

嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证  
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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

<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	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
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 .....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	46
7.11 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>50</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	51
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 .....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.8 其他重大事件 .....	56
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
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 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实方舟6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金		
基金简称	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起		
基金主代码	013411		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021年9月24日		
基金管理人	嘉实基金管理有限公司		
基金托管人	招商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	149,916,935.45份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起A	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起C	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起E
下属分级基金的交易代码	013411	013412	020367
报告期末下属分级基金的份额总额	121,239,082.18份	27,729,907.86份	947,945.41份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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>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、资产支持证券投资策略、购买信用衍生品规避个券信用风险策略。</p>
业绩比较基准	中证800指数收益率×2.5%+恒生指数收益率(人民币计价)×2.5%+中债总财富(总值)指数×80%+6个月定期存款利率(税后)×15%
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。

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	张姗
	联系电话	(010)65215588	400-61-95555
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	400-61-95555
传真		(010)65215588	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100020	518040
法定代表人		经雷	缪建民

## 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 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)		
	嘉实方舟 6 个月滚动持有 债券发起 A	嘉实方舟 6 个月滚动持有 债券发起 C	嘉实方舟 6 个月滚动持有 债券发起 E
本期已实现收益	1,558,267.77	220,385.21	13,747.68
本期利润	1,704,678.27	299,700.80	13,005.50
加权平均基金份额本期	0.0109	0.0088	0.0137

利润			
本期加权平均净值利润率	1.02%	0.83%	1.29%
本期基金份额净值增长率	1.30%	1.17%	1.30%
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	7,128,057.11	1,423,885.35	55,587.42
期末可供分配基金份额利润	0.0588	0.0513	0.0586
期末基金资产净值	130,286,564.41	29,591,875.90	1,018,543.95
期末基金份额净值	1.0746	1.0671	1.0745
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	7.46%	6.71%	1.66%

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

嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 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	-0.22%	0.09%	0.62%	0.05%	-0.84%	0.04%
过去三个月	0.78%	0.09%	1.58%	0.07%	-0.80%	0.02%
过去六个月	1.30%	0.08%	3.28%	0.08%	-1.98%	0.00%
过去一年	2.10%	0.08%	4.53%	0.07%	-2.43%	0.01%
自基金合同生效起 至今	7.46%	0.09%	10.38%	0.08%	-2.92%	0.01%

嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 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	-0.25%	0.09%	0.62%	0.05%	-0.87%	0.04%
过去三个月	0.72%	0.09%	1.58%	0.07%	-0.86%	0.02%
过去六个月	1.17%	0.08%	3.28%	0.08%	-2.11%	0.00%
过去一年	1.83%	0.08%	4.53%	0.07%	-2.70%	0.01%
自基金合同生效起 至今	6.71%	0.09%	10.38%	0.08%	-3.67%	0.01%

嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E

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	-0.22%	0.09%	0.62%	0.05%	-0.84%	0.04%
过去三个月	0.78%	0.09%	1.58%	0.07%	-0.80%	0.02%
过去六个月	1.30%	0.08%	3.28%	0.08%	-1.98%	0.00%
自基金合同生效起 至今	1.66%	0.08%	3.47%	0.08%	-1.81%	0.00%

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：

$$\text{Return}(t) = (\text{中债总财富(总值)指数}(t) / \text{中债总财富(总值)指数}(t-1) - 1) \times 80\% + ((1 + 6 \text{ 个月定期存款利率(税后)})^{(1/365) - 1}) \times 15\% + (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) \times 2.5\% + (\text{恒生指数(人民币计价)}(t) / \text{恒生指数(人民币计价)}(t-1) - 1) \times 2.5\%$$

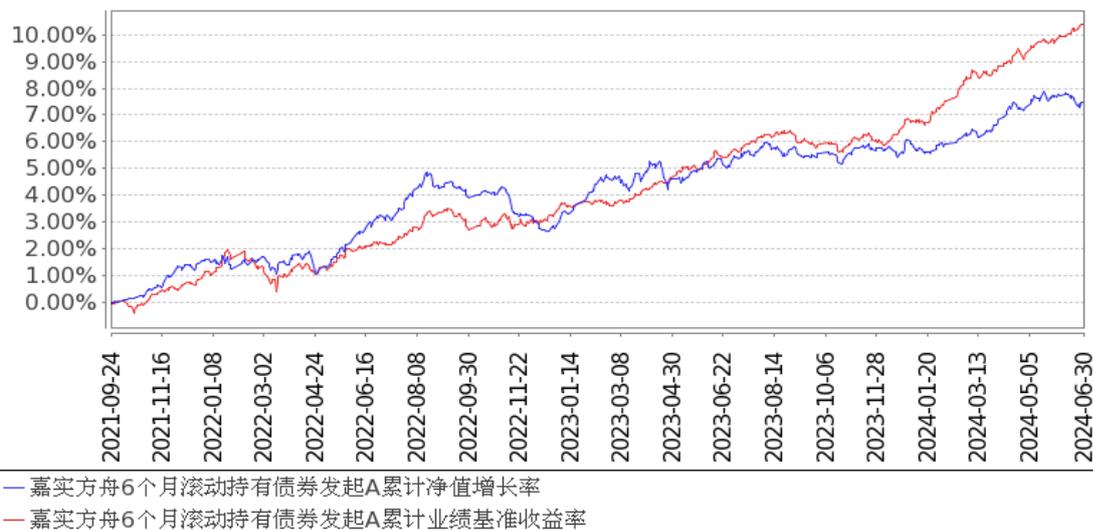
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

