、美国威灵顿管理公司股票投资部研究员、基金经理。2020 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，从事量化研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。                    |
| 张庆平 | 本基金、嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起、嘉实方舟一年持有期混合基金经理  | 2023 年 7 月 24 日 | -    | 13 年 | 曾任景顺长城基金管理有限公司渠道销售助理、北京佑瑞持投资管理有限公司债券投资经理、中国人寿养老保险股份有限公司高级投资经理。2020 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司任债券投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
| 轩璇  | 本基金、嘉实债券、嘉实纯债债券、嘉实增强信用定期债券、嘉实丰益策略定期债券、嘉实致融一年定期债券、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实 | 2023 年 7 月 25 日 | -    | 11 年 | 曾任易方达基金管理有限公司固定收益部高级研究员、基金经理助理。2019 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固收投研体系基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。                          |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
| 方舟 6 个月滚动持有债券发起、嘉实年年红一年持有债券发起式、嘉实致泰一年定开纯债债券发起式、嘉实方舟一年持有期混合基金经理 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|

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、《嘉实同舟债券型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 5 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略

不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度，经济发展波浪式前进，经济核心指标持续修复。从统计局公布的最新经济数据来看，经济处于波动复苏阶段。供给侧复苏较为平稳、结构性亮点突出，需求侧略有起伏。具体来看，工业生产持续复苏，1-10 月规模以上工业增加值同比增长小幅加快，装备制造业生产增速持续回升；工业企业利润持续修复，在营收、利润率两方面均有所改善，累计跌幅连续第八个月收窄。需求端：消费方面，社消零售总额增速持续上涨，商品消费、服务消费双提速；投资方面，全国固定资产投资增速延续放缓，但民间投资跌幅有所收窄；进出口方面，跌幅同比小幅扩大，进口增速转正，贸易顺差缩小，结构上也体现出高质量发展的特征。此外，从价格因素来看，PPI 同比降幅较为稳定，10 月 PPI 累计同比-3.1%，与 1-9 月持平。随着国内经济波浪式复苏的逐步推进，需求的逐步恢复也定会是价格回复的良剂。我们预计后续经济将延续恢复向好的态势，PPI 同比增速有望继续回升。

利好政策陆续出台。为巩固经济持续恢复向好趋势，11 月份利好政策仍在持续出台。货币政策方面，三季度货币政策报告落实中央金融工作会议基调，坚持稳健的货币政策取向，未来支撑经济稳健发展力度有望增强。财政政策方面，积极的财政政策进一步发力提效的同时，继续做好防范化解地方债务风险的工作。地产政策方面，相关刺激政策持续出台，金融支持房地产力度不断加大，多家金融机构召开房企座谈会，多地出台多举措楼市新政。12 月中央经济工作会议部署明年工作，政策定调更加积极且提前落地概率加大，有助于稳定预期和助力中长期经济继续企稳向好。

上市公司盈利增速转正。在宏观经济恢复向好的同时，上市公司三季度利润增速也成功实现了由负转正，业绩底逐步得到确认。从净利润增速来看，受 2022 年三季度的低基数影响，2023 年三季度 A 股上市公司单季净利润同比增速有明显改善，整体利润增速实现由负转正。2023 年三季度 A 股上市公司单季净利润增速为 2.2%（2023Q2 单季净利润增速为-7.8%）。从盈利能力来看，2023 年三季度全部 A 股非金融两油上市公司 ROE（TTM）较二季度持平。

股票方面，受制于微观资金格局和参与者对政策落地的节奏的担心，指数重回底部震荡。四季度 A 股三大股指皆回落，上证指数、深证成指、创业板指分别-4.4%、-3.8%、-5.6%。四季度北上资金净流出，同时国内公募基金等机构资金面的负反馈仍在持续，受外资和公募基金青睐较多的基金重仓股面临较严重的流动性缺失问题，在流动性分化加剧后，小市值股票流动性边际转好，进一步强化了今年以来中小市值股票跑赢大市值股票的趋势。

