

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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，并由代董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43

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	43
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	43
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	43
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	43
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
7.12	市场中性策略执行情况	44
7.13	投资组合报告附注	44
§ 8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
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	46
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	46
§ 9	开放式基金份额变动	46
§ 10	重大事件揭示	47
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	47
10.4	基金投资策略的改变	47
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8	其他重大事件	57
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	58
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	58
§ 12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实绝对收益策略定期混合	
基金主代码	000414	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 12 月 6 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	110,352,452.99 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实绝对收益策略定期混合 A	嘉实绝对收益策略定期混合 C
下属分级基金的交易代码	000414	014216
报告期末下属分级基金的份额总额	110,351,556.17 份	896.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用以市场中性投资策略为主的多种绝对收益策略，剥离系统性风险，力争实现稳定的绝对回报。 具体包括：市场中性投资策略（多头股票投资策略、空头工具投资策略）、其他绝对收益策略（股指期货套利策略、其他绝对收益策略）、债券投资策略、衍生品投资策略。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95566
传真	(010)65215588	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街 1 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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100020	100818
法定代表人	经雷	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	嘉实绝对收益策略定期混合 A	嘉实绝对收益策略定期混合 C
本期已实现收益	-6,432,132.47	-15,824.35
本期利润	2,122,161.23	5,856.06
加权平均基金份额 本期利润	0.0181	0.0418
本期加权平均净 值利润率	1.30%	3.04%
本期基金份额净 值增长率	1.31%	2.42%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	32,821,995.31	269.55
期末可供分配基 金份额利润	0.2974	0.3006

期末基金资产净值	153,570,822.89	1,251.27
期末基金份额净值	1.392	1.395
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	39.20%	-2.58%

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

嘉实绝对收益策略定期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.71%	0.13%	0.12%	0.00%	-0.83%	0.13%
过去三个月	-0.57%	0.20%	0.37%	0.00%	-0.94%	0.20%
过去六个月	1.31%	0.28%	0.75%	0.01%	0.56%	0.27%
过去一年	1.38%	0.23%	1.50%	0.00%	-0.12%	0.23%
过去三年	-3.40%	0.23%	4.57%	0.00%	-7.97%	0.23%
自基金合同生效起至今	39.20%	0.26%	19.60%	0.01%	19.60%	0.25%

嘉实绝对收益策略定期混合 C

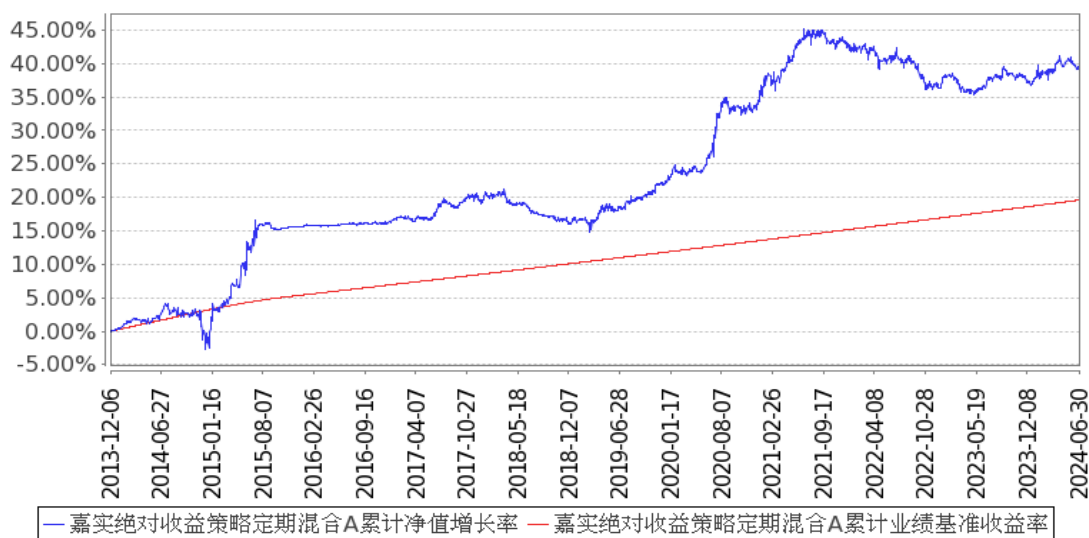
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.78%	0.15%	0.12%	0.00%	-0.90%	0.15%
过去三个月	-0.71%	0.20%	0.37%	0.00%	-1.08%	0.20%
过去六个月	2.42%	0.30%	0.75%	0.01%	1.67%	0.29%
过去一年	2.27%	0.24%	1.50%	0.00%	0.77%	0.24%

