

嘉实绝对收益策略定期开放混合型发起式
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 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	12
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	13
§ 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（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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	55
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	56
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	56
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	56
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12	市场中性策略执行情况	56
7.13	投资组合报告附注	56
§ 8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况	58
§ 9	开放式基金份额变动	58
§ 10	重大事件揭示	59
10.1	基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4	基金投资策略的改变	59
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	60
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8	其他重大事件	70
§ 11	备查文件目录	70
11.1	备查文件目录	70
11.2	存放地点	70
11.3	查阅方式	70

§ 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	184,319,481.04 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	183,936,931.22 份	382,549.82 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(2023 年 1 月 1 日-2023 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	-7,170,742.49	-10,872.08	
本期利润	480,524.97	732.91	
加权平均基金份 额本期利润	0.0020	0.0019	
本期加权平均净 值利润率	0.15%	0.14%	
本期基金份额净 值增长率	0.29%	0.15%	
3.1.2 期末数据 和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)		
	期末可供分配利 润	63,770,401.79	129,196.12
	期末可供分配基 金份额利润	0.3467	0.3377
	期末基金资产净	252,623,126.94	521,843.20

值		
期末基金份额净值	1.373	1.364
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	37.30%	-4.75%

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	0.88%	0.14%	0.12%	0.00%	0.76%	0.14%
过去三个月	0.96%	0.16%	0.37%	0.00%	0.59%	0.16%
过去六个月	0.29%	0.17%	0.74%	0.01%	-0.45%	0.16%
过去一年	-2.69%	0.20%	1.50%	0.00%	-4.19%	0.20%
过去三年	7.43%	0.28%	4.57%	0.00%	2.86%	0.28%
自基金合同生效起至今	37.30%	0.26%	17.82%	0.01%	19.48%	0.25%

嘉实绝对收益策略定期混合 C

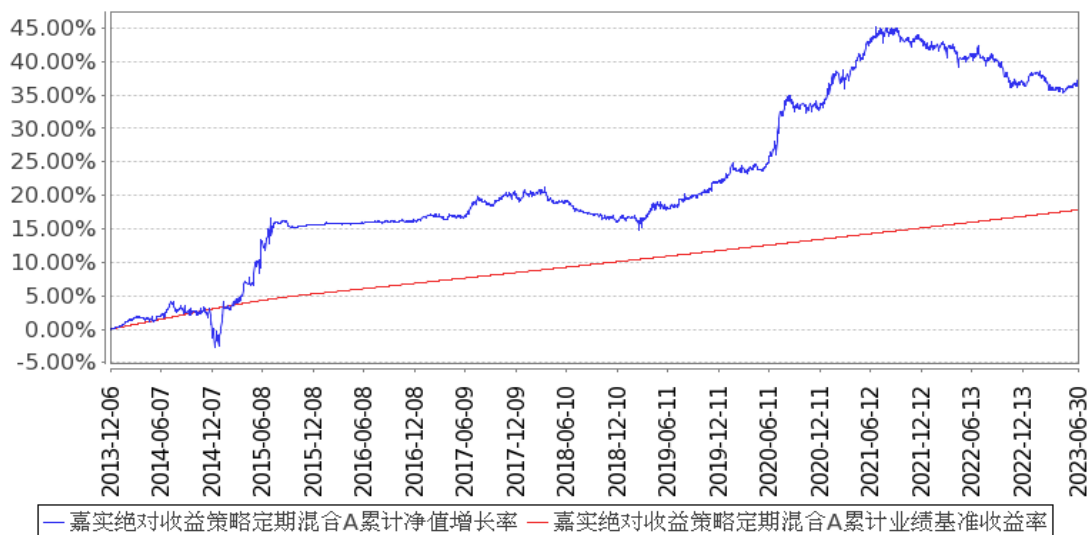
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.81%	0.14%	0.12%	0.00%	0.69%	0.14%
过去三个月	0.89%	0.16%	0.37%	0.00%	0.52%	0.16%
过去六个月	0.15%	0.16%	0.74%	0.01%	-0.59%	0.15%
过去一年	-3.13%	0.20%	1.50%	0.00%	-4.63%	0.20%
自基金合同生效起	-4.75%	0.23%	2.33%	0.00%	-7.08%	0.23%

至今						
----	--	--	--	--	--	--

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2023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2023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2023年6月30日，基金管理人共管理314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	-	11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	488,490,998.81	2018年9月20日
	私募资产管理计划	2	349,545,421.42	2022年11月21日
	其他组合	1	415,786,327.85	2021年11月12日
	合计	6	1,253,822,748.08	-

注：1. “任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2. 报告期内，金猛管理的1只公募基金已于2023年6月5日终止。

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 6 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

A 股市场在震荡与分化中结束了 2023 年上半年的行情。主要指数在一月份延续上涨状态后，整体进入横盘整理，截至半年末以上证指数为例小幅上涨 3.65%，白马蓝筹相对跑输的环境中沪深 300 指数微跌 0.75% 而中证 500 指数微涨 2.29%。除权益市场外，债券、商品等大类资产也开始同步反映衰退预期，人民币汇率也在海内外货币政策走向的分化下承受了较大压力。

权益市场内部的结构分化体现在主题和市值风格上。宏观经济复苏迟迟未能确认的情况下资金持续涌入局部热点，推动中特估、泛人工智能等部分主题板块一度创下新高。另一方面是中小市值公司在群体特征上略好于大市值公司，且市值风格的焦点体现在核心资产之外的微盘股中：在三月末至四月中下旬出现一轮超过 10% 的回撤后，代表市场中市值最小的一批公司的微盘股指数在后续再度创下新高。其他风格方面，高成长、高估值板块表现不佳，整体上延续了 2022 年以来的弱势。创业板指数下跌 5.6%，而科创 50 指数虽然年内累计涨幅仍有 4.7%，在二季度也承受了超过 7% 的跌幅。行业方面，TMT 方向聚焦至光模块主题，以其为代表的通信行业一枝独秀；而

