

# 嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由代董事长签发。

基金托管人中国农业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。

嘉实丰和灵活配置混合证券投资基金由丰和价值证券投资基金转型而成。自 2017 年 3 月 20 日起，由《丰和价值证券投资基金基金合同》修订而成的《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效，原《丰和价值证券投资基金基金合同》同日失效。

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	5
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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
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	13
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
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
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 .....	41
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	41
7.12 投资组合报告附注 .....	41
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>42</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	48
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>49</b>
11.1 备查文件目录 .....	49
11.2 存放地点 .....	49
11.3 查阅方式 .....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实丰和灵活配置混合	
基金主代码	004355	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 20 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	697,013,517.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实丰和灵活配置混合 A	嘉实丰和灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	004355	016168
报告期末下属分级基金的份额总额	687,685,968.77 份	9,327,548.75 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	分享中国改革与发展成果, 密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会, 谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金主要参考公司投资决策委员会形成的大类资产配置建议, 综合考虑宏观经济因素、资本市场因素、主要大类资产的相对估值等因素, 在控制风险的前提下, 合理确定本基金在股票、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适时进行动态调整。</p> <p>本基金遵循“宏观推导中观, 中观指导微观”的动态投资逻辑, 通过结合中观因素与个股因素确定优势个股, 并根据组合风险特征、资产配置策略的变化等进行股票投资组合的构建与调整。</p> <p>本基金具体投资策略包括: 资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中债总财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金, 风险与收益高于债券型基金与货币市场基金, 低于股票型基金, 属于较高风险、较高收益的品种

### 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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
		任航
		010-66060069

电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	400-600-8800	95599
传真	(010)65215588	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街 69 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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100020	100031
法定代表人	经雷	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
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 期间数和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	嘉实丰和灵活配置混合 A	嘉实丰和灵活配置混合 C
本期已实现收益	-91,745,361.93	-4,500,360.44
本期利润	28,924,334.75	2,375,060.82
加权平均基金份额本期利润	0.0399	0.0893
本期加权平均净值利润率	2.18%	4.97%
本期基金份额净值增长率	3.09%	2.88%
3.1.2 期末数	报告期末(2024年6月30日)	

据和指标		
期末可供分配利润	582,368,961.60	7,924,115.03
期末可供分配基金份额利润	0.8469	0.8495
期末基金资产净值	1,279,697,852.45	17,251,663.78
期末基金份额净值	1.8609	1.8495
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	81.79%	-10.72%

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

嘉实丰和灵活配置混合 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	-4.27%	0.62%	-2.47%	0.38%	-1.80%	0.24%
过去三个月	4.39%	0.75%	-1.35%	0.60%	5.74%	0.15%
过去六个月	3.09%	0.99%	1.55%	0.71%	1.54%	0.28%
过去一年	-6.96%	0.85%	-6.79%	0.70%	-0.17%	0.15%
过去三年	-11.68%	0.93%	-25.35%	0.83%	13.67%	0.10%
自基金合同生效起至今	81.79%	1.18%	9.46%	0.93%	72.33%	0.25%

嘉实丰和灵活配置混合 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	-4.31%	0.62%	-2.47%	0.38%	-1.84%	0.24%
过去三个月	4.28%	0.75%	-1.35%	0.60%	5.63%	0.15%
过去六个月	2.88%	0.99%	1.55%	0.71%	1.33%	0.28%
过去一年	-7.34%	0.85%	-6.79%	0.70%	-0.55%	0.15%
自基金合同生效起 至今	-10.72%	0.81%	-9.09%	0.68%	-1.63%	0.13%

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：

$$\text{Return}(t) = 80\% * (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债总财富指数}(t) / \text{中债总财富指数}(t-1) - 1)$$