自基金合同生效起 至今	-2.58%	0.23%	3.87%	0.00%	-6.45%	0.23%
----------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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

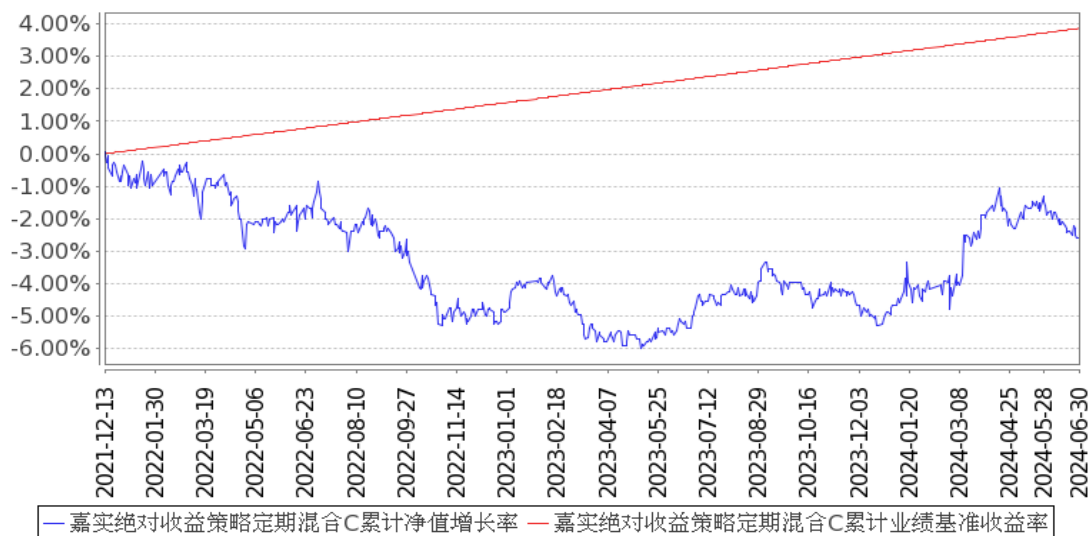
嘉实绝对收益策略定期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2013年12月06日至2024年06月30日)



嘉实绝对收益策略定期混合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

(2021年12月13日至2024年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2024年6月30日，基金管理人共管理351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		
金猛	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实对冲套利定期混合基金经理	2020年5月14日	-	12年	曾任职于安信基金管理有限责任公司，从事风险控制工作。2014年9月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。硕士研究生，特许金融分析师（CFA），金融风险管理师（FRM），具有基金从业资格。中国国籍。

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
金猛	公募基金	3	292,631,294.83	2018年9月20日
	私募资产管理计划	2	284,664,748.90	2022年11月21日
	其他组合	1	373,274,459.19	2021年11月12日
	合计	6	950,570,502.92	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式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 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

随着 2024 年上半年的结束，A 股在震荡中收官于 3000 点下方。虽然在一季度内市场以春节前一周为分水岭，出现了剧烈的估值修复和风格逆转，大盘指数从一度跌至 2635 强势反弹到 3150 点上方；在二季度市场的反弹势头从 5 月下旬后开始走弱，回吐了 2 月底以来超过一半的涨幅，但以红利为主的价值风格仍旧保持了可观的超额收益。整个上半年上证指数微幅下跌 0.25%，沪深 300 指数上涨 0.89%，A 股的绝对收益表现显著好于前三年，但在乐观情绪中也同样伴随着结构上的不安：成长方向的基本面与边际资金依然承压，同时中小市值板块虽然在上个季度出现了历史性的出清但在新的监管环境中内部资金依然有很大的分歧。从行业上看，银行、煤炭、公用事业、家用电器整体保持着稳定的超额收益，几乎均受益于红利风格或出口景气等主题，综合、计算机、商贸零售、社服、传媒等内需驱动为主的行业跌幅则排名居前。

在宏观基本面角度，在一季度经济超预期开门红后，二季度总体延续了回升向好态势，高质量发展扎实推进，但同时市场也关注到总量数据背后的结构性差异，消费、投资和金融数据仍体

现出一种有效需求不足、社会预期偏弱的状态。例如，后疫情时代居民就业和收入状况有所改善，但因物价低迷和经济名义增速偏低的影响获得感不强，压制了消费和长期贷款需求。又如出口超预期和 PPI 回升带动了制造业投资的回暖，前 5 个月累计同比达 9.6%，但主要利好上游企业，偏中下游的领域利润空间反受到挤压。我们倾向于这种宏观数据和微观感受的错位主因是短期内传导机制的不畅所致，边际资金急于看到企业盈利数据出现持续改善，而在市场底部区域出现月线级别的反弹中继，但随着宏观微观环境的收敛，市场的趋势会与基本面保持同步。