对宏观经济敏感度较高的商贸零售、房地产、建筑材料和美容护理等行业则表现靠后。

市场表现的宏观底层逻辑则是整体经济偏弱预期与产业趋势利好的叠加。从整个上半年的节奏来看宏观经济呈现先上后下的特征：一季度经济活动正常化后市场对短期复苏有强烈的乐观态度，而消费场景的修复也巩固了这一预期；进入二季度后发现经济复苏并非一蹴而就，市场主体信息的回复仍需时间，反而进入了被动去库存的阶段。从 PMI 指标的先爬升后下行也可以较为直接的观察到这个先上后下的过程。此间叠加全球需求有所减弱和市场中流动性的合理充裕，国内资本市场整体进入了博弈交易的节奏当中。而产业趋势方面人工智能等技术突破成为市场的关注焦点，吸引了大量的资金从传统的核心资产中退出并加入到热点主题中，进一步拉大了 A 股市场内部的表现分化程度。二季度中的另一个短期关注点是汇率，由于没有出现明显的企稳现象，抑制了海外资金通过北向等窗口进入国内资本市场的动力，也因此虽然许多优质的高景气公司在业绩持续上行的同时估值还在进一步走低，但依旧出现了长期配置资金缺口的现象。

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 1.373 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.29%；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 1.364 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.15%；业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年下半年需要在宏观研判上重点关注政策上的边际变化，并以此为基础确定资产配置与行业配置策略。在企业端去库存过程仍未结束、居民资产负债表修复必要性逐渐提升的背景下，我们预期逆周期调节政策将重新发力，在下半年出现原本预期在上半年实现的温和复苏和优质企业盈利企稳。在估值层面，投资者的负面情绪在 2 季度已经获得了充分反映，导致主要指数的估值水平基本匹配一个更为悲观的格局，权益资产出现了非常积极的长期配置价值。预期并在逐步推进中改善市场中的投资者预期。

对于市场结构的展望需要基于对总量数据的高频跟踪给出结论。前瞻的来看，弱复苏但缺乏足够的宏观弹性下，更有可能出现的场景还是已经跌出投资价值的一部分优质企业伴随着基本面企稳和风险偏好回升展开反弹，高 Beta 的顺周期方向难以在直接出现大级别的行情。若经济复苏的到来慢于预期，在确认拐点之前市场将仍然呈现“价值搭台+成长唱戏”，除了能够持续维持高景

气、高增速的细分方向能够获得资金流入外，以人工智能为标杆的主题板块依然还会是博弈资金来回交易的方向。无论是哪种场景，A 股整体的企稳后的市场在下半年将依然以指数区间震荡，板块结构性机会为主要特征。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	30,896,756.12	20,150,217.62
结算备付金		46,177,943.46	113,499,768.97
存出保证金		17,487,488.28	22,768,575.42
交易性金融资产	6.4.7.2	159,554,493.76	250,825,556.46
其中：股票投资		158,079,890.82	218,440,270.99
基金投资		-	-
债券投资		1,474,602.94	32,385,285.47
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		34,206.82	71,900.77
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		254,150,888.44	407,316,019.24
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		448,016.10	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		219,669.89	391,146.20
应付托管费		54,917.46	97,786.58
应付销售服务费		170.89	102.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31,453.95	1.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	251,690.01	527,183.76
负债合计		1,005,918.30	1,016,219.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	184,319,481.04	296,860,901.69
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	68,825,489.10	109,438,897.67
净资产合计		253,144,970.14	406,299,799.36
负债和净资产总计		254,150,888.44	407,316,019.24

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，嘉实绝对收益策略定期混合 A 基金份额净值（暂估附加管理费前）1.373 元，基金份额总额 183,936,931.22 份，基金净资产（暂估附加管理费前）252,623,126.94 元；嘉实绝对收益策略定期混合 C 基金份额净值（暂估附加管理费前）1.364 元，基金份额总额 382,549.82 份，基金净资产（暂估附加管理费前）521,843.20 元，基金份额总额合计为 184,319,481.04 份，基金净资产（暂估附加管理费前）合计为 253,144,970.14 元。2023 年上半年，利润表未体现嘉实绝对收益策略定期混合 A 基金暂估附加管理费金额为 0.00 元（2022 年度：0.00 元），未体现嘉实绝对收益策略定期混合 C 基金暂估附加管理费金额为 0.00 元（2022 年度：0.00 元）。于 2023 年 06 月 30 日，嘉实绝对收益策略定期混合 A 基金相关暂估附加管理费余额为 0.00 元（2022 年 12 月 31 日：0.00 元），基金净资产（暂估附加管理费后）252,623,126.94 元，嘉实绝对收益策略定期混合 C 基金相关暂估附加管理费余额为 0.00 元（2022 年 12 月 31 日：0.00 元），基金净资产（暂估附加管理费后）521,843.20 元。该暂估附加管理费余额是各基金份额持有人于期末时点的暂估附加管理费的合计，各基金份额持有人实际应承担的附加管理费金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估附加管理费金额存在差异。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,669,151.68	-10,703,220.40
1. 利息收入		515,754.47	1,938,754.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	493,926.86	1,829,963.11
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	108,791.68
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,608,529.60	46,660,493.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,484,954.31	-140,772,914.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	54,483.96	5,747,730.05
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	893,352.42	175,497,287.21
股利收益	6.4.7.19	1,928,588.33	6,188,390.19
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	7,662,872.45	-60,202,132.11
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	99,054.36	899,663.83
减：二、营业总支出		2,187,893.80	10,185,187.19
1. 管理人报酬		1,647,587.06	7,553,394.93
2. 托管费		411,896.71	1,888,348.73
3. 销售服务费		1,036.97	61.35
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		3,370.98	635,056.04