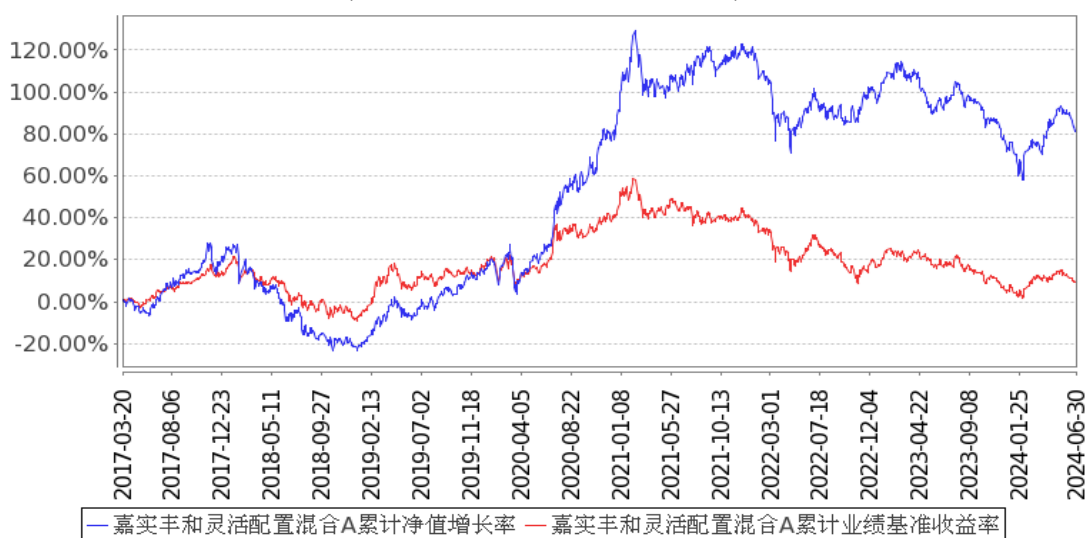
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

#### 嘉实丰和灵活配置混合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

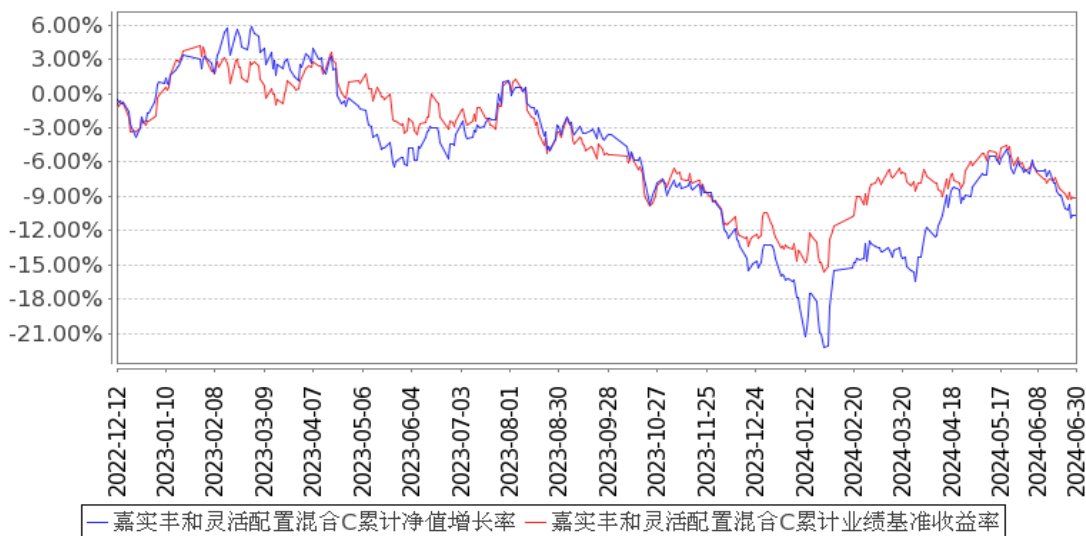
(2017年03月20日至2024年06月30日)