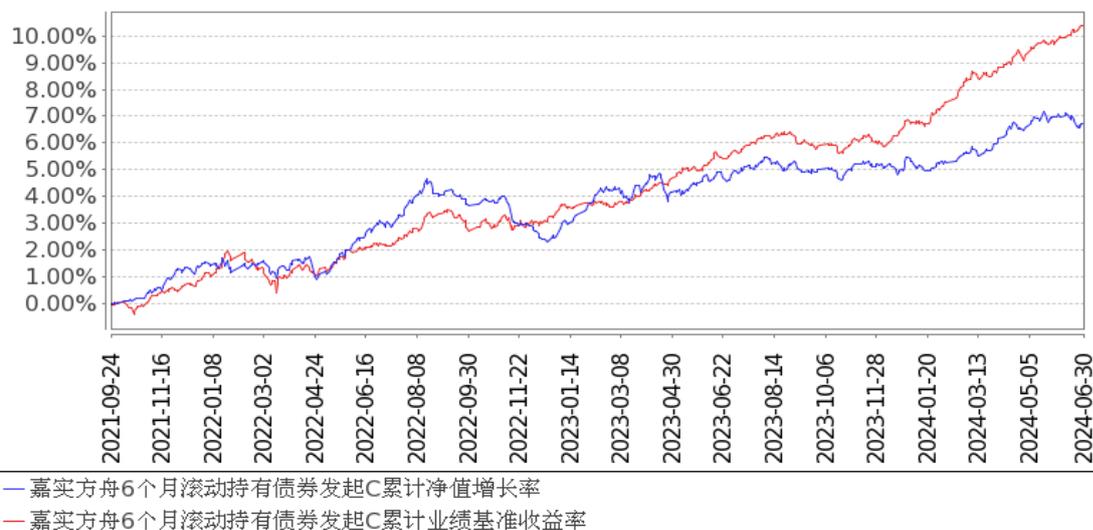
#### 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年09月24日至2024年06月30日)



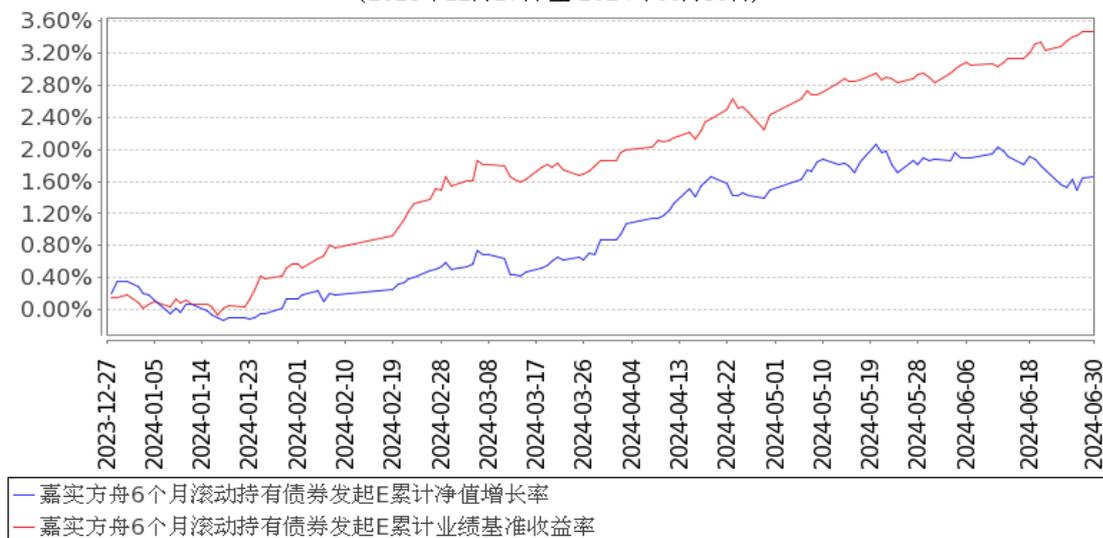
#### 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年09月24日至2024年06月30日)



### 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起E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12月27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		
顾晶菁	本基金、嘉实新添	2021年9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、

	益定期混合、嘉实方舟一年持有期混合、嘉实同舟债券基金经理				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、嘉实方舟一年持有期混合、嘉实同舟债券基金经理	2022年1月12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、嘉实新趋势混合、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、嘉实年年红一年持有债券发起式、嘉实致泰一年定开纯债	2022年10月11日	-	12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。