8. 其他费用	6. 4. 7. 23	124,002.08	108,326.14
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		481,257.88	-20,888,407.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		481,257.88	-20,888,407.59
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		481,257.88	-20,888,407.59

6.3 净资产（基金净值）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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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(基金净值)	296,860,901.69	-	109,438,897.67	406,299,799.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	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	-112,541,420.65	-	-41,094,666.45	-153,636,087.10

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
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基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	184,319,481.04	-	68,825,489.10	253,144,970.14
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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（基金净值）	1,271,757,242.44	-	544,055,598.53	1,815,812,840.97
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	1,271,757,242.44	-	544,055,598.53	1,815,812,840.97
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-576,394,242.78	-	-257,924,046.32	-834,318,289.10
(一)、综合收益总额	-	-	-20,888,407.59	-20,888,407.59
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-576,394,242.78	-	-237,035,638.73	-813,429,881.51
其中:1.基金申购款	4,410,333.67	-	1,813,512.73	6,223,846.40
2.基金赎回款	-580,804,576.45	-	-238,849,151.46	-819,653,727.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”	-	-	-	-

号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	695,362,999.66	-	286,131,552.21	981,494,551.87

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》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。

(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 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	30,896,756.12
等于: 本金	30,894,156.68
加: 应计利息	2,599.44
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	30,896,756.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	166,750,138.67	-	158,079,890.82	-8,670,247.85	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,260,000.00	1,474.44	1,474,602.94	213,128.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,260,000.00	1,474.44	1,474,602.94	213,128.50
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	168,010,138.67	1,474.44	159,554,493.76	-8,457,119.35	

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 2023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	-134,454,500.00	-	-	
其中：股指期货投资	-134,454,500.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-134,454,500.00	-	-	

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
IC2307	IC2307	-27.00	-32,350,320.00	250,880.00
IF2307	IF2307	-8.00	-9,192,960.00	22,920.00
IF2309	IF2309	-79.00	-90,984,300.00	1,653,120.00
合计				1,926,920.00
减：可抵销期货				1,926,920.00

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 2023 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	147,055.72
其中：交易所市场	147,055.72
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,634.29
合计	251,690.01

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	296,476,291.22	296,476,291.22
本期申购	112,827.88	112,827.88
本期赎回（以“-”号填列）	-112,652,187.88	-112,652,187.88
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	183,936,931.22	183,936,931.22

嘉实绝对收益策略定期混合 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	384,610.47	384,610.47
本期申购	36.98	36.98
本期赎回（以“-”号填列）	-2,097.63	-2,097.63
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	382,549.82	382,549.82

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	110,358,921.93	-1,059,314.27	109,299,607.66
本期利润	-7,170,742.49	7,651,267.46	480,524.97
本期基金份额交易产生的变动数	-39,417,777.65	-1,676,159.26	-41,093,936.91
其中：基金申购款	39,866.54	1,231.20	41,097.74
基金赎回款	-39,457,644.19	-1,677,390.46	-41,135,034.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	63,770,401.79	4,915,793.93	68,686,195.72

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	140,730.27	-1,440.26	139,290.01
本期利润	-10,872.08	11,604.99	732.91
本期基金份额交易产生的变动数	-662.07	-67.47	-729.54
其中：基金申购款	12.63	0.39	13.02
基金赎回款	-674.70	-67.86	-742.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,196.12	10,097.26	139,293.38

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	68,610.58
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	423,900.99
其他	1,415.29
合计	493,926.86

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,484,954.31
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	-8,484,954.31

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	325,385,608.25
减：卖出股票成本总额	333,102,186.72
减：交易费用	768,375.84
买卖股票差价收入	-8,484,954.31

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	166,309.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-111,825.75
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	54,483.96

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,208,437.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	30,408,160.00
减：应计利息总额	912,090.94
减：交易费用	12.65
买卖债券差价收入	-111,825.75

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	本期收益金额
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	893,352.42

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,928,588.33

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	1,928,588.33

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	8,613,764.93
股票投资	8,494,562.53
债券投资	119,202.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-950,892.48
权证投资	-
期货投资	-950,892.48
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	7,662,872.45

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	98,769.00
基金转出费收入	285.36
合计	99,054.36

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	45,126.92
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	5,367.79
债券托管账户维护费	9,000.00
其他	5,000.00

合计	124,002.08
----	------------

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,647,587.06	7,553,394.93

其中：支付销售机构的客户维护费	216,837.91	426,201.40
-----------------	------------	------------

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 1.00% 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×1.00% / 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 = 提取评价日基金份额净值

× 提取评价日的折算因子 $\sum_{i=1}^n$ 第*i*次基金份额分红 × 第*i*次分红的折算因子

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 为提取评价日的基金份额 = 提取评价日基金总份额 / 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	411,896.71	1,888,348.73

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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×0.25%/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 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
中国银行	-	-	-
嘉实财富	-	-	-
合计	-	1,036.97	1,036.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	61.35	61.35
中国银行	-	-	-
嘉实财富	-	-	-
合计	-	61.35	61.35

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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 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
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 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
报告期初持有的基金份额	10,000,350.03	-
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	10,000,350.03	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的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。

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	30,896,756.12	68,610.58	10,936,136.16	144,332.12

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

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
中银国际证券股份有限公司	113055	成银转债	优先配售	27,080	2,708,000.00
中银国际证券股份有限公司	600938	中国海油	网下申购	120,005	1,296,054.00

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(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	99	2,765.07	3,269.97	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-

