

嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资
基金
2023 年第 2 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 7 月 20 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 07 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 04 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实品质蓝筹一年持有期混合
基金主代码	014872
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 2 月 11 日
报告期末基金份额总额	180,712,662.76 份
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，通过稳健的投资策略精选蓝筹股票，实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	<p>资产配置策略：本基金将根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、市场面、政策面等多种因素的综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，以确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，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>股票投资策略：蓝筹股票的界定（本基金所指的蓝筹股票是指基金管理人认为具备较高内在价值的上市公司股票，表现为该上市公司具备成熟的商业模式，拥有较强盈利能力，财务状况良好，市场地位领先，治理结构健康，并且公司股票估值相对合理；本基金对具备“蓝筹”特性的公司也进行了定量指标的界定）、行业配置策略、个股精选策略、港股通投资策略、存托凭证投资策略。</p> <p>其他投资策略包括：债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资策略、风险管理策略等。</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	014872	014873
报告期末下属分级基金的份额总额	173,891,342.70 份	6,821,320.06 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 4 月 1 日-2023 年 6 月 30 日）	
	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	2,283,338.84	77,111.87
2. 本期利润	-24,307,191.40	-956,026.96
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1365	-0.1355
4. 期末基金资产净值	143,898,244.44	5,582,622.33
5. 期末基金份额净值	0.8275	0.8184

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-14.12%	1.25%	-3.99%	0.67%	-10.13%	0.58%

过去六个月	-17.04%	1.23%	-0.33%	0.69%	-16.71%	0.54%
过去一年	-20.07%	1.55%	-10.51%	0.82%	-9.56%	0.73%
自基金合同生效起至今	-17.25%	1.62%	-13.37%	0.96%	-3.88%	0.66%

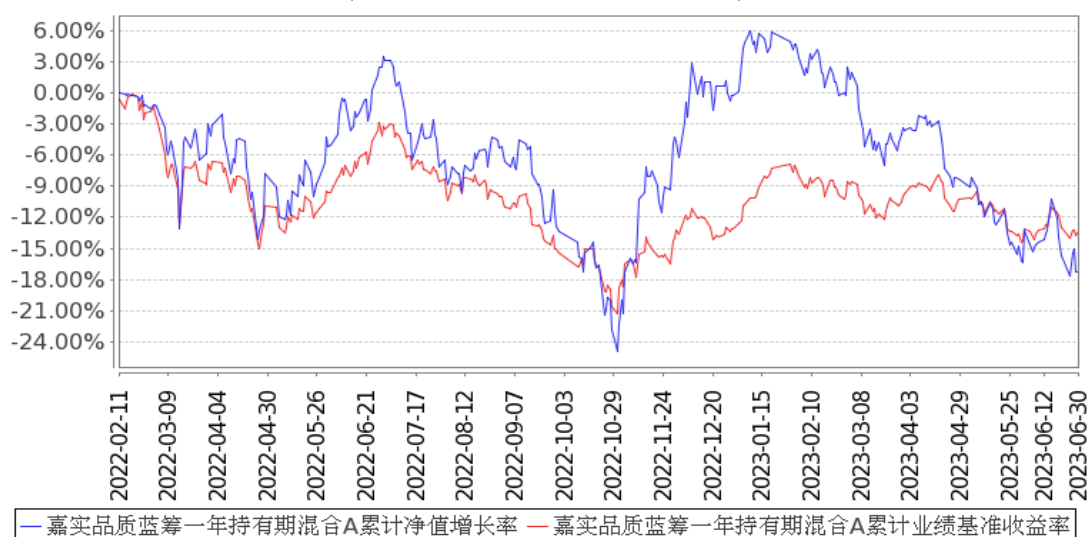
嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准	①-③	②-④
				收益率标准差④		
过去三个月	-14.29%	1.25%	-3.99%	0.67%	-10.30%	0.58%
过去六个月	-17.37%	1.24%	-0.33%	0.69%	-17.04%	0.55%
过去一年	-20.71%	1.56%	-10.51%	0.82%	-10.20%	0.74%
自基金合同生效起至今	-18.16%	1.62%	-13.37%	0.96%	-4.79%	0.66%