债券方面，10 月下旬至今，汇率压力暂缓但政府债券供给扰动仍在，叠加财政投放偏慢，



市场对资金面稳定性担忧延续，年末政策托底预期再起，制约债市表现，利率转向震荡。进入 12 月，债市信息多空交织，市场静待关键会议信号。随后中央经济工作会议召开，强调高质量发展，叠加资金面回归平稳，做多情绪再度升温，利率全面下行。

操作上，考虑资本市场潮起潮落而组合净值仍旧安全积累，我们对于泛权益方面的仓位和组合整体久期依旧谨慎。未来组合的纯债部分仍将以短期限高等级的信用债的配置为主，保持一定的杠杆水平和流动性，同时积极参与债市调整中带来的配置机会。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实同舟债券 A 基金份额净值为 1.0057 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.27%；截至本报告期末嘉实同舟债券 C 基金份额净值为 1.0039 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.17%；业绩比较基准收益率为 0.69%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）            | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 13,547,582.71    | 1.31         |
|    | 其中：股票             | 13,547,582.71    | 1.31         |
| 2  | 基金投资              | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 1,004,921,255.70 | 97.53        |
|    | 其中：债券             | 1,004,921,255.70 | 97.53        |
|    | 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      | 10,317,403.27    | 1.00         |
| 8  | 其他资产              | 1,609,166.26     | 0.16         |
| 9  | 合计                | 1,030,395,407.94 | 100.00       |

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|   |                  |               |      |
|---|------------------|---------------|------|
| A | 农、林、牧、渔业         |               | -    |
| B | 采矿业              |               | -    |
| C | 制造业              | 10,079,774.71 | 1.17 |
| 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           | 1,021,500.00  | 0.12 |
| 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  | 2,446,308.00  | 0.28 |
| J | 金融业              |               | -    |
| 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       |               | -    |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    |               | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    |               | -    |
| P | 教育               |               | -    |
| Q | 卫生和社会工作          |               | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业        |               | -    |
| S | 综合               |               | -    |
|   | 合计               | 13,547,582.71 | 1.57 |

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量(股)  | 公允价值(元)      | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 600941 | 中国移动 | 14,600 | 1,452,408.00 | 0.17         |
| 2  | 300174 | 元力股份 | 85,800 | 1,373,658.00 | 0.16         |
| 3  | 603606 | 东方电缆 | 29,700 | 1,269,675.00 | 0.15         |
| 4  | 600129 | 太极集团 | 26,900 | 1,249,774.00 | 0.14         |
| 5  | 300395 | 菲利华  | 30,000 | 1,096,800.00 | 0.13         |
| 6  | 300593 | 新雷能  | 70,000 | 1,033,900.00 | 0.12         |
| 7  | 301017 | 漱玉平民 | 50,000 | 1,021,500.00 | 0.12         |
| 8  | 002315 | 焦点科技 | 30,000 | 993,900.00   | 0.11         |
| 9  | 002182 | 宝武镁业 | 50,000 | 983,000.00   | 0.11         |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 6,000  | 979,560.00   | 0.11         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

|    |           |                  |        |
|----|-----------|------------------|--------|
| 1  | 国家债券      | -                | -      |
| 2  | 央行票据      | -                | -      |
| 3  | 金融债券      | 50,646,967.21    | 5.86   |
|    | 其中：政策性金融债 | 50,646,967.21    | 5.86   |
| 4  | 企业债券      | 104,062,020.82   | 12.03  |
| 5  | 企业短期融资券   | 249,402,047.53   | 28.84  |
| 6  | 中期票据      | 505,267,979.21   | 58.42  |
| 7  | 可转债（可交换债） | 95,542,240.93    | 11.05  |
| 8  | 同业存单      | -                | -      |
| 9  | 其他        | -                | -      |
| 10 | 合计        | 1,004,921,255.70 | 116.19 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 102100969 | 21 陕煤化 MTN004 | 800,000 | 82,376,909.29 | 9.52         |
| 2  | 101900491 | 19 粤铁建 MTN001 | 500,000 | 51,572,459.02 | 5.96         |
| 3  | 101900733 | 19 中铝 MTN001  | 500,000 | 51,524,901.64 | 5.96         |
| 4  | 102100798 | 21 首钢 MTN001  | 500,000 | 51,495,180.33 | 5.95         |
| 5  | 230206    | 23 国开 06      | 500,000 | 50,646,967.21 | 5.86         |

