

嘉实价值丰润混合型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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	9
§ 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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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
§ 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	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44

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	44
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	44
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.12 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	54
§ 11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实价值丰润混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实价值丰润混合	
基金主代码	016570	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 27 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	
报告期末基金份额总额	173,488,295.10 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实价值丰润混合 A	嘉实价值丰润混合 C
下属分级基金的交易代码	016570	016571
报告期末下属分级基金的份额总额	152,972,473.16 份	20,515,821.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用价值投资方法，精选在基本上具备核心竞争力、且市场估值水平具备相对优势的企业投资，并持续优化投资组合中风险与收益的匹配程度，力争获取中长期、持续、稳定的超额收益。
投资策略	本基金以价值投资理念为核心，根据中国股票市场的投资特点进行改良应用。首先根据不同的经济周期及市场趋势研判，决定本基金的大类资产配置以及行业偏离决策；其次在个股选择上，通过深入研究寻找优质企业，运用估值方法估算其内在投资价值，并根据国内市场的特殊性及波动性，综合考虑可能影响企业投资价值以及市场价格的所有因素，发现具备投资价值的个股。 具体投资策略包括资产配置策略、行业配置策略、股票投资策略（个股投资策略、港股通投资策略、存托凭证投资策略）、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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×65%+恒生指数收益率×15%+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，通常情况下，其长期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。

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	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588	
传真	(010)65215588	(010)66105798	
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号	
邮政编码	100020	100140	
法定代表人	经雷	陈四清	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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)	
	嘉实价值丰润混合 A	嘉实价值丰润混合 C
本期已实现收益	13,227,833.92	1,272,962.99
本期利润	407,182.74	379,372.22
加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0355
本期加权平均净值利润率	0.33%	3.34%
本期基金份额净值增长率	1.06%	0.67%

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	7,759,769.64	910,110.15
期末可供分配基金份额利润	0.0507	0.0444
期末基金资产净值	160,732,242.80	21,425,932.09
期末基金份额净值	1.0507	1.0444
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	5.07%	4.44%

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

嘉实价值丰润混合 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	3.20%	0.84%	1.42%	0.75%	1.78%	0.09%
过去三个月	-5.72%	0.77%	-4.09%	0.68%	-1.63%	0.09%
过去六个月	1.06%	0.81%	-0.50%	0.70%	1.56%	0.11%
自基金合同生效起至今	5.07%	0.76%	1.81%	0.88%	3.26%	-0.12%

嘉实价值丰润混合 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	3.14%	0.84%	1.42%	0.75%	1.72%	0.09%

过去三个月	-5.90%	0.77%	-4.09%	0.68%	-1.81%	0.09%
过去六个月	0.67%	0.81%	-0.50%	0.70%	1.17%	0.11%
自基金合同生效起 至今	4.44%	0.76%	1.81%	0.88%	2.63%	-0.12%

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：

$$\text{Return}(t) = 65\% * (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) + 15\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

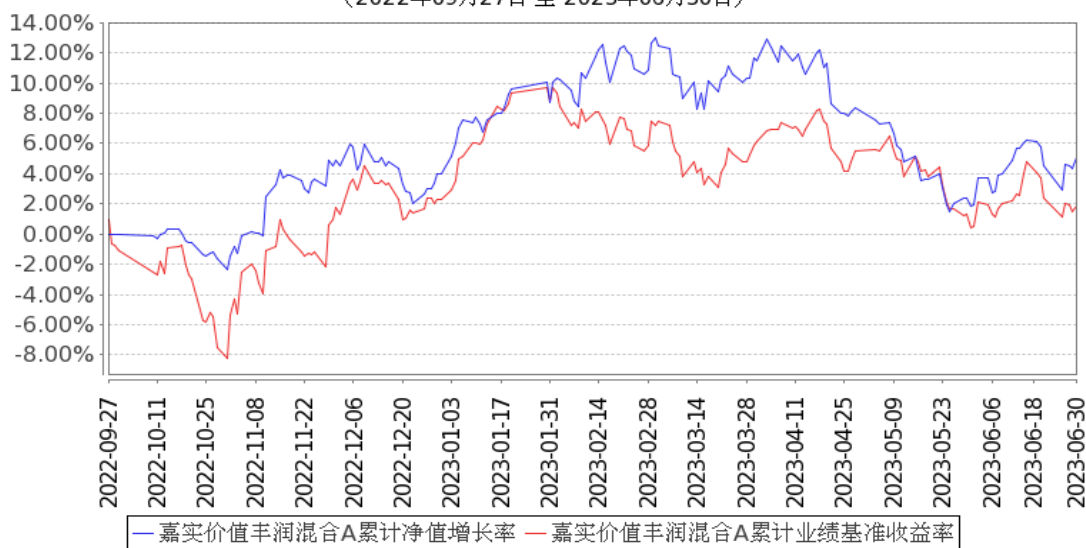
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