### 嘉实丰和灵活配置混合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

(2022年12月12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		
吴悠	本基金、嘉实产业	2020年1月3日	-	11年	2012年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、机构部投资经理助理

	优选混合 (LOF)、 嘉实价值 丰润混合 基金经理				理，现任基金经理。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
--	--	--	--	--	-------------------------------

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

(2) 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 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 年一季度国内经济延续平稳态势，但新开工节奏偏慢，各项宏观指标亦乏善可陈。市场参与者的信心则愈发疲弱，持续的资金面负反馈最终引发了流动性危机。春节前夕 A 股市场出现巨幅波动，以小微盘股票为首的板块连日暴跌。随后在政策的有效干预下，流动性冲击得以缓解，市场则在企稳后迅速反弹。

进入二季度全球宏观基本面没有明显改善。国内信用还在持续收缩，财政也未有大规模扩张，经济周期仍在底部盘桓。海外欧美经济已经出现放缓的迹象，美联储因担忧通胀韧性而一再推迟

降息，全球风险资产尤其是大宗商品波动加剧。面对国内外的不确定性，市场在反弹后回落，持续在底部震荡。

考虑到宏观经济位于周期底部、股票估值处于历史低位、市场预期也已显著回落，我们对未来一两年的股票市场表现仍有信心。而因流动性危机引发的“股灾”也是熊市末期的典型现象，大概率已经探明了本轮市场周期的底部。报告期内，我们保持了中高水平的权益仓位，并趁市场大幅波动对组合持仓进行了适度调整。在行业配置上，主要是减持了不确定性过高的地产链公司，买入了煤炭和钢铁行业的低估值个股，也增持了超跌的化工和军工细分龙头。

未来我们还是聚焦于自下而上的结构性机会，当前较为看好的投资方向：一方面是确定性高、估值合理的质量价值股，包括金融、资源、消费等板块的蓝筹个股；另一方面是周期底部、质地优异的周期成长股，例如化工、机械、军工等行业的细分龙头。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实丰和灵活配置混合 A 基金份额净值为 1.8609 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.09%；截至本报告期末嘉实丰和灵活配置混合 C 基金份额净值为 1.8495 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.88%；业绩比较基准收益率为 1.55%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

历经两年熊市，A 股市场仍在底部徘徊，市场参与者们积累了很多悲观的情绪。主要还是对中国经济缺乏信心。

回顾历史，即便从本人不太长的从业经历来看，这样的悲观也不是第一次发生。如 2015 年中到 2016 年初，市场同样巨幅波动，投资者大受冲击，比当前有过之而无不及。当时中国经济似乎面临同样的困局，市场参与者们也普遍看不清楚未来走向。但随着房地产周期回暖和供给侧改革推出，中国慢慢走出通缩阴影。而仅两三年之后，以新能源为代表的中高端制造业崛起，期待已久的经济结构转型初现曙光。

回到当下，我们不妨换一个偏积极的视角来看待当前的宏观问题：

首先，这一轮中国经济下行最大的拖累项无疑是房地产，而从边际上看房地产最差的时候应该已经过去了。一方面，新房销售量经过连续两年的大幅下滑，已经回到中长期均衡水平。另一方面，随着房地产相关政策的彻底转向，近期一线城市二手房成交有重新活跃的迹象。我们判断，房地产行业的风险已经基本出清，若未来居民收入预期有所改善，大概率能够企稳回升。

其次，在本轮房地产下行过程中，通过有力的政策干预和有效的风险切割，没有对银行信贷资产和地方政府债务造成非常大的冲击。中国在近年来复杂的外部环境下，既消除了房地产泡沫的风险，又没有引发系统性的金融危机，从某种意义上可视为经济结构转型的初步成功。资产市