	债券发起式、嘉实方舟一年持有期混合、嘉实同舟债券基金经理				
--	------------------------------	--	--	--	--

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。

（3）2024 年 6 月 7 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告》，因基金经理轩璇女士休产假，本基金由现任基金经理张庆平先生和顾晶菁女士共同管理。

## 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、《嘉实方舟 6 个月滚动持有债券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

2024 年上半年，我国 GDP 同比增长 5.0%。尽管二季度 GDP 环比增速有所放缓，且同比增长速度较一季度小幅回落，但经济总量仍保持平稳提升。经济增速放缓的原因包括全球经济增长动能偏弱、地缘政治冲突对国内外需的影响，以及国内有效需求不足和居民预期偏弱等问题。基本面依然是此前趋势的延续，房地产相关产业链没有看到明显改善，5 月部分一线城市出台地产相关政策后看到了二手房成交的阶段性好转，但持续性似乎有限且成交价继续走弱。出口仍然维持了较强的趋势，尤其是以工程机械、汽车、家电等此前主要依靠内需的行业。

随着 23 年以来地产周期没有出现周期性回升，以往的辅助和领先判断的关键性指标，都先后失灵了：沪深 300 股债收益差沿着  $-2X$  标准差向下，类似日本股债收益差在 1990 年后的模式；又比如社融领先性的失效、PPI/地产投资-企业盈利周期波动收敛。

市场表现和基本面一定程度上是比较匹配的。2024 年的一季度权益市场经历了一次较为剧烈的波动。春节前中证 800、恒生指数均一度在连续三年下跌的基础上继续下跌超过 9%，而前期表现相当强的微盘股指数甚至在一个月之内下跌超过 45%，伴随场内流动性和风险偏好改善，随后市场逐渐企稳。二季度，指数反弹至关键点位后，面临机构调仓、业绩报等关键博弈窗口，资金动作偏谨慎，指数震荡走弱。4 月中下旬“新国九条”发布、地产政策预期发酵等催化下指数上行，5 月 20 日市场到达阶段性高点后再度回调，经济复苏放缓、美联储降息预期摇摆等因素成为市场回调的主要原因。2024 上半年，显著跑赢大盘的方向主要为银行、煤炭、有色及电力代表的红利板块，以及工程机械、白电、电力设备等为代表的出海分支。

债券持续走牛，2024 年上半年债市收益率持续下行，仅 4 月末出现短暂回调。一季度市场对于经济增长预期较为悲观，加上资金面宽松等因素，10 年期国债收益率一度下行至 2.23% 低点。随后央行多次提示长端利率风险，地产政策工具频出，10 年期国债收益率小幅回调后围绕 2.3% 低位窄幅震荡。6 月半年末资金面平稳，二季度经济数据有所走弱，十年利率再度向下运行突破前期低点至 2.21%。

回顾组合操作，在操作上，组合在一月份初降低了股票仓位，避免了流动性冲击下的下跌行情，随着流动性风险的解除，组合在三月份把股票和转债仓位修复到了中性偏低配置，并取得了绝对和相对的超额收益。纯债方面，组合以高等级的信用债和 5-10 年的利率债配置为主，保持一定的杠杆水平；同时积极参与利率债的波段机会。

反思我们的得失：巨大的价格波动对于我们低波固收+组合带来的挑战非常大，一方面，组合为应对波动极大的短期波动，我们以往的操作是及时降低权益敞口，这往往在股市下行时对

保护净值是有帮助，但也意味容易错失后期快速且剧烈的上涨；债券方面，1-2 月面对超长期国债的大级别行情时我们还有赔率思维，即使组合久期有抬升但是没有超配 30 年国债。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A 基金份额净值为 1.0746 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.30%；截至本报告期末嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C 基金份额净值为 1.0671 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.17%；截至本报告期末嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 基金份额净值为 1.0745 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.30%；业绩比较基准收益率为 3.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

关于长期看法，我们有如下看法：

首先，地产是过去时、高质量发展是未来时，中间过渡期的制造业扩张是现在时，而我们正处于新旧动能转换期。地产实物量相关的地产产业链、与地产投资和资产价格相关的 to G 产业链是旧动能，持续的低迷对地方财政造成了一定的影响，同时疫居民消费需求还在修复中。部分制造板块产能过剩压力短期难以缓解，以光伏为例，全行业亏损，产能严重过剩，出清仍需时间，行业具有较大的不确定性。面向未来高质量发展之际，我们要意识到：去杠杆+消化产能冗余是一个时间可以解决的问题，而且不会太久，只需静待资产价值的回归。