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

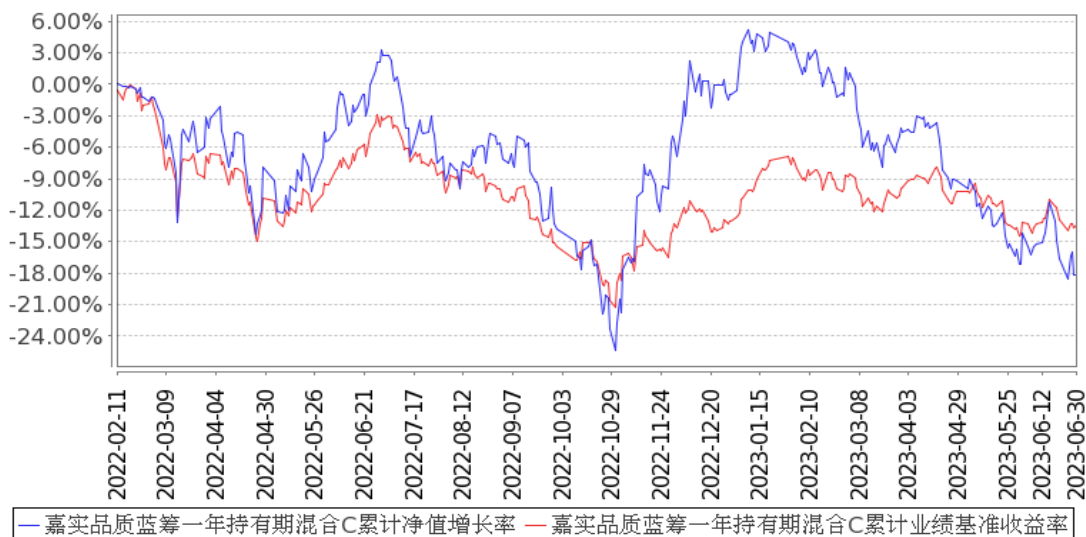
嘉实品质蓝筹一年持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年02月11日至2023年06月30日)



嘉实品质蓝筹一年持有期混合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

(2022年02月11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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖觅	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实周期优选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实新财富混合、嘉实物流产业股票、嘉实基础产业优选股票、嘉实	2022年2月11日	-	13年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司任职于研究部，先后任钢铁行业、交通运输行业研究员等职位，现任大周期研究总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

核心蓝筹 混合基金 经理				
--------------------	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 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
肖觅	公募基金	8	8,223,625,249.49	2016年12月29日
	私募资产管理计划	1	488,492,480.31	2022年3月24日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	8,712,117,729.80	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实品质蓝筹一年持有期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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 3 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略

不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

上半年以沪深 300 为代表的宽基指数收益率基本集中在低个位数水平，但过程上权益市场出现了一次明显的预期跟随现实基本面的调整，而结构上以 AI 为代表的新的产业趋势相关的行业有非常突出的表现，中间穿插“中特估”相关主题的表现。公募基金方面，以万德偏股混合型基金指数为公募基金平均水平的代表，上半年是略跑输主要宽基指数的。从结果上看，公募基金重仓的行业和个股在上半年没有获得超额回报。

基本面层面发生了什么？总体概念上经济处在一个弱复苏的状态：强复苏预期落空了，主要体现在房地产作为总需求最重要的驱动力，实际情况远低于预期，也拖累新开工链条上各个行业的表现，总需求相关的其他大部分行业表现也比较平淡；但复苏还是有的，主要体现在线下服务业明显的恢复，甚至出行链的部分子行业出现了积累需求的阶段性释放带来的明显的景气上行。节奏上，在短短半年内，复苏的强度也出现了一次明显的波动，从春节后到四月份，主要体现的是疫情期间积累的各种需求的释放，包括房地产也出现了阶段性的显著改善，但五六月份以来，随着房地产销售端迅速下滑，总需求相关的行业迅速转冷，到半年末再去看看，和总量相关的行业只剩下汽车和出行相对不错。这种复苏节奏的变化对于公募基金是比较不利的：公募基金作为天然多头总体上通常会对各种正面变化比较敏感，会更倾向于去乐观解读这些变化，历史上中国经济的韧性也让这种更乐观的反应成为了占优策略，春节前后公募基金对复苏相关行业有比较明显的风险暴露，但有强度的复苏持续时间太短，预期的迅速落空就直接体现为公募基金组合的压力。当然在新兴产业里，AI 产业链是非常火爆的，不过在整个宏观经济的总盘子中体量太小，不足以影响总需求的波动。

权益投资理论上是一个长久期的决策，半年维度的总需求波动本身不是太大的问题，现在遇到的问题，焦点实际上又回到了信心这两个字上。最近我们广泛调研下来，各行各业产业链上下游的市场主体，比较普遍的缺乏对一个抽象概念上宏观经济的信心。原因错综复杂：消费者层面上，收入预期不行；企业主层面上，行业政策预期不稳定、国际关系不确定；地产行业的相关主体，又会关注到长期人口趋势的问题等。当然在各行各业，对自己行业景气的预期差异还是比较大的，这里的信心不足更多是一个抽象的总量概念，体现的是对中长期的担忧。从行为上看，有一些宏观数据可以直接体现市场主体的信心，比如最典型的，房地产投资和新开工已经出现了明显下滑，再比如前几年比较大的亮点，制造业的固定资产投资，现在也非常平淡。市场层面也有一个很容易观察的，从外部视角看中国经济信心的一个代表性指标，就是港股市场的表现，不管是因为基本面变化、汇率波动还是因为国际关系的变化带来的港股市场的反应，实际上都可以看