001287	中电港	2023年 3月30 日	6个月	新股锁 定	11.88	21.02	418	4,965.84	8,786.36	-
001324	长青科 技	2023年 5月12 日	6个月	新股锁 定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口 腔	2023年 3月29 日	6个月	新股锁 定	20.68	25.49	130	2,688.40	3,313.70	-
001360	南矿集 团	2023年 3月31 日	6个月	新股锁 定	15.38	14.87	166	2,553.08	2,468.42	-
001367	海森药 业	2023年 3月30 日	6个月	新股锁 定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科 技	2023年 5月9日	6个月	新股锁 定	28.84	30.78	166	4,787.44	5,109.48	-
300804	广康生 化	2023年 6月15 日	6个月	新股锁 定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁 业	2023年 3月27 日	6个月	新股锁 定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科 技	2023年 3月1日	6个月	新股锁 定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科 技	2023年 6月16 日	6个月	新股锁 定	34.00	34.93	219	7,446.00	7,649.67	-
301202	朗威股 份	2023年 6月28 日	1个月 内(含)	新发未 上市	25.82	25.82	2,155	55,642.10	55,642.10	-
301202	朗威股 份	2023年 6月28 日	6个月	新股锁 定	25.82	25.82	240	6,196.80	6,196.80	-
301203	国泰环 保	2023年 3月28 日	6个月	新股锁 定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301225	恒勃股 份	2023年 6月8日	6个月	新股锁 定	35.66	33.26	315	11,232.90	10,476.90	-
301246	宏源药 业	2023年 3月10 日	6个月	新股锁 定	50.00	30.71	459	22,950.00	14,095.89	-
301260	格力博	2023年 1月20	6个月	新股锁 定	30.85	23.63	757	23,353.45	17,887.91	-

		日								
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,471	54,279.90	54,279.90	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	164	6,051.60	6,051.60	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	365	11,030.30	9,307.50	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	260	7,696.00	18,569.20	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	730	19,564.00	16,293.60	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	256	17,223.68	16,750.08	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	176	15,339.87	9,370.24	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	166	6,483.96	6,533.76	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	649	9,611.69	8,910.77	-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-

301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	507	8,897.85	8,492.25	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	146	7,300.00	7,064.94	-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	535	12,716.95	22,946.15	-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	121	8,697.48	11,204.60	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	353	8,704.98	7,946.03	-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	297	7,068.60	9,753.48	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	325	15,002.00	11,609.00	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	3,507	93,566.76	93,566.76	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	390	10,405.20	10,405.20	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	863	14,015.12	14,627.85	-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	557	11,134.43	9,413.30	-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	927	6,099.66	7,026.66	-

601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	352	3,646.72	4,167.68	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	263	3,066.58	3,224.38	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	98	2,546.04	2,403.94	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023年4月13日	6个月	新股锁定	36.15	38.13	299	10,808.85	11,400.87	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	1,506	29,909.16	27,198.36	-
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	601	8,510.16	9,742.21	-
688352	硕中科技	2023年4月11日	6个月	新股锁定	12.10	12.07	827	10,006.70	9,981.89	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	266	6,277.60	17,202.22	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	324	6,220.80	8,271.72	-
688433	华曙高科	2023年4月7日	6个月	新股锁定	26.66	31.50	280	7,464.80	8,820.00	-
688458	美芯晟	2023年5月15日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	111	8,325.00	10,074.36	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	3,147	17,906.43	17,025.27	-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	1,259	13,974.90	21,453.36	-
688478	晶升股份	2023年4月13日	6个月	新股锁定	32.52	42.37	325	10,569.00	13,770.25	-
688479	友车科技	2023年5月4日	6个月	新股锁定	33.99	29.49	200	6,798.00	5,898.00	-

688484	南芯科技	2023年 3月28 日	6个月	新股锁 定	39.99	36.71	303	12,116.97	11,123.13	-
688512	慧智微	2023年 5月8日	6个月	新股锁 定	20.92	19.16	390	8,158.80	7,472.40	-
688523	航天环 宇	2023年 5月26 日	6个月	新股锁 定	21.86	23.85	409	8,940.74	9,754.65	-
688535	华海诚 科	2023年 3月28 日	6个月	新股锁 定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军 工	2023年 6月14 日	6个月	新股锁 定	43.67	53.05	195	8,515.65	10,344.75	-
688552	航天南 湖	2023年 5月8日	6个月	新股锁 定	21.17	23.50	389	8,235.13	9,141.50	-
688562	航天软 件	2023年 5月15 日	6个月	新股锁 定	12.68	22.31	610	7,734.80	13,609.10	-
688570	天玛智 控	2023年 5月29 日	6个月	新股锁 定	30.26	25.33	289	8,745.14	7,320.37	-
688576	西山科 技	2023年 5月30 日	6个月	新股锁 定	135.80	120.41	103	13,987.40	12,402.23	-
688581	安杰思	2023年 5月12 日	6个月	新股锁 定	125.80	118.03	68	8,554.40	8,026.04	-
688582	芯动联 科	2023年 6月21 日	6个月	新股锁 定	26.74	40.68	307	8,209.18	12,488.76	-
688593	新相微	2023年 5月25 日	6个月	新股锁 定	11.18	14.59	838	9,368.84	12,226.42	-
688620	安凯微	2023年 6月15 日	6个月	新股锁 定	10.68	12.34	771	8,234.28	9,514.14	-
688623	双元科 技	2023年 5月31 日	6个月	新股锁 定	125.88	86.79	79	9,944.52	6,856.41	-
688629	华丰科 技	2023年 6月16 日	6个月	新股锁 定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信	2023年	6个月	新股锁	25.28	29.87	223	5,637.44	6,661.01	-

	息	6月19日		定						
--	---	-------	--	---	--	--	--	--	--	--

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000691	亚太实业	2023年6月27日	重大事项停牌	4.36	2023年07月04日	4.80	80,700	333,155.00	351,852.00	-
000561	烽火电子	2023年6月30日	重大事项停牌	11.57	2023年07月14日	12.73	28,300	284,870.81	327,431.00	-

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	290,584.15	551,010.90
AAA 以下	1,184,018.79	1,030,184.16
未评级	-	30,804,090.41