本基金在风险预算的框架下构建股票组合，严格控制组合风险，并用股指期货完全对冲，剥离股票组合的系统性风险，同时在市场情绪剧烈波动的市场环境中积极参与和把握期限套利机会。报告期内，本基金坚持稳健的投资风格，在高波动中严格控制风险和回撤，并持续参与新股认购等绝对收益策略，努力取得更好的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实绝对收益策略定期混合 A 基金份额净值为 1.392 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.31%；截至本报告期末嘉实绝对收益策略定期混合 C 基金份额净值为 1.395 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.42%；业绩比较基准收益率为 0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

受益于出口部门的优异表现、新质生产力的持续发展和房地产市场和民营积极促进政策的调整，上半年整体经济增长压力暂时得到缓解，对应到资本市场也出现了非常积极的见底迹象。然而下半年市场仍需要重点关注一些重要线索，例如严监管条件下股权融资下滑对社融的拖累、消费需求复苏不及预期、海外重要经济体选举等地缘政治事件等。

从长期来看，以房地产行业繁荣为经济引擎的时代，与未来高质量发展阶段之间的过渡将会是未来一段时间整个证券市场的主基调，一个可能的反射是各要素的重新定价，其中资本回报率可能会首先承压，对权益投资带来不可忽视的挑战。基本情形下，A 股市场内部的结构分化，包括具体到系统化投资策略的侧重点和执行方法都存在潜在的调整空间。在 24 年上半年我们看到了小微盘主题虚假繁荣的崩塌和监管层围绕证券市场长期健康发展所做努力取得了积极进展。随着 IPO 与再融资、减持趋势的确定性逆转，以及长期耐心资本、工具化金融产品重要性的不断提升，市场的风格与审美特征有非常高的概率转为以长期稳健分红、高性价比。19-21 年的追逐缺少基本面支撑的成长赛道，过去三年对小微盘和量价特征选股逻辑的策略迫切需要重新回到以基本面为主导。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	8,346,896.81	16,427,219.73
结算备付金		24,683,705.39	24,972,363.93
存出保证金		11,604,403.36	12,834,828.42
交易性金融资产	6.4.7.2	109,339,779.97	116,253,312.03
其中：股票投资		107,848,911.78	114,976,972.76
基金投资		-	-
债券投资		1,490,868.19	1,276,339.27
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		153,974,785.53	170,487,724.11
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		129,099.09	165,107.42
应付托管费		25,819.84	33,021.49
应付销售服务费		0.30	170.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5.71	180,136.96
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	247,786.43	363,168.20
负债合计		402,711.37	741,604.83
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	110,352,452.99	123,514,967.90
未分配利润	6.4.7.12	43,219,621.17	46,231,151.38
净资产合计		153,572,074.16	169,746,119.28
负债和净资产总计		153,974,785.53	170,487,724.11

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实绝对收益策略定期混合 A 基金份额净值 1.392 元，基金份额总额 110,351,556.17 份，嘉实绝对收益策略定期混合 C 基金份额净值 1.395 元，基金份额总额 896.82 份，基金份额总额合计为 110,352,452.99 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,215,049.75	2,669,151.68
1. 利息收入		211,147.72	515,754.47
其中：存款利息收入	6.4.7.13	211,147.72	493,926.86
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		-	21,827.61
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,572,153.83	-5,608,529.60
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,638,436.79	-8,484,954.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	20,243.35	54,483.96
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	-2,351,248.79	893,352.42
股利收益	6.4.7.19	1,397,288.40	1,928,588.33
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	8,575,974.11	7,662,872.45
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	81.75	99,054.36
减：二、营业总支出		1,087,032.46	2,187,893.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	814,552.85	1,647,587.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	162,910.57	411,896.71
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	399.72	1,036.97
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		12,068.24	3,370.98
8. 其他费用	6.4.7.23	97,101.08	124,002.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,128,017.29	481,257.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,128,017.29	481,257.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,128,017.29	481,257.88

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	123,514,967.90	-	46,231,151.38	169,746,119.28
二、本期期初净资产	123,514,967.90	-	46,231,151.38	169,746,119.28
三、本期增减变动额（减少以“-”	-13,162,514.91	-	-3,011,530.21	-16,174,045.12