作是海外视角下对中国经济的信心，显然，现在时间点的信心并不是太强。

回到市场层面，复苏强度明显减弱后，市场预期也迅速进行了调整，从我们观察来看，目前预期和基本面实际情况的匹配程度是明显好于春节期间的。从大部分上市公司盈利预测调整以及当前估值情况观察，总需求相关的这些行业基本算是定在了合理的价格上，至少反映了基本面当前的平淡，甚至也包含了一定程度的走弱预期，至少已经没有了不切实际的强预期。这是一个相对比较有利的状态：隐含回报率已经有明显提升，而且这种回报的实现也不再强烈依赖于基本面需要有非线性的上行。在这个状态下，可以有一个模糊的结论：继续全面悲观没有意义，但大的机会会因为总需求的压制，因为没有信心，可能也会相对有限。落实到投资层面，问题就被降维到寻找结构性积极因素上：经济的内生循环，居民收入（对应需求来源）、资产价格（对应资产负债表）、生产活动（对应供给能力），是否能够从一个方向上被推动起来？内生循环中有没有一些结构性亮点？如果后续有经济政策或者产业政策，直接影响的行业会在哪里？有没有可能中长期预期或者说信心变得正面？

那么积极地变化在哪里？比较容易看到的一个积极变化显然是火遍全球的 AI 产业，ChatGPT 的横空出世，显著的效率提升前景，让世界看到了新一轮产业革命的可能性，相关行业也一定会有丰富的机会，但在当前的时间点来看，要成为推动经济内生循环转起来的发动机，体量上还有所欠缺。这里我们分享一下我们观察到的，有可能去从居民收入这个点上推动循环转起来的一个点：出行链的变化。今年以来以航空为代表的出行链，复苏程度是超预期的，一是体现在国内旅客量已经超过了 2019 年同期的水平，第二更重要的是票价水平也明显高于 2019 年，这就意味着实际上出行的意愿实际上是比 2019 年强很多的，第三在各个假期，会明显看到脉冲式的需求释放，这则意味着因私出行的需求也很强劲。为什么在经济弱复苏的情景下，出行链表现会这么好？我们推测背后原因可能来自于以下几点：商务需求方面，订单偏弱可能进一步催生了销售端加强客户沟通的需求，公务需求方面则因为强调调研带来了一些新增需求，因私需求方面，近期有疫情期间积累的国内游需求的释放，远期则还有供给释放后境外游恢复的支撑。看原因，似乎可以得到比较模糊的结论是出行的需求是有一定持续性的，那么如果出行需求能够持续，相关的线下服务业又是一个吸纳了相当规模就业的板块，有可能在持续一段时间后，居民收入的改善率先在线下服务相关部门出现，进一步启动居民收入——资产价格——生产活动的经济内生循环。

还有可能出现的积极变化可能来自于政策端，市场尤其关心房地产政策，但在房住不炒和因城施策的大框架下，现有政策工具并不一定能够重新建立居民对房地产作为一项重要资产配置的信心。假定政策目标是销量见顶回落的速度相对平和，这样地方财政相关的土地出让能够勉强维持，地产产业链也维持一定规模和就业，同时房价不出现暴跌，这样中国的资产负债表是安全的，

那么从我们的理解来看，现有政策工具更多是实现这个目标的必要条件而不是充分条件：必须出，出了以后对潜在风险会有一些边际上的缓解，但不足以完全达到预想的理想目标。接下来的问题是，什么样的政策是有可能真正有意义的？回到房地产的需求属性，居住属性方面，行业需要向居民提供明显更有吸引力的产品，尤其是在三四线城市，可能需要地方政府改变思维方式，去主动降低土地出让的容积率，让开发商提供和此前完全不一样的产品，真正满足“住得好”的需求，这一点是住建体系和房地产行业完全有能力自己去解决的。投资属性方面，行业需要向居民提供更乐观的中长期预期，要真正改变当前的中长期预期，需要看到人口趋势的改善，而大规模大体量的生育财政补贴，可能是扭转人口趋势的唯一可行手段。要注意的是，这里的讨论更多是一个“应然”的思考，并不等于这些政策就会在这个方向上出来，但如果真的有这些政策出来，相关行业的中长期展望会完全逆转。