场其实也给予了正面的反馈，自去年以来银行股的表现就一骑绝尘，很多人从高股息的角度来解读，但前提还是银行资产暴雷和发生系统性危机的风险被排除。

中国经济再度处于一个重要的转折点，这一轮下行周期可能已经接近尾声。我们应该相信周期的力量，用偏乐观的心态看待未来几年的经济前景和市场机遇。需要指出，随着中国经济的结构转型，过去市场所熟悉的宏观分析框架也面临重塑。最典型的，货币信用等金融数据对于资产表现的解释力已大幅减弱。未来可能确实需要更加关注结构问题、淡化总量问题，而这也是我们在自己的投资体系中一直强调的要点。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金

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	126,684,078.68	161,469,726.73
结算备付金		882,381.70	919,023.49
存出保证金		219,988.67	175,286.56
交易性金融资产	6.4.7.2	1,174,911,749.94	1,411,247,804.39
其中：股票投资		1,107,881,155.42	1,339,976,793.43
基金投资		-	-
债券投资		67,030,594.52	71,271,010.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		200,927.73	779,618.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,302,899,126.72	1,574,591,459.82
<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		-	-
应付清算款		2,600,496.83	17,291,061.45
应付赎回款		543,270.37	793,481.48
应付管理人报酬		1,317,009.10	1,543,072.80
应付托管费		219,501.54	257,178.82
应付销售服务费		5,910.54	23,372.70
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	804.92
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,263,422.11	1,473,937.18
负债合计		5,949,610.49	21,382,909.35
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	706,656,439.60	872,131,423.14
未分配利润	6.4.7.12	590,293,076.63	681,077,127.33
净资产合计		1,296,949,516.23	1,553,208,550.47
负债和净资产总计		1,302,899,126.72	1,574,591,459.82

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实丰和灵活配置混合 A 基金份额净值 1.8609 元，基金份额总额 687,685,968.77 份，嘉实丰和灵活配置混合 C 基金份额净值 1.8495 元，基金份额总额 9,327,548.75 份，基金份额总额合计为 697,013,517.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金

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>		41,096,002.51	-45,358,637.06
1. 利息收入		439,031.49	992,642.17
其中：存款利息收入	6.4.7.13	439,031.49	832,187.82

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		-	160,454.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-87,441,440.81	-4,775,764.06
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-107,765,702.01	-20,688,892.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	580,711.40	23,062.47
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	19,743,549.80	15,890,065.47
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	127,545,117.94	-42,131,619.49
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	553,293.89	556,104.32
<b>减：二、营业总支出</b>		9,796,606.94	13,820,371.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,200,261.00	11,568,248.23
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,366,710.21	1,928,041.36
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	95,725.79	182,580.57
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	133,909.94	141,501.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		31,299,395.57	-59,179,008.86
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		31,299,395.57	-59,179,008.86
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		31,299,395.57	-59,179,008.86

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金

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	872,131,423.14	-	681,077,127.33	1,553,208,550.47
二、本期期初净资产	872,131,423.14	-	681,077,127.33	1,553,208,550.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-165,474,983.54	-	-90,784,050.70	-256,259,034.24
（一）、综合收益总额	-	-	31,299,395.57	31,299,395.57
（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)	-165,474,983.54	-	-122,083,446.27	-287,558,429.81
其中：1. 基金申购款	86,394,324.72	-	73,231,033.96	159,625,358.68
2. 基金赎回款	-251,869,308.26	-	-195,314,480.23	-447,183,788.49
（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	706,656,439.60	-	590,293,076.63	1,296,949,516.23
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	563,217,255.80	-	567,381,263.62	1,130,598,519.42



二、本期期初净资产	563,217,255.80	-	567,381,263.62	1,130,598,519.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	272,168,852.30	-	246,282,594.50	518,451,446.80
(一)、综合收益总额	-	-	-59,179,008.86	-59,179,008.86
(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)	272,168,852.30	-	305,461,603.36	577,630,455.66
其中：1. 基金申购款	437,237,151.74	-	477,554,698.49	914,791,850.23
2. 基金赎回款	-165,068,299.44	-	-172,093,095.13	-337,161,394.57
(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	835,386,108.10	-	813,663,858.12	1,649,049,966.22