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	2,128,017.29	2,128,017.29
(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)	-13,162,514.91	-	-5,139,547.50	-18,302,062.41
其中: 1. 基金申购款	7,605.97	-	2,970.27	10,576.24
2. 基金赎回款	-13,170,120.88	-	-5,142,517.77	-18,312,638.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	110,352,452.99	-	43,219,621.17	153,572,074.16
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023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	296,860,901.69	-	109,438,897.67	406,299,799.36
二、本期期初净资产	296,860,901.69	-	109,438,897.67	406,299,799.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-112,541,420.65	-	-40,613,408.57	-153,154,829.22
(一)、综合收益总额	-	-	481,257.88	481,257.88
(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)	-112,541,420.65	-	-41,094,666.45	-153,636,087.10
其中: 1. 基金申购款	112,864.86	-	41,110.76	153,975.62
2. 基金赎回款	-112,654,285.51	-	-41,135,777.21	-153,790,062.72
(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	184,319,481.04	-	68,825,489.10	253,144,970.14

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
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

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金(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[2013]1334号《关于核准嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于2013年12月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,155,528,960.01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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利

收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	8,346,896.81
等于：本金	8,346,123.05
加：应计利息	773.76
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	8,346,896.81

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	111,560,573.22	-	107,848,911.78	-3,711,661.44	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,294,609.26	3,581.59	1,490,868.19	192,677.34
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,294,609.26	3,581.59	1,490,868.19	192,677.34
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	112,855,182.48	3,581.59	109,339,779.97	-3,518,984.10	

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 2024 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-96,703,900.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-96,703,900.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-96,703,900.00	-	-	-

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
IC2407	IC2407	-8.00	-7,868,160.00	690,920.00
IC2409	IC2409	-2.00	-1,950,080.00	146,040.00
IF2407	IF2407	-20.00	-20,622,000.00	592,020.00
IF2409	IF2409	-61.00	-62,651,880.00	2,182,800.00
合计				3,611,780.00
减：可抵销期货				3,611,780.00

暂收款				
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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 2024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	161,261.81
其中：交易所市场	161,261.81
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,524.62
合计	247,786.43

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实绝对收益策略定期混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,145,612.13	123,145,612.13
本期申购	7,598.70	7,598.70
本期赎回（以“-”号填列）	-12,801,654.66	-12,801,654.66
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	110,351,556.17	110,351,556.17

嘉实绝对收益策略定期混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	369,355.77	369,355.77
本期申购	7.27	7.27
本期赎回（以“-”号填列）	-368,466.22	-368,466.22
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	896.82	896.82

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

嘉实绝对收益策略定期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,133,677.20	2,963,685.95	46,097,363.15
本期期初	43,133,677.20	2,963,685.95	46,097,363.15
本期利润	-6,432,132.47	8,554,293.70	2,122,161.23
本期基金份额交易产生的变动数	-3,879,549.42	-1,120,708.24	-5,000,257.66
其中：基金申购款	2,319.89	647.65	2,967.54
基金赎回款	-3,881,869.31	-1,121,355.89	-5,003,225.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,821,995.31	10,397,271.41	43,219,266.72

嘉实绝对收益策略定期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	125,021.68	8,766.55	133,788.23
本期期初	125,021.68	8,766.55	133,788.23
本期利润	-15,824.35	21,680.41	5,856.06
本期基金份额交易产生的变动数	-108,927.78	-30,362.06	-139,289.84
其中：基金申购款	2.12	0.61	2.73
基金赎回款	-108,929.90	-30,362.67	-139,292.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	269.55	84.90	354.45

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	20,218.78
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	190,697.60
其他	231.34
合计	211,147.72

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
	2024年1月1日至2024年6月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,638,436.79
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	-4,638,436.79

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	268,492,396.17
减：卖出股票成本总额	272,615,965.83
减：交易费用	514,867.13
买卖股票差价收入	-4,638,436.79

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,274.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,968.90
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	20,243.35

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	161,175.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	143,000.00
减：应计利息总额	189.36
减：交易费用	17.05
买卖债券差价收入	17,968.90

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-2,351,248.79

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,397,288.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,397,288.40

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,903,556.92
股票投资	5,816,007.08
债券投资	87,549.84
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	2,672,417.19
权证投资	-
期货投资	2,672,417.19
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	8,575,974.11

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	81.05
基金转出费收入	0.70
合计	81.75

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	26,852.28
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

银行划款手续费	1,576.46
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	97,101.08

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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 2024年1月1日至2024年6	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年
----	------------------------	----------------------------

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	814,552.85	1,647,587.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	142,016.95	216,837.91
应支付基金管理人的净管理费	672,535.90	1,430,749.15

注：1. 支付基金管理人的基本管理费按前一日基金资产净值 1% 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：日基本管理费=前一日基金资产净值×1% / 当年天数。

2. 基金管理人的附加管理费

(1) 基金管理人可在同时满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

- ① 符合基金收益分配条件
- ② 附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的 10% 作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。