其次是外部环境的问题。较长时间内我们与欧美的关系都难以缓和，对此不宜抱太乐观的幻想。今年是美国大选年，外部政策形势会比以前更严峻，这点我们要有充分的认知。

最后，最近几年，经济政策、产业政策、行业政策对地方政府和企业经营状态的影响程度有明显的提升。我们的研究要跳出以往的研究框架，从具体哪些落地的政策会更有效的角度出发。从社会的运行机制多分析相关方行为逻辑，如何自发的解决问题，哪些政策真正意义上解决一些长期存在问题。

落实到组合上，整体上我们认为风格大体会延续，依然是结构性行情，而且结构都是相似的。不确定性上升、低风险的环境下，市场关注点将从过去对未来边际增量定价、转为对存量资产的盈利能力及其稳定性定价，这当中仍存在估值轧差进一步修复的空间。

债券维度，展望后市，应更为关注央行货币政策实操、政府债供给、权益市场的边际变化以及经济高质量发展进程中超预期修复等因素多重共振，重点关注央行操作，感知经济温度。利率低波动环境下，研究应该做到更精细化，在市场底层逻辑发生变化时应跟踪更为紧密。

整体组合层面做好情景分析，当出现机会时敢于加仓。

展望长期，我国在经济发展新阶段，既有逆周期政策托底经济，也有长期政策推动结构转

型促进高质量发展。本基金投资团队将持续强化对资产和策略两层次的深度研究，及时迭代对宏观经济、产业政策、仓位管理等认知框架，努力为投资人交付更好的业绩。

#### 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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用。

## § 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不

存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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：嘉实方舟6个月滚动持有债券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
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	1,018,599.94	6,174,224.51
结算备付金		1,549,982.07	3,700,208.63
存出保证金		11,808.18	18,174.33
交易性金融资产	6.4.7.2	185,526,551.04	376,488,975.15
其中：股票投资		13,998,478.15	12,818,015.87
基金投资		-	-
债券投资		171,528,072.89	363,670,959.28
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		994,455.52	392,776.74
应收股利		-	-
应收申购款		4,126.09	13,332.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		189,105,522.84	386,787,692.30
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		27,893,620.63	88,582,068.32

应付清算款		-	-
应付赎回款		24,804.70	31,180.27
应付管理人报酬		79,749.80	150,779.25
应付托管费		19,937.43	37,694.79
应付销售服务费		6,098.94	11,984.68
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,875.53	28,044.50
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	168,451.55	199,918.88
负债合计		28,208,538.58	89,041,670.69
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	149,916,935.45	280,993,641.48
未分配利润	6.4.7.12	10,980,048.81	16,752,380.13
净资产合计		160,896,984.26	297,746,021.61
负债和净资产总计		189,105,522.84	386,787,692.30

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A 基金份额净值 1.0746 元，基金份额总额 121,239,082.18 份，嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C 基金份额净值 1.0671 元，基金份额总额 27,729,907.86 份，嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 基金份额净值 1.0745 元，基金份额总额 947,945.41 份，基金份额总额合计为 149,916,935.45 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实方舟 6 个月滚动持有债券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
<b>一、营业总收入</b>		3,409,994.13	20,458,145.03
1. 利息收入		21,893.29	59,714.06
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,893.29	48,246.87
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		-	11,467.19
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,163,116.93	14,118,099.74
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,414,174.52	4,050,633.63
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.15	4,375,567.00	10,067,752.58
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-22,862.42	-115,622.40
股利收益	6.4.7.19	224,586.87	115,335.93
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	224,983.91	6,280,331.23
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		1,392,609.56	3,328,260.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	612,018.94	1,641,684.47
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	153,004.76	410,421.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	44,881.00	119,861.49
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		451,192.62	1,019,520.98
其中：卖出回购金融资产 支出		451,192.62	1,019,520.98
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		10,915.71	33,419.10
8. 其他费用	6.4.7.23	120,596.53	103,353.60
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		2,017,384.57	17,129,884.23
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		2,017,384.57	17,129,884.23
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		2,017,384.57	17,129,884.23

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实方舟6个月滚动持有债券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	280,993,641.48	-	16,752,380.13	297,746,021.61

二、本期期初净资产	280,993,641.48	-	16,752,380.13	297,746,021.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-131,076,706.03	-	-5,772,331.32	-136,849,037.35
(一)、综合收益总额	-	-	2,017,384.57	2,017,384.57
(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)	-131,076,706.03	-	-7,789,715.89	-138,866,421.92
其中：1. 基金申购款	6,431,013.89	-	413,164.51	6,844,178.40
2. 基金赎回款	-137,507,719.92	-	-8,202,880.40	-145,710,600.32
(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	149,916,935.45	-	10,980,048.81	160,896,984.26
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	877,010,922.18	-	24,477,818.14	901,488,740.32
二、本期期初净资产	877,010,922.18	-	24,477,818.14	901,488,740.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-498,209,317.09	-	-4,888,001.63	-503,097,318.72
(一)、综合收益总额	-	-	17,129,884.23	17,129,884.23
(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)	-498,209,317.09	-	-22,017,885.86	-520,227,202.95
其中：1. 基金申购款	84,806,695.66	-	3,940,249.09	88,746,944.75