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：

经雷

梁凯

李袁

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

嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金是根据原丰和价值证券投资基金(以下简称“基金丰和”)基金份额持有人大会决议通过的《关于丰和价值证券投资基金转型有关事项的议案》，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[2016]2830号《关于准予丰和价值证券投资基金变更注册的批复》批复，由原基金丰和转型而来。原基金丰和为契约型封闭式基金，

于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市,存续期为自基金成立之日起 15 年。根据中国证监会证监许可[2016]2830 号《关于准予丰和价值证券投资基金变更注册的批复》和《嘉实基金管理有限公司关于丰和价值证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》等有关规定,原基金丰和于 2017 年 3 月 17 日终止上市权利登记。自 2017 年 3 月 20 日起,原基金丰和转型成为契约型开放式基金,并更名为嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),存续期限不定。原《丰和价值证券投资基金基金合同》失效,《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

#### 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》、《嘉实丰和灵活配置混合型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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	126,684,078.68
等于：本金	126,661,027.66
加：应计利息	23,051.02
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	126,684,078.68

##### 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	1,090,158,811.11	-	1,107,881,155.42	17,722,344.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	65,788,759.97	1,017,394.52	67,030,594.52	224,440.03
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	65,788,759.97	1,017,394.52	67,030,594.52	224,440.03
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,155,947,571.08	1,017,394.52	1,174,911,749.94	17,946,784.34	

### 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	750,000.00
应付赎回费	1,122.77
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	407,873.20
其中：交易所市场	407,873.20
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
合计	1,263,422.11

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 嘉实丰和灵活配置混合 A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	821,479,538.91	832,998,858.50
本期申购	81,066,129.69	82,203,569.00
本期赎回（以“-”号填列）	-214,859,699.83	-217,873,536.65
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	687,685,968.77	697,328,890.85

## 嘉实丰和灵活配置混合 C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,132,564.64	39,132,564.64
本期申购	4,190,755.72	4,190,755.72
本期赎回（以“-”号填列）	-33,995,771.61	-33,995,771.61
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	9,327,548.75	9,327,548.75

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

嘉实丰和灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	886,513,443.50	-236,653,192.44	649,860,251.06
本期期初	886,513,443.50	-236,653,192.44	649,860,251.06
本期利润	-91,745,361.93	120,669,696.68	28,924,334.75
本期基金份额交易产生的变动数	-131,601,856.81	35,186,232.60	-96,415,624.21
其中：基金申购款	78,984,751.06	-9,110,543.64	69,874,207.42
基金赎回款	-210,586,607.87	44,296,776.24	-166,289,831.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	663,166,224.76	-80,797,263.16	582,368,961.60

嘉实丰和灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,474,184.52	-11,257,308.25	31,216,876.27
本期期初	42,474,184.52	-11,257,308.25	31,216,876.27
本期利润	-4,500,360.44	6,875,421.26	2,375,060.82
本期基金份额交易产生的变动数	-28,950,446.78	3,282,624.72	-25,667,822.06
其中：基金申购款	4,158,293.32	-801,466.78	3,356,826.54
基金赎回款	-33,108,740.10	4,084,091.50	-29,024,648.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,023,377.30	-1,099,262.27	7,924,115.03

## 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	428,446.02
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	9,065.95
其他	1,519.52
合计	439,031.49

## 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	-107,765,702.01
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	-107,765,702.01

#### 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	1,027,634,199.47
减：卖出股票成本总额	1,133,575,732.34
减：交易费用	1,824,169.14
买卖股票差价收入	-107,765,702.01

#### 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	564,833.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	15,877.97
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	580,711.40

##### 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	4,960,444.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,884,317.03
减：应计利息总额	60,249.87
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	15,877.97