合计	1,474,602.94	32,385,285.47
----	--------------	---------------

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同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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	30,896,756.12	-	-	-	30,896,756.12
结算备付金	46,177,943.46	-	-	-	46,177,943.46
存出保证金	100,710.68	-	-	17,386,777.60	17,487,488.28
交易性金融资产	-	290,584.15	1,184,018.79	158,079,890.82	159,554,493.76
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	34,206.82	34,206.82
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	77,175,410.26	290,584.15	1,184,018.79	175,500,875.24	254,150,888.44
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	-	-	-	448,016.10	448,016.10
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	219,669.89	219,669.89
应付托管费	-	-	-	54,917.46	54,917.46

应付销售服务费	-	-	-	170.89	170.89
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	31,453.95	31,453.95
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	251,690.01	251,690.01
负债总计	-	-	-	1,005,918.30	1,005,918.30
利率敏感度缺口	77,175,410.26	290,584.15	1,184,018.79	174,494,956.94	253,144,970.14
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,150,217.62	-	-	-	20,150,217.62
结算备付金	113,499,768.97	-	-	-	113,499,768.97
存出保证金	222,041.82	-	-	22,546,533.60	22,768,575.42
交易性金融资产	30,804,090.41	-	1,581,195.06	218,440,270.99	250,825,556.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	71,900.77	71,900.77
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	164,676,118.82	-	1,581,195.06	241,058,705.36	407,316,019.24
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	-	-	-	391,146.20	391,146.20
应付托管费	-	-	-	97,786.58	97,786.58
应付销售服务费	-	-	-	102.29	102.29
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.05	1.05
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	527,183.76	527,183.76
负债总计	-	-	-	1,016,219.88	1,016,219.88
利率敏感度缺口	164,676,118.82	-	1,581,195.06	240,042,485.48	406,299,799.36

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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-18,813.28	-35,715.05
	市场利率下降 25 个基点	19,107.06	36,080.65

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		
	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	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 2023年6月30日		上年度末 2022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	158,079,890.82	62.45	218,440,270.99	53.76
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	158,079,890.82	62.45	218,440,270.99	53.76

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		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升 5%	1,395,421.57	2,405,337.76
	业绩比较基准下降 5%	-1,395,421.57	-2,405,337.76

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	157,878,021.89	216,920,340.01
第二层次	905,425.36	31,076,951.31
第三层次	771,046.51	2,828,265.14
合计	159,554,493.76	250,825,556.46

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	158,079,890.82	62.20
	其中：股票	158,079,890.82	62.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,474,602.94	0.58
	其中：债券	1,474,602.94	0.58
	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	77,074,699.58	30.33
8	其他各项资产	17,521,695.10	6.89
9	合计	254,150,888.44	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	1,379,295.00	0.54
B	采矿业	7,987,709.00	3.16
C	制造业	93,572,055.50	36.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,369,068.47	2.12
E	建筑业	3,524,876.90	1.39
F	批发和零售业	2,416,954.66	0.95
G	交通运输、仓储和邮政业	2,909,367.00	1.15
H	住宿和餐饮业	453,038.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,426,129.76	2.93
J	金融业	25,916,489.20	10.24
K	房地产业	1,858,334.00	0.73
L	租赁和商务服务业	1,142,449.00	0.45
M	科学研究和技术服务业	1,762,268.08	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	122,340.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	509,542.00	0.20
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	831,263.25	0.33
R	文化、体育和娱乐业	898,711.00	0.36
S	综合	-	-
	合计	158,079,890.82	62.45

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	4,900	8,285,900.00	3.27
2	300750	宁德时代	32,020	7,325,855.80	2.89
3	601318	中国平安	113,900	5,284,960.00	2.09
4	600036	招商银行	100,000	3,276,000.00	1.29
5	000063	中兴通讯	62,200	2,832,588.00	1.12
6	300274	阳光电源	23,700	2,764,131.00	1.09
7	002475	立讯精密	83,800	2,719,310.00	1.07
8	002415	海康威视	80,000	2,648,800.00	1.05
9	002920	德赛西威	16,600	2,586,446.00	1.02
10	600031	三一重工	153,100	2,546,053.00	1.01
11	600919	江苏银行	340,500	2,502,675.00	0.99
12	000338	潍柴动力	192,200	2,394,812.00	0.95
13	300896	爱美客	4,800	2,135,760.00	0.84
14	000333	美的集团	34,500	2,032,740.00	0.80
15	601601	中国太保	78,100	2,029,038.00	0.80
16	000001	平安银行	180,030	2,021,736.90	0.80
17	600060	海信视像	81,300	2,012,175.00	0.79
18	002371	北方华创	5,818	1,848,087.70	0.73
19	688516	奥特维	9,400	1,770,960.00	0.70
20	002410	广联达	53,160	1,727,168.40	0.68
21	601128	常熟银行	252,400	1,721,368.00	0.68
22	601998	中信银行	285,600	1,707,888.00	0.67
23	600886	国投电力	130,000	1,644,500.00	0.65
24	000858	五粮液	10,000	1,635,700.00	0.65
25	600233	圆通速递	111,500	1,623,440.00	0.64
26	300760	迈瑞医疗	5,300	1,588,940.00	0.63
27	601899	紫金矿业	138,000	1,569,060.00	0.62
28	600690	海尔智家	65,400	1,535,592.00	0.61
29	601668	中国建筑	266,500	1,529,710.00	0.60
30	600406	国电南瑞	63,960	1,477,476.00	0.58
31	600266	城建发展	286,300	1,454,404.00	0.57
32	603259	药明康德	23,260	1,449,330.60	0.57
33	600583	海油工程	238,000	1,392,300.00	0.55
34	000568	泸州老窖	6,600	1,383,162.00	0.55
35	601658	邮储银行	280,000	1,369,200.00	0.54
36	300666	江丰电子	19,978	1,357,704.88	0.54
37	301031	中熔电气	9,800	1,329,958.00	0.53