2. 基金赎回款	-583,016,012.75	-	-25,958,134.95	-608,974,147.70
(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	378,801,605.09	-	19,589,816.51	398,391,421.60

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

嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2021]2612 号《关于准予嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于 2021 年 9 月 1 日至 2021 年 9 月 22 日向社会公开募集，基金合同于 2021 年 9 月 24 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 122,528,213.56 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《关于嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金增加 E 类基金份额并修改基金合同部分条款的公告》，为满足基金投资者的需求，为投资者提供多样化的投资途径，本基金管理人经与本基金托管人协商一致，决定于 2023 年 12 月 27 日起对本基金增加 E 类基金份额，并对本基金的基金合同及相关法律文件做相应修改。

### 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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办

法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 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	1,018,599.94
等于：本金	1,018,503.40
加：应计利息	96.54
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	1,018,599.94

## 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		14,548,893.76	-	13,998,478.15	-550,415.61
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	44,331,201.72	429,644.00	44,581,717.77	-179,127.95
	银行间市场	124,308,984.50	1,693,205.12	126,946,355.12	944,165.50
	合计	168,640,186.22	2,122,849.12	171,528,072.89	765,037.55
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		183,189,079.98	2,122,849.12	185,526,551.04	214,621.94

## 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

无。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 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	33,916.19
其中：交易所市场	22,965.19
银行间市场	10,951.00
应付利息	-
预提费用	134,535.36
合计	168,451.55

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 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	226,408,453.33	226,408,453.33
本期申购	5,594,434.88	5,594,434.88
本期赎回（以“-”号填列）	-110,763,806.03	-110,763,806.03
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	121,239,082.18	121,239,082.18

## 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起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	53,639,114.36	53,639,114.36
本期申购	834,707.39	834,707.39
本期赎回(以“-”号填列)	-26,743,913.89	-26,743,913.89
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	27,729,907.86	27,729,907.86

## 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起E

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	946,073.79	946,073.79
本期申购	1,871.62	1,871.62
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
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	947,945.41	947,945.41

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

## 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,997,070.08	3,760,711.95	13,757,782.03
本期期初	9,997,070.08	3,760,711.95	13,757,782.03
本期利润	1,558,267.77	146,410.50	1,704,678.27
本期基金份额交易产生的变动数	-4,427,280.74	-1,987,697.33	-6,414,978.07
其中：基金申购款	243,857.89	116,159.38	360,017.27

基金赎回款	-4,671,138.63	-2,103,856.71	-6,774,995.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,128,057.11	1,919,425.12	9,047,482.23

## 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,048,672.74	888,460.70	2,937,133.44
本期期初	2,048,672.74	888,460.70	2,937,133.44
本期利润	220,385.21	79,315.59	299,700.80
本期基金份额交易产生的变动数	-845,172.60	-529,693.60	-1,374,866.20
其中：基金申购款	35,817.09	17,201.77	53,018.86
基金赎回款	-880,989.69	-546,895.37	-1,427,885.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,423,885.35	438,082.69	1,861,968.04

## 嘉实方舟6个月滚动持有债券发起E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,750.45	15,714.21	57,464.66
本期期初	41,750.45	15,714.21	57,464.66
本期利润	13,747.68	-742.18	13,005.50
本期基金份额交易产生的变动数	89.29	39.09	128.38
其中：基金申购款	89.29	39.09	128.38
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	55,587.42	15,011.12	70,598.54

## 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	4,156.89
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	17,642.69
其他	93.71
合计	21,893.29

## 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	-1,414,174.52
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	-1,414,174.52

#### 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	28,850,481.81
减：卖出股票成本总额	30,206,605.67
减：交易费用	58,050.66
买卖股票差价收入	-1,414,174.52

#### 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	4,137,433.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	238,133.64
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	4,375,567.00

##### 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	391,444,103.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	385,242,634.67
减：应计利息总额	5,953,816.69
减：交易费用	9,518.73
买卖债券差价收入	238,133.64

##### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-22,862.42

## 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	224,586.87

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	224,586.87

#### 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	224,983.91
股票投资	20,645.18
债券投资	204,338.73
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
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	224,983.91

#### 6.4.7.21 其他收入

无。

#### 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	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	17,461.17
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	120,596.53

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

#### 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 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管理费	612,018.94	1,641,684.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	153,415.31	520,267.80
应支付基金管理人的净管理费	458,603.63	1,121,416.67

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 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	153,004.76	410,421.16