## 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

无。

## 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	19,743,549.80
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	19,743,549.80

#### 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	127,545,117.94
股票投资	127,405,800.91
债券投资	139,317.03
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	127,545,117.94

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	264,083.97
基金转出费收入	289,209.92
合计	553,293.89

#### 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	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,883.80
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00

合计	133,909.94
----	------------

#### 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 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	8,200,261.00	11,568,248.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,235,776.90	1,918,395.37
应支付基金管理人的净管理费	6,964,484.10	9,649,852.86

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 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	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	1,366,710.21	1,928,041.36

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

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实丰和灵活配置混合 A	嘉实丰和灵活配置混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	14,655.58	14,655.58
合计	-	14,655.58	14,655.58
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		
	嘉实丰和灵活配置混合 A	嘉实丰和灵活配置混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	100,762.91	100,762.91
合计	-	100,762.91	100,762.91

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固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	126,684,078.68	428,446.02	247,391,002.58	805,975.76

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本期（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。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分享中国改革与发展成果，密切跟踪中国经济发展背景下产业转移、格局变迁、主题带动和企业成长的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。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风险管理制度，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

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	67,030,594.52	71,271,010.96
合计	67,030,594.52	71,271,010.96

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

无。

#### 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。



## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	126,684,078.68	-	-	-	126,684,078.68
结算备付金	882,381.70	-	-	-	882,381.70
存出保证金	219,988.67	-	-	-	219,988.67
交易性金融资产	67,030,594.52	-	-	1,107,881,155.42	1,174,911,749.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	200,927.73	200,927.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	194,817,043.57	-	-	1,108,082,083.15	1,302,899,126.72
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	-	-	-	2,600,496.83	2,600,496.83
应付赎回款	-	-	-	543,270.37	543,270.37
应付管理人报酬	-	-	-	1,317,009.10	1,317,009.10
应付托管费	-	-	-	219,501.54	219,501.54
应付销售服务费	-	-	-	5,910.54	5,910.54
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,263,422.11	1,263,422.11
负债总计	-	-	-	5,949,610.49	5,949,610.49
利率敏感度缺口	194,817,043.57	-	-	1,102,132,472.66	1,296,949,516.23
上年度末 2023 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	161,469,726.73	-	-	-	161,469,726.73
结算备付金	919,023.49	-	-	-	919,023.49
存出保证金	175,286.56	-	-	-	175,286.56

交易性金融资产	71,271,010.96	-	-	1,339,976,793.43	1,411,247,804.39
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	779,618.65	779,618.65
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	233,835,047.74	-	-	1,340,756,412.08	1,574,591,459.82
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	-	-	-	17,291,061.45	17,291,061.45
应付赎回款	-	-	-	793,481.48	793,481.48
应付管理人报酬	-	-	-	1,543,072.80	1,543,072.80
应付托管费	-	-	-	257,178.82	257,178.82
应付销售服务费	-	-	-	23,372.70	23,372.70
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	804.92	804.92
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,473,937.18	1,473,937.18
负债总计	-	-	-	21,382,909.35	21,382,909.35
利率敏感度缺口	233,835,047.74	-	-	1,319,373,502.73	1,553,208,550.47

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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	-12,381.62	-100,261.61

	市场利率下降 25 个基点	12,386.19	100,544.47
--	---------------	-----------	------------

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,107,881,155.42	85.42	1,339,976,793.43	86.27

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	1,107,881,155.42	85.42	1,339,976,793.43	86.27

#### 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%	71,645,571.38	68,500,100.53
	业绩比较基准下降5%	-71,645,571.38	-68,500,100.53

#### 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	1,107,881,155.42	1,337,110,538.71
第二层次	67,030,594.52	71,271,010.96

第三层次	-	2,866,254.72
合计	1,174,911,749.94	1,411,247,804.39

#### 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	1,107,881,155.42	85.03
	其中：股票	1,107,881,155.42	85.03
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	67,030,594.52	5.14
	其中：债券	67,030,594.52	5.14
	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	127,566,460.38	9.79