38	600023	浙能电力	259,100	1,313,637.00	0.52
39	600050	中国联通	273,300	1,311,840.00	0.52
40	300433	蓝思科技	110,500	1,299,480.00	0.51
41	600803	新奥股份	66,600	1,264,068.00	0.50
42	601688	华泰证券	89,400	1,231,038.00	0.49
43	601908	京运通	200,100	1,210,605.00	0.48
44	600547	山东黄金	51,300	1,204,524.00	0.48
45	002791	坚朗五金	18,400	1,190,664.00	0.47
46	600760	中航沈飞	25,620	1,152,900.00	0.46
47	600028	中国石化	178,800	1,137,168.00	0.45
48	601898	中煤能源	127,600	1,076,944.00	0.43
49	601567	三星医疗	85,000	1,073,550.00	0.42
50	600030	中信证券	53,335	1,054,966.30	0.42
51	603566	普莱柯	45,300	1,053,225.00	0.42
52	601211	国泰君安	75,200	1,052,048.00	0.42
53	600309	万华化学	11,300	992,592.00	0.39
54	300430	诚益通	60,000	990,600.00	0.39
55	603605	珀莱雅	8,400	944,160.00	0.37
56	600438	通威股份	26,900	922,939.00	0.36
57	000625	长安汽车	71,000	918,030.00	0.36
58	002056	横店东磁	50,300	915,963.00	0.36
59	300413	芒果超媒	26,000	889,460.00	0.35
60	000739	普洛药业	49,800	883,452.00	0.35
61	601600	中国铝业	157,500	864,675.00	0.34
62	601618	中国中冶	216,300	858,711.00	0.34
63	300015	爱尔眼科	43,811	812,694.05	0.32
64	002458	益生股份	62,800	775,580.00	0.31
65	603368	柳药集团	30,900	763,539.00	0.30
66	601166	兴业银行	48,500	759,025.00	0.30
67	688011	新光光电	28,253	729,492.46	0.29
68	600489	中金黄金	69,600	718,968.00	0.28
69	603787	新日股份	42,600	716,106.00	0.28
70	600866	星湖科技	128,100	704,550.00	0.28
71	688379	华光新材	33,393	678,211.83	0.27
72	000895	双汇发展	27,600	675,924.00	0.27
73	600170	上海建工	249,400	670,886.00	0.27
74	002459	晶澳科技	15,500	646,350.00	0.26
75	600153	建发股份	59,000	643,690.00	0.25
76	601555	东吴证券	90,400	627,376.00	0.25
77	000983	山西焦煤	67,400	613,340.00	0.24
78	002352	顺丰控股	13,500	608,715.00	0.24
79	300498	温氏股份	32,900	603,715.00	0.24
80	601728	中国电信	106,100	597,343.00	0.24

81	603300	华铁应急	108,220	589,799.00	0.23
82	603369	今世缘	11,000	580,800.00	0.23
83	002541	鸿路钢构	20,000	576,200.00	0.23
84	600183	生益科技	40,000	568,000.00	0.22
85	300604	长川科技	11,900	565,131.00	0.22
86	688012	中微公司	3,570	558,526.50	0.22
87	603725	天安新材	68,680	558,368.40	0.22
88	688311	盟升电子	7,928	554,484.32	0.22
89	601888	中国中免	5,000	552,650.00	0.22
90	002625	光启技术	35,800	546,308.00	0.22
91	688599	天合光能	12,800	545,408.00	0.22
92	002050	三花智控	18,000	544,680.00	0.22
93	002853	皮阿诺	30,700	531,110.00	0.21
94	300142	沃森生物	19,800	523,710.00	0.21
95	688036	传音控股	3,556	522,732.00	0.21
96	000543	皖能电力	77,600	512,160.00	0.20
97	300122	智飞生物	11,550	510,510.00	0.20
98	300736	百邦科技	41,800	509,542.00	0.20
99	600637	东方明珠	64,700	505,954.00	0.20
100	601838	成都银行	40,000	488,400.00	0.19
101	600276	恒瑞医药	10,000	479,000.00	0.19
102	300174	元力股份	30,100	474,677.00	0.19
103	603214	爱婴室	28,900	470,203.00	0.19
104	601669	中国电建	80,548	462,345.52	0.18
105	600633	浙数文化	28,000	453,880.00	0.18
106	600754	锦江酒店	10,700	453,038.00	0.18
107	603885	吉祥航空	28,400	438,212.00	0.17
108	601012	隆基绿能	15,056	431,655.52	0.17
109	688122	西部超导	7,692	428,675.16	0.17
110	600893	航发动力	10,000	422,600.00	0.17
111	688172	燕东微	17,758	422,285.24	0.17
112	600999	招商证券	30,500	413,885.00	0.16
113	002311	海大集团	8,800	412,192.00	0.16
114	600048	保利发展	31,000	403,930.00	0.16
115	000938	紫光股份	12,400	394,940.00	0.16
116	002258	利尔化学	30,000	387,300.00	0.15
117	688271	联影医疗	2,800	386,428.00	0.15
118	603345	安井食品	2,600	381,680.00	0.15
119	600098	广州发展	60,700	375,126.00	0.15
120	003038	鑫铂股份	9,000	373,140.00	0.15
121	603317	天味食品	25,200	368,172.00	0.15
122	000632	三木集团	86,600	366,318.00	0.14
123	600986	浙文互联	57,000	364,800.00	0.14