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

### 5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.9.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.9.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.10 投资组合报告附注

### 5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

### 5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | 49,574.22    |
| 2  | 应收证券清算款 | 500,000.00   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | -            |
| 5  | 应收申购款   | 1,059,592.04 |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 其他      | -            |
| 8  | 合计      | 1,609,166.26 |

### 5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 127047 | 帝欧转债 | 11,919,059.81 | 1.38         |
| 2  | 127061 | 美锦转债 | 9,351,074.78  | 1.08         |
| 3  | 128124 | 科华转债 | 8,315,197.49  | 0.96         |
| 4  | 123049 | 维尔转债 | 8,306,295.26  | 0.96         |
| 5  | 113589 | 天创转债 | 6,913,185.66  | 0.80         |
| 6  | 127034 | 绿茵转债 | 5,674,171.06  | 0.66         |
| 7  | 128105 | 长集转债 | 4,771,478.17  | 0.55         |
| 8  | 113601 | 塞力转债 | 4,710,819.77  | 0.54         |
| 9  | 113610 | 灵康转债 | 3,786,367.12  | 0.44         |
| 10 | 128125 | 华阳转债 | 3,252,587.67  | 0.38         |
| 11 | 113608 | 威派转债 | 3,231,572.88  | 0.37         |
| 12 | 110081 | 闻泰转债 | 3,178,896.99  | 0.37         |
| 13 | 110082 | 宏发转债 | 2,590,437.85  | 0.30         |
| 14 | 127045 | 牧原转债 | 2,268,439.45  | 0.26         |
| 15 | 127024 | 盈峰转债 | 2,135,013.70  | 0.25         |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 16 | 113641 | 华友转债 | 2,078,653.15 | 0.24 |
| 17 | 123113 | 仙乐转债 | 2,016,126.32 | 0.23 |
| 18 | 123064 | 万孚转债 | 1,866,802.04 | 0.22 |
| 19 | 113605 | 大参转债 | 1,655,451.37 | 0.19 |
| 20 | 118018 | 瑞科转债 | 1,279,295.79 | 0.15 |
| 21 | 127035 | 濮耐转债 | 1,155,532.88 | 0.13 |
| 22 | 127085 | 韵达转债 | 1,095,461.64 | 0.13 |
| 23 | 113048 | 晶科转债 | 1,091,745.21 | 0.13 |
| 24 | 127052 | 西子转债 | 1,090,592.47 | 0.13 |
| 25 | 113636 | 甬金转债 | 941,484.21   | 0.11 |
| 26 | 113624 | 正川转债 | 866,498.19   | 0.10 |

#### 5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

### §6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                        | 嘉实同舟债券 A         | 嘉实同舟债券 C       |
|---------------------------|------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 1,370,916,983.14 | 497,402,099.05 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 11,837,925.05    | 38,345,225.94  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 731,491,617.19   | 326,638,371.94 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                | -              |
| 报告期期末基金份额总额               | 651,263,291.00   | 209,108,953.05 |

### §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

### §8 备查文件目录

#### 8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实同舟债券型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实同舟债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实同舟债券型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实同舟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) 报告期内嘉实同舟债券型证券投资基金公告的各项原稿。

## 8.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 8.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日