

嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合
型基金中基金（FOF）
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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

报告送出日期：2023 年 10 月 24 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 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 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）
基金主代码	016737
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 12 月 13 日
报告期末基金份额总额	169,529,361.70 份
投资目标	本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金的主要投资策略包括资产配置策略、基金筛选策略。其中，资产配置策略通过战略资产配置与战术资产配置确定各个大类资产的具体配置比例；基金筛选策略通过全方位的定量和定性分析筛选出符合基金管理人要求的标的基金，并通过基金匹配框架，完成基金组合构建。 本基金其他投资策略包括股票投资策略、债券投资策略、存托凭证投资策略、资产支持证券投资策略和风险管理策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*80%+活期存款利率（税后）*20%。
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金（FOF），本基金长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金（FOF），高于债券型基金、债券型基金中基金（FOF）、货币市场基金和货币型基金中基金（FOF）。
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

下属分级基金的基金简称	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）A	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C
下属分级基金的交易代码	016737	016738
报告期末下属分级基金的份额总额	135,306,692.50 份	34,222,669.20 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 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）A	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C
1. 本期已实现收益	-2,871,907.46	-724,384.79
2. 本期利润	-10,901,385.07	-2,693,170.44
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0764	-0.0779
4. 期末基金资产净值	124,018,527.84	31,267,820.43
5. 期末基金份额净值	0.9166	0.9137

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

嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）A

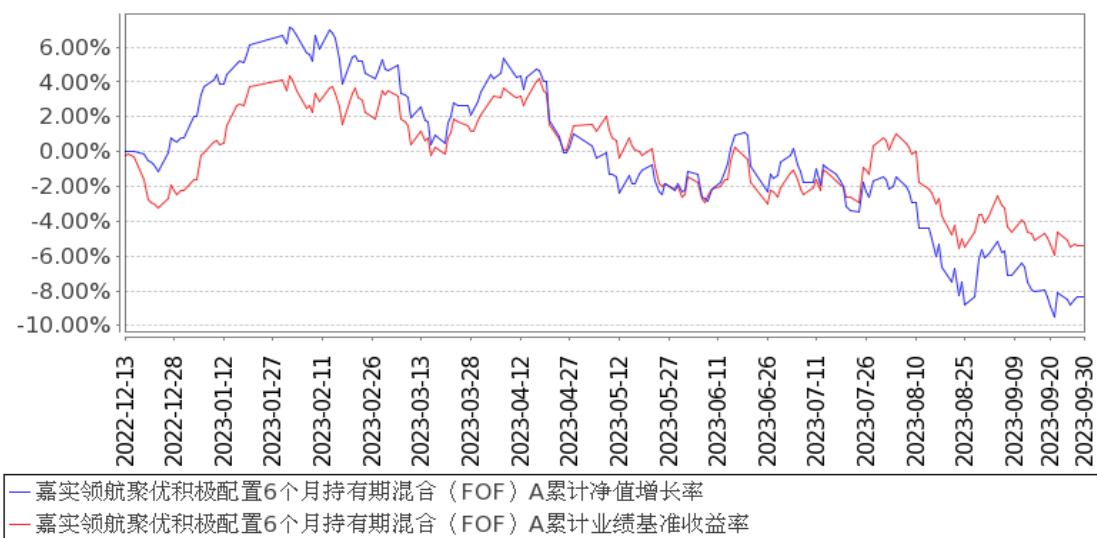
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.76%	0.80%	-3.39%	0.70%	-4.37%	0.10%
过去六个月	-11.39%	0.76%	-7.39%	0.67%	-4.00%	0.09%
自基金合同生效起至今	-8.34%	0.72%	-5.41%	0.66%	-2.93%	0.06%

嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C

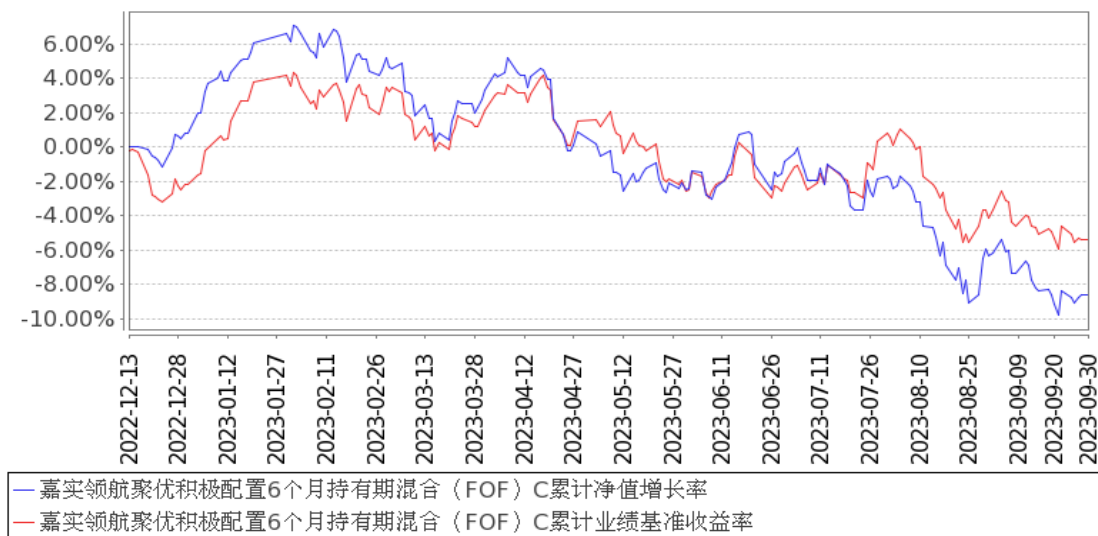
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.86%	0.80%	-3.39%	0.70%	-4.47%	0.10%
过去六个月	-11.57%	0.76%	-7.39%	0.67%	-4.18%	0.09%
自基金合同生效起至今	-8.63%	0.72%	-5.41%	0.66%	-3.22%	0.06%

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

嘉实领航聚优积极配置6个月持有期混合（FOF）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
（2022年12月13日至2023年09月30日）



嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）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
(2022 年 12 月 13 日至 2023 年 09 月 30 日)



注：（1）本基金合同生效日 2022 年 12 月 13 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜玉雯	本基金、嘉实领航聚利稳健配置 6 个月持有期混合发起（FOF）基金经理	2022 年 12 月 13 日	-	6 年	曾任国家外汇管理局中央外汇业务中心运营部高级经理，2017 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，历任风险管理部风险管理研究员、权益风险组副总监、基金策略研究中心副主任。现任 FOF 投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 2 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

本基金定位于追求“持有期内相对全市场偏股公募基金平均收益”的胜率，以便各位投资者在看好权益市场却又不知道怎么买和买什么的时候，作为工具类产品进行配置。

组合的投资方法和配置思路在一季报中进行了详述，在此不再赘述。三季度高度波动的市场中，我们更新了组合操作上的几点心得，在此向各位投资者进行汇报：

1. 我们复盘了景气度-质量-估值的三元分类体系中不同分类的历史表现，挑出了“低估值价值成长”这一分类，这一分类除了在流动性极为充裕的成长牛市中难以跑赢外，在绝大多数的市场环境中都可以跑赢或者跑平市场平均水平。分类中的基金经理多为看重 PE 的 PEG 选股框架，主打“低估值+困境反转“或”低估值+景气加速“，主观或量化基金经理均有所覆盖。特征上，整体表现出行业分散、换手偏高、市值中小盘为主和静态估值中低。在经济基本面相对偏弱、地产后指数级别新的经济增长抓手还没显现的当下，该策略预计短期能继续较佳适应市场环境。我们的轮动仓位也借鉴了这一思路，以当前低估值、且景气度有望提升的行业作为备选对象，这一策略会略偏左侧，兑现需要时间，选 3-5 个细分线索分散投资可能会减少左侧等待时间。我们参考

的量化指标包括但不限于：估值水平、基本面预期改善幅度、资金加仓行为、拥挤度（风险指标）等。

2. 在结合不同分类的历史表现和投资者收益的情况下，我们认为更看重估值的几个基金分类——深度价值、质量价值、低估值价值成长——更适合个人投资者参与，这些分类的缺点在于在流动性充裕的牛市中无法跑赢市场平均水平，但实际上个人投资者在牛市中后期参与往往也很难获得正向绝对收益。有句话“真理在荒谬被证实以前，都只是暗室里的装饰。只有眼前亮起来了以后，才有机会彰显它的价值，不是谁能决定的”形象的道出了多数个人投资者不太关心低估值价值投资的原因：价值兑现是慢逻辑，最弱的情况在于市场可能始终不交易价值直到清算价值的出现，可能需要比较漫长的等候期。而即便参与到这些风格投资的个人投资者，可能也在价值兑现的中后段，通过排行榜的形式发现了这些产品，在价值兑现之后买入。对于这类风格，我们在投资策略上做了如下考虑：1) 基于长期表现选择基金经理，因为慢逻辑的兑现需要时间；2) 挑选 3-5 位知识背景不同的基金经理组合持有，比如制造+周期+泛消费，这样可以减少左侧的等待时间。市场的机会可能会突如其来，但正确的逻辑+正确的能力+正确的组合管理手段会有助于我们捕获这些市场机会；3) 结合收益率兑现的情况在这 3-5 位基金经理中进行一些高切低，涨的多的卖一些换到涨的少的或者亏得多的，如果这些基金经理的能力真的足以信赖的话，下跌反而是调入的时机。