提取评价日：每次基金封闭期的最后一个工作日

(2) 附加管理费的计算方法和提取

$$\text{附加管理费} = (P_A - P_H) \times 10\% \times S_A$$

其中： P_A 为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值

$$P_A = \text{提取评价日基金份额净值}$$

$$\times \text{提取评价日的折算因子} + \sum_{i=1}^n \text{第} i \text{次基金份额分红} \times \text{第} i \text{次分红日的折算因子}$$

P_H 为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，其中首次封闭期的 P_H 为 1。

$$S_A = \text{提取评价日的基金份额} = \text{提取评价日基金总份额} / \text{提取评价日的折算因子}$$

特定日期的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积
 折算系数=基金折算日除权前基金份额净值/基金折算日除权后基金份额净值

3. 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	162,910.57	411,896.71

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	嘉实绝对收益策略定 期混合 A	嘉实绝对收益策略定 期混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	398.80	398.80
合计	-	398.80	398.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实绝对收益策略定 期混合 A	嘉实绝对收益策略定 期混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	1,036.97	1,036.97
合计	-	1,036.97	1,036.97

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，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 × 0.40% / 当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
中国银行股份有限公司_活期	8,346,896.81	20,218.78	30,896,756.12	68,610.58

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（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024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

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是灵活应用多种绝对收益策略对冲本基金的系统性风险，寻求基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、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

无。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	1,374,804.15	981,418.26
AAA 以下	116,064.04	294,921.01
未评级	-	-
合计	1,490,868.19	1,276,339.27

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 2024 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	8,346,896.81	-	-	-	8,346,896.81
结算备付金	24,683,705.39	-	-	-	24,683,705.39
存出保证金	28,311.36	-	-	11,576,092.00	11,604,403.36
交易性金融资产	-	1,490,868.19	-	107,848,911.78	109,339,779.97
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	33,058,913.56	1,490,868.19	-	-119,425,003.78	153,974,785.53
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	129,099.09	129,099.09
应付托管费	-	-	-	25,819.84	25,819.84
应付销售服务费	-	-	-	0.30	0.30
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5.71	5.71
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	247,786.43	247,786.43
负债总计	-	-	-	402,711.37	402,711.37
利率敏感度缺口	33,058,913.56	1,490,868.19	-	-119,022,292.41	153,572,074.16
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产	-	-	-	-	-
货币资金	16,427,219.73	-	-	-	16,427,219.73
结算备付金	24,972,363.93	-	-	-	24,972,363.93
存出保证金	18,784.02	-	-	12,816,044.40	12,834,828.42
交易性金融资产	-	993,632.15	282,707.12	114,976,972.76	116,253,312.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	41,418,367.68	993,632.15	282,707.12	127,793,017.16	170,487,724.11
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	165,107.42	165,107.42
应付托管费	-	-	-	33,021.49	33,021.49
应付销售服务费	-	-	-	170.76	170.76
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	180,136.96	180,136.96
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	363,168.20	363,168.20
负债总计	-	-	-	741,604.83	741,604.83
利率敏感度缺口	41,418,367.68	993,632.15	282,707.12	127,051,412.33	169,746,119.28

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-15,095.10	-15,122.94
市场利率下降25个基点	15,291.32	15,344.80	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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）

	动	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	107,848,911.78	70.23	114,976,972.76	67.73
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	107,848,911.78	70.23	114,976,972.76	67.73

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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%		1,059,306.22
业绩比较基准下降 5%		-1,059,306.22	-979,702.24

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	109,339,779.97	115,431,576.25
第二层次	-	-
第三层次	-	821,735.78
合计	109,339,779.97	116,253,312.03

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	107,848,911.78	70.04
	其中：股票	107,848,911.78	70.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,490,868.19	0.97
	其中：债券	1,490,868.19	0.97
	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	33,030,602.20	21.45
8	其他各项资产	11,604,403.36	7.54
9	合计	153,974,785.53	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合**

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	23,784.00	0.02
B	采矿业	7,751,543.00	5.05
C	制造业	54,412,271.53	35.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,468,863.00	3.56
E	建筑业	2,908,092.00	1.89
F	批发和零售业	633,780.00	0.41

G	交通运输、仓储和邮政业	3,258,113.00	2.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,681,995.50	3.70
J	金融业	22,443,058.75	14.61
K	房地产业	1,649,445.00	1.07
L	租赁和商务服务业	893,607.00	0.58
M	科学研究和技术服务业	1,301,108.00	0.85
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	492,264.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	930,987.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	107,848,911.78	70.23