124	003003	天元股份	33,600	355,488.00	0.14
125	002832	比音勒芬	10,000	354,100.00	0.14
126	000691	亚太实业	80,700	351,852.00	0.14
127	301360	荣旗科技	3,306	343,336.40	0.14
128	688331	荣昌生物	6,000	334,500.00	0.13
129	002841	视源股份	5,000	334,200.00	0.13
130	000561	烽火电子	28,300	327,431.00	0.13
131	002487	大金重工	10,000	308,400.00	0.12
132	688192	迪哲医药	8,800	305,360.00	0.12
133	300679	电连技术	9,000	297,450.00	0.12
134	688234	天岳先进	4,000	295,760.00	0.12
135	600837	海通证券	31,000	285,820.00	0.11
136	601958	金钼股份	24,700	275,405.00	0.11
137	002820	桂发祥	22,600	256,284.00	0.10
138	688120	华海清科	1,000	252,050.00	0.10
139	603878	武进不锈	29,300	247,585.00	0.10
140	688017	绿的谐波	1,500	243,600.00	0.10
141	002120	韵达股份	25,000	239,000.00	0.09
142	301358	湖南裕能	5,335	234,194.15	0.09
143	000531	穗恒运 A	31,000	224,130.00	0.09
144	000589	贵州轮胎	40,000	224,000.00	0.09
145	301325	曼恩斯特	1,900	217,550.00	0.09
146	300996	普联软件	7,000	214,900.00	0.08
147	603456	九洲药业	7,800	213,564.00	0.08
148	600793	宜宾纸业	16,800	206,472.00	0.08
149	300188	美亚柏科	9,900	205,821.00	0.08
150	603556	海兴电力	8,000	201,920.00	0.08
151	300484	蓝海华腾	14,000	196,840.00	0.08
152	000425	徐工机械	28,500	192,945.00	0.08
153	688111	金山办公	400	188,888.00	0.07
154	688665	四方光电	2,000	186,240.00	0.07
155	603799	华友钴业	4,000	183,640.00	0.07
156	603909	建发合诚	13,760	183,420.80	0.07
157	688478	晶升股份	3,865	181,955.65	0.07
158	605377	华旺科技	10,000	180,500.00	0.07
159	301193	家联科技	10,075	176,614.75	0.07
160	600516	方大炭素	28,200	174,840.00	0.07
161	300724	捷佳伟创	1,400	157,290.00	0.06
162	002442	龙星化工	30,800	151,536.00	0.06
163	301408	华人健康	8,629	149,445.61	0.06
164	603444	吉比特	300	147,333.00	0.06
165	688582	芯动联科	3,067	141,794.76	0.06
166	301383	天键股份	3,245	120,817.00	0.05

167	000888	峨眉山 A	10,000	114,600.00	0.05
168	301225	恒勃股份	3,146	112,081.49	0.04
169	688334	西高院	6,009	106,869.89	0.04
170	688458	美芯晟	1,103	105,475.00	0.04
171	301395	仁信新材	3,897	103,971.96	0.04
172	301322	绿通科技	1,751	97,806.49	0.04
173	688244	永信至诚	1,200	92,880.00	0.04
174	600909	华安证券	19,500	91,065.00	0.04
175	002154	报喜鸟	13,774	76,032.48	0.03
176	301202	朗威股份	2,395	61,838.90	0.02
177	301261	恒工精密	1,635	60,331.50	0.02
178	688038	中科通达	3,931	58,807.76	0.02
179	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
180	301301	川宁生物	3,586	32,130.56	0.01
181	301051	信濠光电	500	30,245.00	0.01
182	688249	晶合集成	1,506	27,198.36	0.01
183	688472	阿特斯	1,259	21,453.36	0.01
184	000538	云南白药	380	19,942.40	0.01
185	301293	三博脑科	260	18,569.20	0.01
186	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.01
187	301260	格力博	757	17,887.91	0.01
188	688361	中科飞测	266	17,202.22	0.01
189	688469	中芯集成	3,147	17,025.27	0.01
190	301310	鑫宏业	256	16,750.08	0.01
191	301303	真兰仪表	730	16,293.60	0.01
192	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
193	301246	宏源药业	459	14,095.89	0.01
194	688562	航天软件	610	13,609.10	0.01
195	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
196	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.01
197	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.01
198	688576	西山科技	103	12,402.23	0.00
199	688593	新相微	838	12,226.42	0.00
200	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
201	688146	中船特气	299	11,400.87	0.00
202	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
203	688484	南芯科技	303	11,123.13	0.00
204	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
205	301318	维海德	309	10,366.95	0.00
206	688543	国科军工	195	10,344.75	0.00
207	688352	颀中科技	827	9,981.89	0.00
208	301306	西测测试	255	9,906.75	0.00
209	301222	浙江恒威	332	9,777.40	0.00

210	688523	航天环宇	409	9,754.65	0.00
211	301382	蜂助手	297	9,753.48	0.00
212	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
213	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
214	688620	安凯微	771	9,514.14	0.00
215	301439	泓淋电力	557	9,413.30	0.00
216	301262	海看股份	365	9,307.50	0.00
217	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
218	301296	新巨丰	542	9,148.96	0.00
219	688552	航天南湖	389	9,141.50	0.00
220	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
221	301332	德尔玛	649	8,910.77	0.00
222	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
223	688433	华曙高科	280	8,820.00	0.00
224	001287	中电港	418	8,786.36	0.00
225	301163	宏德股份	277	8,739.35	0.00
226	301355	南王科技	507	8,492.25	0.00
227	688429	时创能源	324	8,271.72	0.00
228	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
229	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
230	688581	安杰思	68	8,026.04	0.00
231	301376	致欧科技	353	7,946.03	0.00
232	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
233	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
234	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
235	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
236	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
237	301170	锡南科技	219	7,649.67	0.00
238	688512	慧智微	390	7,472.40	0.00
239	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
240	688570	天玛智控	289	7,320.37	0.00
241	301357	北方长龙	146	7,064.94	0.00
242	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
243	601061	中信金属	927	7,026.66	0.00
244	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
245	688623	双元科技	79	6,856.41	0.00
246	301300	远翔新材	211	6,667.60	0.00
247	688631	莱斯信息	223	6,661.01	0.00
248	301323	新莱福	166	6,533.76	0.00
249	688479	友车科技	200	5,898.00	0.00
250	001380	华纬科技	166	5,109.48	0.00
251	601065	江盐集团	352	4,167.68	0.00
252	001328	登康口腔	130	3,313.70	0.00