8	其他各项资产	420,916.40	0.03
9	合计	1,302,899,126.72	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	97,822,221.00	7.54
C	制造业	748,495,084.65	57.71
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	90,745,714.78	7.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,597,038.38	2.51
J	金融业	138,221,096.61	10.66
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	1,107,881,155.42	85.42

### 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	002078	太阳纸业	7,351,400	102,552,030.00	7.91
2	601021	春秋航空	1,610,966	90,745,714.78	7.00
3	601128	常熟银行	11,478,873	86,895,068.61	6.70
4	002025	航天电器	1,593,852	73,922,855.76	5.70
5	600282	南钢股份	13,651,400	67,983,972.00	5.24

6	300628	亿联网络	1,790,475	65,835,765.75	5.08
7	601225	陕西煤业	2,490,200	64,172,454.00	4.95
8	600060	海信视像	2,572,391	63,640,953.34	4.91
9	600486	扬农化工	991,720	55,982,594.00	4.32
10	688122	西部超导	1,455,020	55,756,366.40	4.30
11	600036	招商银行	1,501,200	51,326,028.00	3.96
12	600309	万华化学	621,516	50,255,783.76	3.87
13	300395	菲利华	1,437,300	44,196,975.00	3.41
14	002541	鸿路钢构	2,565,056	43,529,000.32	3.36
15	603878	武进不锈	6,516,423	42,617,406.42	3.29
16	002028	思源电气	634,100	42,421,290.00	3.27
17	600583	海油工程	5,693,700	33,649,767.00	2.59
18	603383	顶点软件	1,016,434	32,597,038.38	2.51
19	688016	心脉医疗	207,158	20,311,841.90	1.57
20	002986	宇新股份	1,559,060	19,488,250.00	1.50

#### 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	600282	南钢股份	68,466,616.00	4.41
2	300395	菲利华	62,229,419.00	4.01
3	600036	招商银行	51,943,507.00	3.34
4	600188	兖矿能源	51,668,794.61	3.33
5	002966	苏州银行	42,093,145.30	2.71
6	688122	西部超导	42,004,546.89	2.70
7	601001	晋控煤业	39,822,370.77	2.56
8	600486	扬农化工	34,181,693.86	2.20
9	603383	顶点软件	31,530,622.99	2.03
10	002025	航天电器	30,699,197.58	1.98
11	002986	宇新股份	29,313,532.25	1.89
12	603878	武进不锈	28,313,886.89	1.82
13	688016	心脉医疗	24,252,295.04	1.56
14	002142	宁波银行	23,415,099.39	1.51
15	000963	华东医药	22,781,633.36	1.47
16	002597	金禾实业	18,226,587.88	1.17
17	688503	聚和材料	16,628,205.95	1.07
18	002078	太阳纸业	16,311,673.98	1.05
19	603712	七一二	15,306,862.50	0.99
20	002372	伟星新材	14,305,543.51	0.92

##### 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	002028	思源电气	68,912,378.45	4.44
2	603383	顶点软件	56,635,088.63	3.65
3	600188	兖矿能源	55,041,400.07	3.54
4	000002	万科 A	53,934,784.84	3.47
5	601857	中国石油	49,790,820.68	3.21
6	002966	苏州银行	43,074,889.81	2.77
7	600166	福田汽车	41,682,806.51	2.68
8	002468	申通快递	38,228,487.39	2.46
9	601001	晋控煤业	38,085,791.00	2.45
10	603901	永创智能	36,834,557.68	2.37
11	601021	春秋航空	34,741,762.00	2.24
12	600060	海信视像	29,542,820.30	1.90
13	002025	航天电器	28,291,706.77	1.82
14	601225	陕西煤业	28,151,354.00	1.81
15	600309	万华化学	27,885,314.45	1.80
16	688122	西部超导	27,439,779.14	1.77
17	603878	武进不锈	25,096,964.70	1.62
18	002410	广联达	24,681,501.00	1.59
19	300395	菲利华	24,170,427.96	1.56
20	002142	宁波银行	22,584,381.94	1.45