我们基于上面的思考去调整组合，寻找内生循环中我们观察到的结构性亮点进行配置。其中航空板块我们选择做了一些波段操作，在市场预期过高时有所减仓，但近期观察到需求确实比较好，甚至有希望去启动经济内生循环后我们重新增加了配置。我们关注保险板块的机会并增加了配置，观察到的结构性亮点主要来自于保险负债端的确定性改善，确实看到了当前的大类资产表现下，保险作为资产配置选择的性价比提升。我们阶段性配置了火电板块，观察到了全球能源供需不再紧张，火电在成本端可以看到改善。

重点分享一下我们对快递板块的观点。虽然市场在担心价格战，担心竞争格局无法出清，但从我们的分析框架出发，我们观察了行业内各个玩家所处的状态，了解了为什么会有这一轮的价格竞争，测算了主要玩家在价格竞争状态下的财务状况，推演未来可能会有的变化，我们认为有相当大的可能性，近期表现上变得更激烈的竞争，会在最近一两左右，比较快的带来竞争格局的显著变化。如果这种变化出现，对快递行业而言就是非常正面的结构性变化，变化幅度也会远超大多数总需求相关的行业有可能出现的改善幅度，赔率已经非常高。同时因为担心价格战，相关标的的股价出现了明显的回调，到现在这个位置继续下行会看到非常强的业绩支撑，风险收益比已经非常有吸引力，我们也因此在报告期集中增加了快递板块的配置。

在总体组合构建的层面，我们仍然坚持低波动权益的框架，希望能尽可能降低组合波动率，提升基金持有人的持有体验。从报告期结果来看，在港股和部分行业的风险暴露让这个目标没有完全实现，我们会基于对未来基本面的判断去做出相应的调整，把握结构上有亮点的行业中出现的机会。同时评估现在的风险收益比，我们仍然坚持认为港股有非常丰富的机会，非常、非常、非常看好港股市场的未来表现。感谢基金持有人对我们一直以来的信任！

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A 基金份额净值为 0.8275 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.12%；截至本报告期末嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C 基金份额净值为 0.8184 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.29%；业绩比较基准收益率为-3.99%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	140,455,833.25	93.51
	其中：股票	140,455,833.25	93.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,670,897.02	1.11
	其中：债券	1,670,897.02	1.11
	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	7,462,213.02	4.97
8	其他资产	611,901.14	0.41
9	合计	150,200,844.43	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 65,996,901.31 元，占基金资产净值的比例为 44.15%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	4,813,964.00	3.22
C	制造业	10,980,892.82	7.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,747,636.00	5.18
E	建筑业	2,022.90	0.00
F	批发和零售业	749,594.88	0.50

G	交通运输、仓储和邮政业	40,969,231.30	27.41
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	147,551.04	0.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	9,048,039.00	6.05
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	74,458,931.94	49.81

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	26,588,050.95	17.79
非必需消费品	9,501,063.83	6.36
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	12,096,746.39	8.09
工业	6,104,964.33	4.08
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	11,706,075.81	7.83
公用事业	-	-
合计	65,996,901.31	44.15

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	700 HK	腾讯控股	47,300	14,460,961.27	9.67
2	600233	圆通速递	925,800	13,479,648.00	9.02
3	002352	顺丰控股	231,800	10,451,862.00	6.99
4	601155	新城控股	627,900	9,048,039.00	6.05
5	1030 HK	新城发展	6,392,000	9,016,743.12	6.03
6	002120	韵达股份	815,317	7,794,430.52	5.21
7	600803	新奥股份	408,200	7,747,636.00	5.18
8	1024 HK	快手-W	126,900	6,265,310.48	4.19
9	9626 HK	哔哩哔哩-W	54,480	5,861,779.20	3.92

10	1801 HK	信达生物	213,000	5,812,899.50	3.89
----	---------	------	---------	--------------	------

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	908,236.76	0.61
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）	762,660.26	0.51
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,670,897.02	1.12

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	127085	韵达转债	6,440	762,660.26	0.51
2	019694	23 国债 01	6,000	606,657.86	0.41
3	019703	23 国债 10	3,000	301,578.90	0.20

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	32,595.81
2	应收证券清算款	353,681.46
3	应收股利	223,091.95
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,531.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	611,901.14

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	181,230,443.26	7,254,841.02
报告期期间基金总申购份额	78,639.44	80,799.92
减：报告期期间基金总赎回份额	7,417,740.00	514,320.88
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	173,891,342.70	6,821,320.06

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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 7 月 20 日