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,400	4,989,126.00	3.25
2	300750	宁德时代	21,820	3,928,254.60	2.56
3	000333	美的集团	48,200	3,108,900.00	2.02
4	600036	招商银行	87,100	2,977,949.00	1.94
5	002475	立讯精密	63,800	2,507,978.00	1.63
6	600030	中信证券	127,635	2,326,786.05	1.52
7	600276	恒瑞医药	58,600	2,253,756.00	1.47
8	600919	江苏银行	266,700	1,981,581.00	1.29
9	601728	中国电信	320,000	1,968,000.00	1.28
10	002371	北方华创	5,918	1,893,109.02	1.23
11	601169	北京银行	323,600	1,889,824.00	1.23
12	000568	泸州老窖	13,100	1,879,719.00	1.22
13	601601	中国太保	66,800	1,861,048.00	1.21
14	002352	顺丰控股	49,900	1,780,931.00	1.16
15	600886	国投电力	93,100	1,698,144.00	1.11
16	601668	中国建筑	309,600	1,643,976.00	1.07
17	000725	京东方 A	396,000	1,619,640.00	1.05
18	600547	山东黄金	58,800	1,609,944.00	1.05
19	600760	中航沈飞	39,960	1,602,396.00	1.04
20	600426	华鲁恒升	59,000	1,571,760.00	1.02
21	601838	成都银行	101,800	1,546,342.00	1.01

22	688111	金山办公	6,783	1,543,132.50	1.00
23	600023	浙能电力	216,800	1,541,448.00	1.00
24	002311	海大集团	32,700	1,538,535.00	1.00
25	300122	智飞生物	54,200	1,519,226.00	0.99
26	601633	长城汽车	59,400	1,502,820.00	0.98
27	000425	徐工机械	209,400	1,497,210.00	0.97
28	300760	迈瑞医疗	5,100	1,483,641.00	0.97
29	601058	赛轮轮胎	101,800	1,425,200.00	0.93
30	601881	中国银河	129,000	1,400,940.00	0.91
31	000596	古井贡酒	6,500	1,371,955.00	0.89
32	002463	沪电股份	36,800	1,343,200.00	0.87
33	601198	东兴证券	166,300	1,323,748.00	0.86
34	603259	药明康德	33,200	1,301,108.00	0.85
35	601128	常熟银行	169,310	1,281,676.70	0.83
36	001979	招商蛇口	143,900	1,264,881.00	0.82
37	601800	中国交建	141,400	1,264,116.00	0.82
38	688516	奥特维	29,082	1,215,918.42	0.79
39	000786	北新建材	39,500	1,171,570.00	0.76
40	601318	中国平安	28,300	1,170,488.00	0.76
41	601077	渝农商行	228,800	1,148,576.00	0.75
42	601328	交通银行	150,200	1,121,994.00	0.73
43	600941	中国移动	10,400	1,118,000.00	0.73
44	002128	电投能源	51,500	1,086,650.00	0.71
45	600309	万华化学	13,400	1,083,524.00	0.71
46	000543	皖能电力	121,100	1,071,735.00	0.70
47	002812	恩捷股份	33,400	1,057,110.00	0.69
48	002582	好想你	190,500	1,022,985.00	0.67
49	688036	传音控股	12,893	986,830.22	0.64
50	002078	太阳纸业	68,900	961,155.00	0.63
51	002415	海康威视	30,900	955,119.00	0.62
52	300251	光线传媒	110,700	930,987.00	0.61
53	601088	中国神华	20,700	918,459.00	0.60
54	601166	兴业银行	51,500	907,430.00	0.59
55	000975	银泰黄金	55,200	899,208.00	0.59
56	601888	中国中免	14,300	893,607.00	0.58
57	601899	紫金矿业	50,000	878,500.00	0.57
58	603993	洛阳钼业	99,700	847,450.00	0.55
59	002120	韵达股份	107,800	834,372.00	0.54
60	600905	三峡能源	191,200	833,632.00	0.54
61	600346	恒力石化	54,000	753,300.00	0.49
62	688012	中微公司	5,112	722,121.12	0.47
63	002648	卫星化学	40,000	719,200.00	0.47
64	300274	阳光电源	11,420	708,382.60	0.46