#### 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	774,074,293.42
卖出股票收入（成交）总额	1,027,634,199.47

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	67,030,594.52	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-



10	合计	67,030,594.52	5.17
----	----	---------------	------

## 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	019709	23 国债 16	660,000	67,030,594.52	5.17

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 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

无。

## 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 投资组合报告附注

### 7.12.1 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，江苏常熟农村商业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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	219,988.67
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	200,927.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	420,916.40

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 7.12.6 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 (%)
嘉实丰和 灵活配置 混合 A	51,038	13,474.00	332,057,725.34	48.29	355,628,243.43	51.71
嘉实丰和 灵活配置 混合 C	4,822	1,934.37	5,331,981.85	57.16	3,995,566.90	42.84
合计	55,414	12,578.29	337,389,707.19	48.41	359,623,810.33	51.59

注：(1) 嘉实丰和灵活配置混合 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丰和灵活配置混合 A 份额占嘉实丰和灵活配置混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实丰和灵活配置混合 A 份额占嘉实丰和灵活配置混合 A 总份额比例；

(2) 嘉实丰和灵活配置混合 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丰和灵活配置混合 C 份额占嘉实丰和灵活配置混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实丰和灵活配置混合 C 份额占嘉实丰和灵活配置混合 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	嘉实丰和灵活配置混合 A	959,392.42	0.14
	嘉实丰和灵活配置混合 C	30,390.13	0.33
	合计	989,782.55	0.14

## 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	嘉实丰和灵活配置混合 A	0~10
	嘉实丰和灵活配置混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实丰和灵活配置混合 A	10~50
	嘉实丰和灵活配置混合 C	0
	合计	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实丰和灵活配置混合 A	嘉实丰和灵活配置混合 C
基金合同生效日 (2017年3月20日) 基金份额总额	3,000,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	821,479,538.91	39,132,564.64
本报告期基金总申购份额	81,066,129.69	4,190,755.72
减：本报告期基金总赎回份额	214,859,699.83	33,995,771.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	687,685,968.77	9,327,548.75

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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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 (%)	
中信证券股份有限公司	5	381,305,632.89	21.16	246,287.58	20.61	-
华泰证券	1	241,179,835.	13.39	168,825.90	14.13	-

股份有限 公司		80				
开源证券 股份有限 公司	2	238,487,890. 92	13.24	154,034.79	12.89	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	220,833,584. 31	12.26	154,584.59	12.94	-
海通证券 股份有限 公司	2	157,989,782. 78	8.77	102,043.93	8.54	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	133,282,858. 80	7.40	86,087.71	7.21	-
长江证券 股份有限 公司	2	125,610,110. 54	6.97	81,136.55	6.79	-
中信建投 证券股份 有限公司	1	99,190,275.4 0	5.51	64,062.19	5.36	-
申万宏源 证券有限 公司	2	81,912,408.7 8	4.55	57,339.07	4.80	-
国盛证券 有限责任 公司	1	50,539,231.2 9	2.81	32,632.34	2.73	-
广发证券 股份有限 公司	2	40,460,849.6 4	2.25	26,133.43	2.19	-
国信证券 股份有限 公司	1	30,916,031.7 4	1.72	21,642.03	1.81	-
长城证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
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，本基金新增以下交易单元：中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公司						
开源证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	4,900,195.0 0	100.00	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证 券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

无。



## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会关于准予丰和价值证券投资基金变更注册的批复文件；
- (2) 《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实丰和灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 法律意见书；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 基金托管人业务资格批件、营业执照；
- (7) 报告期内嘉实丰和灵活配置混合型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

2024 年 8 月 30 日