3. 横空出世的黑马投资者的故事固然美丽，但我们更关注年资较久的、规模较小的、行业配置比较分散的“老”黑马基金经理。说到底，基金经理长期的投资收益来自于对市场认知的宽度、和对企业认知深度的“一横一纵”。投资是横纵坐标认知的变现，也需要时间的孵化。

接下来回顾一下我们二季度的观点和三季度的操作。在半年报中，我们评价了低估值顺周期方向、新能源、TMT、黑马消费和一带一路主题的投资机会，并阐述思路上倾向于在 7 月份做多复苏和新能源，8-9 月份重回 TMT+一带一路。回溯来看，七月份做多复苏减仓 TMT、和八月份做多一带一路（针对配置的基金）都跑出了相对收益，但在新能源和 8 月份开始的 TMT 配置上有所误判。配对的方向不再点评，具体回顾一下新能源和 TMT：新能源板块中，光伏主产业链处于景气下行阶段；海风承压于单 30、军事和航道问题处于拐点左侧；电动车在国内渗透率较高之后开始担忧空间和格局问题、对外担忧地缘政治问题，继续承压；只有汽零个股受益于智能化和机器人双重逻辑驱动表现较佳；这些问题与上半年的担忧近乎相同，说明在从一个高速成长的赛道降速到担忧格局问题的过程中，尤其伴随着减量博弈，理解市场如何给估值还是一个很难的问题。TMT 在三季度并非没有诞生新方向，只是我们加回了原有的基金。但 AI 在半年报就显现的过高的持仓、和海外应用始终没有兑现的背景下，国内资金开始担忧资本开支的延续性，尽管九月底 AI

又演绎了一波，但加仓行为整体贡献了负向超额收益。

面向四季度，宏观经济的演化依然充满了较高的风险和不确定性。从中美两国的行动和表述也可以看出，均在从早前的高度确定转换为“模棱两可”的确定，更多决策是“事后”而非“事前”：美联储不会做出中长期政策承诺，而是基于数据且走且看，这也意味着降息周期的开启更可能是一个右侧的决策，而非基于或有风险的左侧决策；中国则在不同工具箱的组合中探索地产后新的经济增长点，政策的逐步出台也是基于对市场数据的滞后观察。基于预期的左侧配置变得异常困难，因为两国政府机构的决策范式都发生了较大的变化。因此我们认为不需要对经济和海外流动性的状况提早进行过分乐观的假设，而是偏好继续以低估值为安全边际，寻找行业投资机会。当前时点，我们结合估值和基本面预期情况，倾向多做低估值顺周期（含性价比消费）、上游资源品（含黄金）、成长中的军工、信创和左侧半导体国产替代品种，同时观察增量资金来源的方向，适时调整。具体的投资细分上：

1. 低估值顺周期：影响股价的关键变量从分子端可以理解为企业的基本面情况，从分母端可以理解为无风险利率加风险溢价。向后看，尽管国内顺周期资产的复苏弹性不太确定，但复苏的方向是确定的，分子端的向上是可期的。分母端，无论美联储 24 年上半年是否开启降息周期，但年内利率维系高位是大概率的事实，叠加即便美国踏入衰退，多数非美经济体的表现可能都要弱于美国经济，分母端可能持续对长久期资产带来压制。从一年以上的维度，我们持续看好低估值顺周期类资产。至于性价比消费，参考日本即便在人口达峰之后，大众消费的升级和中高端消费的部分平替也在同时进行，高端低频次情绪性消费和低端高频次的性价比消费均有投资机会，但考虑到高端消费估值和持仓结构情况，性价比消费可能更适合投资。

2. 上游资源品：我们对资源品的跟踪并不细致，更多把细分 β 的投资让渡给做大周期择时的基金经理。长期受约束的资本开支和短期悲观的隐含需求预期意味着无论是受供给约束还是国内需求影响的大宗相关资产均有相对收益的配置价值。至于黄金，看好资源品价格上行的背景下，美元实际利率的见顶可能早于名义利率，四季度可能迎来黄金重要的配置窗口期。

3. 成长类品种：寻找高增长赛道变得越来越困难。当渗透率 5% 的时候，提升到 30% 的渗透率意味着 6 倍的增速，而在渗透率 30% 以后，即便提升到 60% 也只是一倍的预期收益。之后伴随着竞争格局的恶化和供给的出清进入到低估值价值投资的视野。当前成长类行业中还没有发现新的像新能源那样提供众多投资机会的宽赛道，更多是细分赛道的渗透率提升。结合估值和基本面预期情况，我们挑选出军工、信创和左侧的半导体国产替代品种。对于军工和信创，类计划经济的属性意味着季度的业绩只是短期的波动，而不影响中长期趋势，应有的订单迟早会兑现；对于国产替代方向，考虑到中美博弈到新阶段谈判筹码上的变化，相关方向可能会持续发酵。对于新能源