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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×0.15%/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			
	嘉实方舟 6 个月 滚动持有债券发 起 A	嘉实方舟 6 个月 滚动持有债券发 起 C	嘉实方舟 6 个月 滚动持有债券发 起 E	合计
嘉实基金管理有限 公司	-	18,482.33	50.15	18,532.48
招商银行	-	95.68	-	95.68
嘉实财富	-	67.34	-	67.34
合计	-	18,645.35	50.15	18,695.50
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			
	嘉实方舟 6 个月 滚动持有债券发 起 A	嘉实方舟 6 个月 滚动持有债券发 起 C	嘉实方舟 6 个月 滚动持有债券发 起 E	合计
嘉实基金管理有限 公司	-	47,326.08	-	47,326.08
招商银行	-	641.13	-	641.13
嘉实财富	-	65.68	-	65.68
合计	-	48,032.89	-	48,032.89

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，本基金 E 类基金份额的销售服务费

年费率为0.16%，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：各类别基金日销售服务费=各类别基金份额前一日基金资产净值×各类别基金份额适用的销售服务费率/当年天数。

(2) 本基金A类基金份额不收取销售服务费。

(3) 根据《关于嘉实方舟6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金E类基金份额销售服务费优惠活动的公告》，自2023年12月27日起，销售服务费率由0.16%变更为0.01%。

#### 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

单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
招商银行股份有限公司	-	-	-	-	178,000,000.00	16,031.74
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日
		嘉实方舟6个月滚动持有债券发起A	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起C
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-	-
报告期间申购/买入	-	-	-

总份额			
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	8.25%	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	上年度可比期间 -
	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起A	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起C	嘉实方舟6个月滚动持有债券发起E
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.21%	-	-

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。

#### 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
招商银行股份有限公司_活期	1,018,599.94	4,156.89	456,433.19	10,004.58

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,193,620.63 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210017	21 付息国债 17	2024 年 7 月 1 日	105.48	155,000	16,348,709.24
合计				155,000	16,348,709.24

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 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 12,700,000.00 元，于 2024 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 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、risk 管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	18,831,541.30	43,864,471.75
合计	18,831,541.30	43,864,471.75

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	65,920,894.89	159,497,471.10
AAA 以下	9,899,125.90	36,943,410.02
未评级	76,876,510.80	123,365,606.41
合计	152,696,531.59	319,806,487.53

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

**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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出

回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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	1,018,599.94	-	-	-	1,018,599.94
结算备付金	1,549,982.07	-	-	-	1,549,982.07
存出保证金	11,808.18	-	-	-	11,808.18
交易性金融资产	88,955,633.28	32,471,377.56	50,101,062.05	13,998,478.15	185,526,551.04
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	994,455.52	994,455.52
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,126.09	4,126.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	91,536,023.47	32,471,377.56	50,101,062.05	14,997,059.76	189,105,522.84
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	27,893,620.63	-	-	-	27,893,620.63
应付清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	24,804.70	24,804.70
应付管理人报酬	-	-	-	79,749.80	79,749.80
应付托管费	-	-	-	19,937.43	19,937.43
应付销售服务费	-	-	-	6,098.94	6,098.94
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	15,875.53	15,875.53
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	168,451.55	168,451.55
负债总计	27,893,620.63	-	-	314,917.95	28,208,538.58
利率敏感度缺口	63,642,402.84	32,471,377.56	50,101,062.05	14,682,141.81	160,896,984.26
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	6,174,224.51	-	-	-	6,174,224.51
结算备付金	3,700,208.63	-	-	-	3,700,208.63
存出保证金	18,174.33	-	-	-	18,174.33
交易性金融资产	194,425,828.13	117,162,716.38	52,082,414.77	12,818,015.87	376,488,975.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	392,776.74	392,776.74
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,332.94	13,332.94
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	204,318,435.60	117,162,716.38	52,082,414.77	13,224,125.55	386,787,692.30
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	88,582,068.32	-	-	-	88,582,068.32
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	31,180.27	31,180.27
应付管理人报酬	-	-	-	150,779.25	150,779.25
应付托管费	-	-	-	37,694.79	37,694.79
应付销售服务费	-	-	-	11,984.68	11,984.68
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	28,044.50	28,044.50
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	199,918.88	199,918.88
负债总计	88,582,068.32	-	-	459,602.37	89,041,670.69
利率敏感度缺口	115,736,367.28	117,162,716.38	52,082,414.77	12,764,523.18	297,746,021.61

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	-862,332.13	-1,751,314.67
	市场利率下降 25 个基点	874,672.70	1,772,997.60

#### 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和负债，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汇头寸进行监控。

##### 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）	
		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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资

于上市交易的证券，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。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

#### 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	13,998,478.15	8.70	12,818,015.87	4.31
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	13,998,478.15	8.70	12,818,015.87	4.31

#### 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（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%	3,771,371.93	11,808,659.96
	业绩比较基准下降5%	-3,771,371.93	-11,808,659.96

#### 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	19,502,657.80	40,780,423.29
第二层次	166,023,893.24	335,708,551.86
第三层次	-	-
合计	185,526,551.04	376,488,975.15