65	600000	浦发银行	81,000	666,630.00	0.43
66	000039	中集集团	71,400	661,164.00	0.43
67	002727	一心堂	42,000	633,780.00	0.41
68	601600	中国铝业	81,600	622,608.00	0.41
69	601898	中煤能源	49,200	614,016.00	0.40
70	600933	爱柯迪	40,400	597,516.00	0.39
71	300308	中际旭创	3,900	537,732.00	0.35
72	002920	德赛西威	5,800	505,122.00	0.33
73	300015	爱尔眼科	47,700	492,264.00	0.32
74	601688	华泰证券	38,200	473,298.00	0.31
75	002602	世纪华通	134,100	459,963.00	0.30
76	000921	海信家电	13,900	448,136.00	0.29
77	000999	华润三九	9,450	402,381.00	0.26
78	600048	保利发展	43,900	384,564.00	0.25
79	000703	恒逸石化	53,200	377,188.00	0.25
80	600028	中国石化	56,500	357,080.00	0.23
81	601989	中国重工	71,900	354,467.00	0.23
82	600050	中国联通	70,000	329,000.00	0.21
83	600900	长江电力	11,200	323,904.00	0.21
84	601168	西部矿业	17,600	315,920.00	0.21
85	600019	宝钢股份	43,300	287,945.00	0.19
86	603885	吉祥航空	26,000	285,740.00	0.19
87	300840	酷特智能	29,700	274,725.00	0.18
88	300002	神州泰岳	32,500	263,900.00	0.17
89	600018	上港集团	42,900	247,962.00	0.16
90	002557	洽洽食品	8,400	236,796.00	0.15
91	601615	明阳智能	24,300	229,392.00	0.15
92	600985	淮北矿业	13,400	224,316.00	0.15
93	000960	锡业股份	12,700	196,723.00	0.13
94	688388	嘉元科技	17,965	175,158.75	0.11
95	601628	中国人寿	4,900	152,145.00	0.10
96	603323	苏农银行	30,900	148,629.00	0.10
97	001872	招商港口	4,300	82,775.00	0.05
98	000050	深天马 A	9,000	65,520.00	0.04
99	002142	宁波银行	2,900	63,974.00	0.04
100	688041	海光信息	495	34,808.40	0.02
101	601919	中远海控	1,700	26,333.00	0.02
102	300498	温氏股份	1,200	23,784.00	0.02
103	688981	中芯国际	244	11,248.40	0.01

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 (%)
----	------	------	----------	-----------------

	码			
1	002475	立讯精密	3,889,991.00	2.29
2	300122	智飞生物	3,572,096.50	2.10
3	601728	中国电信	3,545,760.00	2.09
4	300760	迈瑞医疗	3,285,540.00	1.94
5	600660	福耀玻璃	3,122,086.00	1.84
6	300498	温氏股份	2,944,579.00	1.73
7	000596	古井贡酒	2,929,034.00	1.73
8	688036	传音控股	2,847,912.95	1.68
9	600745	闻泰科技	2,699,965.00	1.59
10	601601	中国太保	2,692,431.00	1.59
11	601169	北京银行	2,680,309.00	1.58
12	601881	中国银河	2,602,715.00	1.53
13	300750	宁德时代	2,515,379.00	1.48
14	600036	招商银行	2,493,454.00	1.47
15	002812	恩捷股份	2,484,518.00	1.46
16	300015	爱尔眼科	2,424,668.00	1.43
17	603259	药明康德	2,386,932.00	1.41
18	000425	徐工机械	2,325,037.00	1.37
19	688111	金山办公	2,263,228.11	1.33
20	300308	中际旭创	2,170,800.00	1.28

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	002475	立讯精密	4,388,590.00	2.59
2	600660	福耀玻璃	3,588,565.00	2.11
3	600028	中国石化	3,581,817.00	2.11
4	601318	中国平安	3,538,133.00	2.08
5	300498	温氏股份	3,437,252.60	2.02
6	300015	爱尔眼科	3,183,641.93	1.88
7	688036	传音控股	3,179,607.69	1.87
8	601088	中国神华	2,922,847.63	1.72
9	002415	海康威视	2,882,406.00	1.70
10	601567	三星医疗	2,862,231.00	1.69
11	601288	农业银行	2,736,512.00	1.61
12	600745	闻泰科技	2,660,112.00	1.57
13	600489	中金黄金	2,623,266.00	1.55
14	300750	宁德时代	2,569,814.40	1.51
15	002142	宁波银行	2,481,359.00	1.46
16	000425	徐工机械	2,449,667.00	1.44
17	600519	贵州茅台	2,343,927.00	1.38
18	603259	药明康德	2,308,906.03	1.36

19	600016	民生银行	2,293,796.00	1.35
20	002028	思源电气	2,262,813.00	1.33

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	259,671,897.77
卖出股票收入（成交）总额	268,492,396.17

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,490,868.19	0.97
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,490,868.19	0.97

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	113062	常银转债	9,020	1,103,627.40	0.72
2	127049	希望转 2	2,620	271,176.75	0.18
3	118031	天 23 转债	1,250	116,064.04	0.08