赛道，考虑到供需变化的情况，在主要观察的价值风格基金经理没有上仓位之前，我们考虑不再加减仓，而是维持当前的配置比例。

今年的电风扇的行情让投资异常困难：无论是开年对于核心资产和新能源的颠覆，还是 AI 年内的急转直下。我们也从市场的运作中收获了很多经验和教训。在当前位置，偏股公募基金过去三年的年化收益已到低位，蕴含着较高的预期收益，值得关注。再次感谢各位投资者的支持与厚爱。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）A 基金份额净值为 0.9166 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.76%；截至本报告期末嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C 基金份额净值为 0.9137 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.86%；业绩比较基准收益率为-3.39%。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	144,933,310.93	93.11
3	固定收益投资	8,913,126.16	5.73
	其中：债券	8,913,126.16	5.73
	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	1,411,581.75	0.91
8	其他资产	396,364.13	0.25
9	合计	155,654,382.97	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

无。

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

无。

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	8,913,126.16	5.74
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	8,913,126.16	5.74

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	019663	21 国债 15	87,000	8,913,126.16	5.74

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注**5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,787.03
2	应收证券清算款	316,428.90
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	72,148.20
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	396,364.13

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	005267	嘉实价值精选股票	契约型开放式	3,392,300.66	6,613,629.37	4.26	是
2	013396	华夏新能源车龙头混合发起式C	契约型开放式	7,707,394.91	6,254,550.97	4.03	否
3	003292	嘉实优势成长混合A	契约型开放式	5,509,028.44	6,153,584.77	3.96	是
4	011506	建信高端装备股票A	契约型开放式	5,615,877.44	6,105,581.95	3.93	否
5	000547	建信健康民生混合A	契约型开放式	1,095,592.75	5,797,876.83	3.73	否
6	008187	淳厚信睿C	契约型开放式	3,260,614.61	5,780,417.58	3.72	否
7	002542	长城久鼎混合A	契约型开放式	2,705,248.65	5,713,485.15	3.68	否
8	004355	嘉实丰和灵活配置混合A	契约型开放式	2,537,996.16	5,081,575.91	3.27	是
9	015947	兴业研究精选混合C	契约型开放式	4,298,009.48	4,925,948.67	3.17	否
10	000327	南方潜力新蓝筹混合A	契约型开放式	2,828,205.07	4,913,723.49	3.16	否

6.1.1 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公开募集基础设施

施证券投资基金投资明细

无。

6.1.2 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

无。

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2023年7月1日至2023年9月30日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	2,171.75	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	142,039.44	10,079.00
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	66,554.79	5,127.34
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	465,260.03	92,369.11
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	78,443.97	15,394.84
当期交易基金产生的交易费(元)	340.00	-
当期交易基金产生的转换费(元)	19,126.66	528.67

注：当期持有基金产生的应支付管理费、当期持有基金产生的应支付托管费按照被投资基金的基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，该披露金额按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金的基金合同约定的费率和计算方法计算得出。根据本基金合同的约定，本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的其他基金份额的部分不收取管理费，本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的其他基金份额的部分不收取托管费。

本基金管理人运用本基金财产申购、赎回其自身管理的其他基金（ETF除外），应当通过基金管理人的直销渠道且不得收取申购费、赎回费（按规定应当收取并计入被投资基金其他收入部分的赎回费除外）、销售服务等销售费用。相关申购费、赎回费由基金管理人直接减免，当期交易基金产生的赎回费为按规定应当收取并计入被投资基金其他收入部分的赎回费。交易及持有基金管理人所管理基金产生的应支付销售服务费为管理人当期应向本基金返还的销售服务费，相关披露金额根据本基金对被投资基金的实际持仓、被投资基金的基金合同约定的费率和方法估算。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

§7 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）A	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C
报告期期初基金份额总额	180,694,468.75	34,951,186.93
报告期期间基金总申购份额	1,230,670.22	17,032.94
减：报告期期间基金总赎回份额	46,618,446.47	745,550.67
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	135,306,692.50	34,222,669.20

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）A	嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合（FOF）C
报告期期初管理人持有的本基金份额	40,000,800.00	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	40,000,800.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

8.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	赎回	2023-07-17	10,000,800.00	9,922,793.76	-
2	赎回	2023-07-14	10,000,000.00	9,807,000.00	-
3	赎回	2023-07-13	10,000,000.00	9,900,000.00	-
4	赎回	2023-07-12	10,000,000.00	9,824,000.00	-
合计			40,000,800.00	39,453,793.76	

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的

批复文件。

- (2) 《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- (3) 《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- (4) 《嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实领航聚优积极配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 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

2023 年 10 月 24 日