##### 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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 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	13,998,478.15	7.40
	其中：股票	13,998,478.15	7.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	171,528,072.89	90.70
	其中：债券	171,528,072.89	90.70
	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	2,568,582.01	1.36
8	其他各项资产	1,010,389.79	0.53
9	合计	189,105,522.84	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	-	-
B	采矿业	3,095,012.00	1.92
C	制造业	9,239,994.15	5.74
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	860,000.00	0.53
J	金融业	803,472.00	0.50
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	13,998,478.15	8.70

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	600941	中国移动	8,000	860,000.00	0.53
2	601166	兴业银行	45,600	803,472.00	0.50
3	600426	华鲁恒升	29,559	787,451.76	0.49
4	601899	紫金矿业	42,500	746,725.00	0.46
5	688122	西部超导	19,468	746,013.76	0.46
6	301031	中熔电气	8,900	731,580.00	0.45
7	600547	山东黄金	26,000	711,880.00	0.44
8	300855	图南股份	26,600	703,304.00	0.44
9	600765	中航重机	34,100	695,640.00	0.43
10	600862	中航高科	36,800	691,104.00	0.43
11	600309	万华化学	8,400	679,224.00	0.42
12	000683	远兴能源	97,800	675,798.00	0.42
13	000960	锡业股份	42,600	659,874.00	0.41
14	688326	经纬恒润	11,321	649,032.93	0.40
15	603662	柯力传感	27,600	644,184.00	0.40
16	000975	银泰黄金	37,700	614,133.00	0.38
17	002182	宝武镁业	50,540	570,091.20	0.35
18	688610	埃科光电	15,550	522,946.50	0.33
19	601225	陕西煤业	20,200	520,554.00	0.32
20	600489	中金黄金	33,900	501,720.00	0.31
21	000333	美的集团	7,500	483,750.00	0.30

## 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	600547	山东黄金	2,014,125.00	0.68
2	601088	中国神华	1,675,120.00	0.56
3	601225	陕西煤业	1,389,499.00	0.47
4	601098	中南传媒	1,378,289.00	0.46
5	600919	江苏银行	1,376,648.00	0.46
6	000975	银泰黄金	1,181,405.00	0.40
7	600426	华鲁恒升	1,170,346.56	0.39
8	600750	江中药业	1,133,339.00	0.38
9	600941	中国移动	1,048,983.00	0.35
10	601918	新集能源	919,832.00	0.31

11	601288	农业银行	915,920.00	0.31
12	600674	川投能源	914,969.00	0.31
13	601857	中国石油	914,573.00	0.31
14	600905	三峡能源	896,836.00	0.30
15	600309	万华化学	862,204.00	0.29
16	603878	武进不锈	834,349.80	0.28
17	002155	湖南黄金	833,325.00	0.28
18	301031	中熔电气	817,090.00	0.27
19	603662	柯力传感	780,574.00	0.26
20	000683	远兴能源	775,303.00	0.26

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	601088	中国神华	1,734,381.00	0.58
2	601288	农业银行	1,537,596.00	0.52
3	600919	江苏银行	1,398,033.00	0.47
4	600547	山东黄金	1,393,754.00	0.47
5	601098	中南传媒	1,317,019.00	0.44
6	600750	江中药业	1,269,394.00	0.43
7	600941	中国移动	1,125,244.00	0.38
8	601918	新集能源	1,017,742.00	0.34
9	601857	中国石油	1,007,734.00	0.34
10	600674	川投能源	923,124.00	0.31
11	002155	湖南黄金	896,411.00	0.30
12	600905	三峡能源	852,240.00	0.29
13	601225	陕西煤业	827,548.00	0.28
14	300750	宁德时代	824,182.20	0.28
15	603606	东方电缆	816,034.00	0.27
16	000960	锡业股份	718,301.00	0.24
17	301017	漱玉平民	715,697.00	0.24
18	002182	宝武镁业	703,612.32	0.24
19	002315	焦点科技	675,946.00	0.23
20	000975	银泰黄金	670,430.00	0.23

#### 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	31,366,422.77
卖出股票收入（成交）总额	28,850,481.81

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	45,144,648.16	28.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	13,375,317.48	8.31
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	45,003,977.05	27.97
5	企业短期融资券	10,412,637.71	6.47
6	中期票据	52,087,312.84	32.37
7	可转债（可交换债）	5,504,179.65	3.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	171,528,072.89	106.61

## 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	210017	21 付息国债 17	250,000	26,368,885.87	16.39
2	149720	21 克投 01	150,000	15,374,981.92	9.56
3	200006	20 付息国债 06	100,000	10,356,858.70	6.44
4	102101634	21 吉林高速 MTN002	100,000	10,356,451.37	6.44
5	102103099	21 鲁高速 MTN008	100,000	10,251,581.42	6.37

## 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

本期国债期货操作主要通过国开债与国债期货配合交易，并在国开置换中起到了对冲作用，另外在市场波动的情形下，通过国债期货的套保把握了波段机会。

## 7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

## 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，中国民生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。

### 7.11.2 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	11,808.18
2	应收清算款	994,455.52
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,126.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,010,389.79