253	001282	三联锻造	99	3,269.97	0.00
254	601133	柏诚股份	263	3,224.38	0.00
255	001360	南矿集团	166	2,468.42	0.00
256	603125	常青科技	98	2,403.94	0.00
257	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
258	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
259	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	4,169,782.00	1.03
2	002459	晶澳科技	3,372,017.00	0.83
3	601231	环旭电子	3,082,797.00	0.76
4	600050	中国联通	2,791,504.00	0.69
5	000338	潍柴动力	2,779,809.00	0.68
6	600958	东方证券	2,764,899.00	0.68
7	300896	爱美客	2,638,840.00	0.65
8	600031	三一重工	2,636,928.00	0.65
9	601318	中国平安	2,545,234.00	0.63
10	603605	珀莱雅	2,467,418.00	0.61
11	000002	万科 A	2,432,771.00	0.60
12	601998	中信银行	2,394,657.00	0.59
13	002856	美芝股份	2,204,894.00	0.54
14	000063	中兴通讯	2,125,647.00	0.52
15	300274	阳光电源	2,119,219.97	0.52
16	300496	中科创达	2,034,337.00	0.50
17	688516	奥特维	1,992,472.16	0.49
18	601668	中国建筑	1,959,666.00	0.48
19	603885	吉祥航空	1,952,042.66	0.48
20	600583	海油工程	1,917,915.00	0.47

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	600519	贵州茅台	6,882,235.00	1.69
2	600036	招商银行	4,256,153.40	1.05
3	603259	药明康德	3,502,968.20	0.86
4	000568	泸州老窖	3,266,874.00	0.80
5	600521	华海药业	3,259,800.29	0.80
6	000002	万科 A	3,255,727.00	0.80

7	600660	福耀玻璃	3,115,575.00	0.77
8	002459	晶澳科技	3,074,220.40	0.76
9	000651	格力电器	2,927,590.00	0.72
10	601899	紫金矿业	2,825,725.50	0.70
11	601231	环旭电子	2,808,050.00	0.69
12	300628	亿联网络	2,709,597.80	0.67
13	300014	亿纬锂能	2,695,942.00	0.66
14	600958	东方证券	2,574,416.00	0.63
15	002142	宁波银行	2,463,850.08	0.61
16	601318	中国平安	2,453,366.00	0.60
17	000333	美的集团	2,450,262.00	0.60
18	600048	保利发展	2,409,765.31	0.59
19	300059	东方财富	2,337,989.82	0.58
20	002938	鹏鼎控股	2,315,773.00	0.57

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	264,247,244.02
卖出股票收入（成交）总额	325,385,608.25

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）	1,474,602.94	0.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,474,602.94	0.58

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	1,029,152.10	0.41
2	113057	中银转债	2,230	290,584.15	0.11
3	118031	天 23 转债	1,250	140,600.92	0.06

4	113660	寿 22 转债	100	14,265.77	0.01
---	--------	---------	-----	-----------	------

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 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 158,079,890.82 元，占基金资产净值的比例为 62.45%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 132,527,580.00 元，占基金资产净值的比例为 52.35%，空头合约市值占股票资产的比例为 83.84%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -7,591,601.89 元，公允价值变动损益为 7,543,670.05 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，中国平安保险(集团)股份有限公司、招商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	17,487,488.28
2	应收清算款	34,206.82
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	17,521,695.10

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	1,029,152.10	0.41
2	113057	中银转债	290,584.15	0.11
3	113660	寿 22 转债	14,265.77	0.01

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	3,958	46,472.19	94,881,964.03	51.58	89,054,967.19	48.42
嘉实绝对收益策略定期混合 C	5	76,509.96	-	-	382,549.82	100.00

合计	3,963	46,510.09	94,881,964.03	51.48	89,437,517.01	48.52
----	-------	-----------	---------------	-------	---------------	-------

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	1,972,279.68	1.07
	嘉实绝对收益策略定期混合 C	0.70	0.00
	合计	1,972,280.38	1.07

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	296,476,291.22	384,610.47

本报告期基金总申购份额	112,827.88	36.98
减：本报告期基金总赎回份额	112,652,187.88	2,097.63
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	183,936,931.22	382,549.82

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

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，张峰先生任公司副总经理。

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，程剑先生任公司副总经理。

2023年4月29日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李明先生任公司财务总监。

2023年6月20日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，姚志鹏先生任公司副总经理。

(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

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内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 (%)	
华泰证券股份有限公司	5	261,331,274.27	44.97	182,933.26	46.32	-
长江证券股份有限公司	2	120,308,521.54	20.70	80,273.83	20.33	-
东方财富证券股份有限公司	2	63,481,470.35	10.92	40,074.05	10.15	-
中国银河证券股份有限公司	2	57,843,763.19	9.95	40,491.95	10.25	-
方正证券股份有限公司	5	52,383,854.52	9.01	33,070.14	8.37	-
华创证券有限责任公司	2	25,782,194.58	4.44	18,047.88	4.57	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
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	3	-	-	-	-	-

公司						
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	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(中国)证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
联储证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-

公司						
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	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	5	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限	5	-	-	-	-	-

公司						
中信建投证券股份有限公司	4	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	10	-	-	-	-	-
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. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：华西证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：财通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国泰君安证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中邮证券有限责任公司新增交易单元 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(%)
华泰证券股份有限公司	-	-	315,000,000.00	96.92	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	10,000,000.00	3.08	-	-

有限公司						
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	296,437.84	100.00	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

限公司						
东北证 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(中 国)证 券有 限责任 公司	-	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国新证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 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 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 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	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 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	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议的公告	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	2023年2月28日
2	关于嘉实绝对收益策略定期混合第三十七个开放期开放申购、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	2023年3月8日
3	嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告	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	2023年3月21日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2023年4月29日
5	关于嘉实绝对收益策略定期混合第三十八个开放期开放申购、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	2023年6月7日
6	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	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	2023年6月20日

§ 11 备查文件目录

11.1 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。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日