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金采用股指期货完全对冲，剥离股票组合的系统性风险，同时在市场情绪剧烈波动的市场环境中积极参与和把握期限套利机会，以获取绝对收益。

本基金投资于股指期货，剥离系统性风险，大幅降低净值波动率，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 107,848,911.78 元，占基金资产净值的比例为 70.23%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 93,092,120.00 元，占基金资产净值的比例为 60.62%，空头合约市值占股票资产的比例为 86.32%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -6,989,685.58 元，公允价值变动损益为 8,488,424.27 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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，中信证券股份有限公司出现本期被监管部门立案调查，中信证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.13.2 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。

7.13.3 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	11,604,403.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,604,403.36

7.13.4 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	113062	常银转债	1,103,627.40	0.72
2	127049	希望转 2	271,176.75	0.18
3	118031	天 23 转债	116,064.04	0.08

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
嘉实绝对收益策略定期混合 A	3,400	32,456.34	43,351,663.25	39.29	66,999,892.92	60.71
嘉实绝对收益策略定期混合 C	3	298.94	-	-	896.82	100.00
合计	3,403	32,427.99	43,351,663.25	39.28	67,000,789.74	60.72

注：(1) 嘉实绝对收益策略定期混合 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实绝对收益策略定期混合 A 份额占嘉实绝对收益策略定期混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实绝对收益策略定期混合 A 份额占嘉实绝对收益策略定期混合 A 总份额比例；

(2) 嘉实绝对收益策略定期混合 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额

占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实绝对收益策略定期混合 C 份额占嘉实绝对收益策略定期混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实绝对收益策略定期混合 C 份额占嘉实绝对收益策略定期混合 C 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实绝对收益策略定期混合 A	70,155.36	0.06
	嘉实绝对收益策略定期混合 C	0.70	0.08
	合计	70,156.06	0.06

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实绝对收益策略定期混合 A	0
	嘉实绝对收益策略定期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实绝对收益策略定期混合 A	0~10
	嘉实绝对收益策略定期混合 C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实绝对收益策略定期混合 A	嘉实绝对收益策略定期混合 C
基金合同生效日 (2013 年 12 月 6 日) 基金份额总额	2,155,528,960.01	-
本报告期期初基金份额总额	123,145,612.13	369,355.77
本报告期基金总申购份额	7,598.70	7.27
减：本报告期基金总赎回份额	12,801,654.66	368,466.22

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	110,351,556.17	896.82

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	10	97,739,615.12	18.51	50,269.68	14.50	-
华泰证券股份有限公司	5	68,038,574.18	12.88	47,627.36	13.74	-
长江证券股份有限公司	2	56,818,103.60	10.76	37,477.39	10.81	-
中信建投证券股份有限公司	4	43,990,905.46	8.33	30,793.79	8.88	-
民生证券股份有限公司	2	42,727,500.87	8.09	29,909.24	8.63	-
中泰证券股份有限公司	5	38,323,334.78	7.26	26,826.50	7.74	-
方正证券股份有限公司	5	35,133,695.42	6.65	23,863.38	6.88	-
国金证券股份有限公司	2	34,960,578.49	6.62	24,472.41	7.06	-
天风证券股份有限公司	4	27,896,756.21	5.28	18,020.88	5.20	-
平安证券股份有限公司	4	24,397,549.35	4.62	17,078.29	4.93	-
国泰君安证券股份有限公司	4	21,445,556.38	4.06	14,712.91	4.24	-
中国国际金融股份有限公司	5	17,432,292.31	3.30	12,202.62	3.52	-
国信证券股份有限公司	1	9,818,675.73	1.86	6,873.08	1.98	-
兴业证券股份有限	3	8,863,542.04	1.68	6,204.47	1.79	-

公司						
海通证券股份有限公司	5	422,972.00	0.08	296.07	0.09	-
广发证券股份有限公司	6	154,642.00	0.03	108.23	0.03	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国投证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
国新证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华林证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
联储证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
山西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-

万联证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

中邮证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
--------------------	---	---	---	---	---	---

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	43,284.80	10.08	-	-	-	-

中泰证 券股份 有限公 司	268,243.23	62.47	-	-	-	-
方正证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	117,890.51	27.45	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

渤海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长城证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
诚通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
第一创 业证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

高盛高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华林证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联储证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-

英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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	关于嘉实绝对收益策略定期混合第四十一个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年3月6日

2	关于嘉实绝对收益策略定期混合第四十二个开放期开放申购、赎回及转换业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 12 日
---	---------------------------------------	-----------------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024-01-01 至 2024-06-30	34,649,341.64	-	-	34,649,341.64	31.40
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，

或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日