### 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	113052	兴业转债	814,879.06	0.51
2	127085	韵达转债	792,617.20	0.49
3	110087	天业转债	540,303.98	0.34
4	113605	大参转债	524,983.03	0.33
5	127018	本钢转债	486,475.83	0.30
6	128128	齐翔转 2	481,929.46	0.30
7	113670	金 23 转债	452,224.45	0.28
8	118024	冠宇转债	370,630.43	0.23
9	127035	濮耐转债	324,727.62	0.20
10	110089	兴发转债	256,224.21	0.16
11	113655	欧 22 转债	243,026.20	0.15
12	127052	西子转债	212,466.78	0.13
13	127064	杭氧转债	3,691.40	0.00

### 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 (%)
嘉实方舟 6 个月滚 动持有债 券发起 A	384,194	315.57	34,803,462.03	28.71	86,435,620.15	71.29
嘉实方舟 6 个月滚 动持有债 券发起 C	2,960	9,368.21	500,000.00	1.80	27,229,907.86	98.20
嘉实方舟 6 个月滚 动持有债 券发起 E	3	315,981.80	946,073.79	99.80	1,871.62	0.20
合计	387,090	387.29	36,249,535.82	24.18	113,667,399.63	75.82

注：(1)嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 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方舟 6 个月滚动持有债券发起 A 份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A 份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A 总份额比例；

(2)嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 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方舟 6 个月滚动持有债券发起 C 份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C 份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C 总份额比例；

(3)嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E: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方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 总份额比例、个人投资者持有嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 总份额比例；

份额占嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E 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	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A	580,245.52	0.48
	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C	187,174.03	0.67
	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E	-	-
	合计	767,419.55	0.51

## 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	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A	0
	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C	0~10
	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 A	50~100
	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 C	0
	嘉实方舟 6 个月滚动持有债券发起 E	0
	合计	50~100

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	6.67	10,000,000.00	6.67	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-

合计	10,000,000.00	6.67	10,000,000.00	6.67	3 年
----	---------------	------	---------------	------	-----

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实方舟 6 个月滚动持有 债券发起 A	嘉实方舟 6 个月滚动持有 债券发起 C	嘉实方舟 6 个月滚动持有 债券发起 E
基金合同生效日（2021 年 9 月 24 日）基金份额总额	69,076,422.94	53,451,790.62	-
本报告期期初基金份额总额	226,408,453.33	53,639,114.36	946,073.79
本报告期基金总申购份额	5,594,434.88	834,707.39	1,871.62
减：本报告期基金总赎回份额	110,763,806.03	26,743,913.89	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	121,239,082.18	27,729,907.86	947,945.41

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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，会计师事务所为安永华明会计师事务所（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没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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 (%)	
中信建投证券股份有限公司	2	25,365,801.37	42.12	16,382.86	41.20	-
中国国际金融股份有限公司	1	15,655,888.79	26.00	10,959.09	27.56	-
方正证券股份有限公司	2	7,639,122.58	12.69	4,933.89	12.41	-
华创证券有限责任公司	2	5,056,290.82	8.40	3,265.75	8.21	-
国盛证券有限责任公司	4	3,001,438.33	4.98	1,938.55	4.88	-
长江证券股份有限公司	2	2,297,752.69	3.82	1,484.52	3.73	-
国投证券股份有限公司	2	817,090.00	1.36	527.80	1.33	-
中信证券股份有限公司	2	383,520.00	0.64	268.43	0.68	-

财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国融证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
南京证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
上海证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限	1	-	-	-	-	-

公司						
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 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，本基金退租以下交易单元：中国中金财富证券有限公司退租交易单元 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(%)
中信建投证券股份有限公司	32,863,816.53	29.35	472,409,000.00	30.31	-	-
中国国际金融股份有限公司	28,065,395.99	25.06	218,690,000.00	14.03	-	-

方正证券股份有限公司	2,924,689.18	2.61	75,221,000.00	4.83	-	-
华创证券有限责任公司	12,793,296.44	11.43	174,200,000.00	11.18	-	-
国盛证券有限责任公司	12,048,915.33	10.76	67,630,000.00	4.34	-	-
长江证券股份有限公司	709,903.01	0.63	120,691,000.00	7.74	-	-
国投证券股份有限公司	138,087.80	0.12	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	9,313,671.50	8.32	273,053,000.00	17.52	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国融证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	365,972.51	0.33	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
南京证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
上海证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

五矿证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 限公司	12,748,740. 72	11.39	156,802,000. 00	10.06	-	-
中银国 际证券 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关于调整旗下部分基金最低赎回份额、最低保有份额的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年4月3日
2	嘉实基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年6月7日
3	关于嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金 E 类基金份额开放日常赎回、转换转出业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024年6月25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 2024-03-17	100,371,077.64	-	76,503,789.34	23,867,288.30	15.92
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。</p>							

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实方舟 6 个月滚动持有债券型发起式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) 报告期内嘉实方舟 6 个月滚动持有债券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