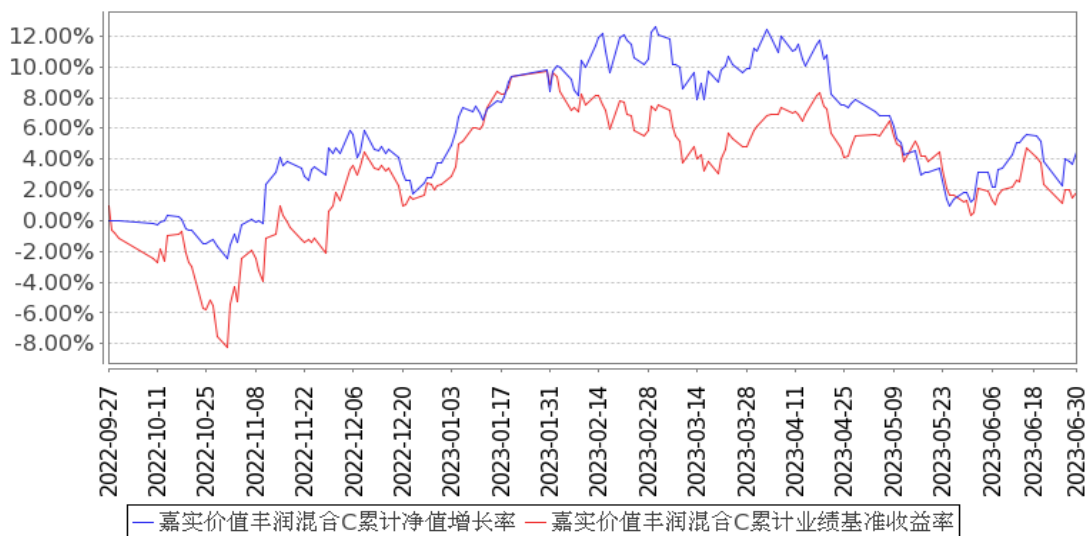
嘉实价值丰润混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年09月27日至2023年06月30日)



嘉实价值丰润混合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09月27日至2023年06月30日)



注：(1) 本基金合同生效日 2022 年 09 月 27 日至报告期末未满 1 年。

(2) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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		
吴悠	本基金、	2022 年 9	-	10 年	2012 年 7 加入嘉实基金管理有限公司，历

	嘉实丰和灵活配置混合、嘉实产业优选混合（LOF）基金经理	月 27 日			任研究部行业研究员、机构部投资经理助理，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、《嘉实价值丰润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 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

2023 年上半年市场的主要矛盾是“强预期”与“弱现实”。大致以农历春节为分界，市场呈现出截然不同的交易特征。

春节前，市场基本延续从去年四季度开始的复苏逻辑，即对于海外和国内宏观基本面的预期修复。首先，随着海外通胀增速出现见顶的迹象，市场开始预期美联储加息放缓，带动全球风险

资产估值修复，港股走出一轮强力反弹。随后，国内疫情防控和地产政策迎来实质性拐点，市场开始预期国内经济复苏，围绕“消费股的疫后复苏”和“赛道股的超跌反弹”两条主线，A 股也走出一轮普涨行情。

春节后，对国内外宏观经济的乐观预期，均遭遇了现实的挑战，市场也迎来调整。一方面，美国通胀数据的回落低于预期，美联储选择延续强力加息，在高利率环境下金融风险开始暴露，硅谷银行、瑞士信贷等风险事件先后发生，导致海外市场风险偏好快速回落，受此影响港股大幅回调。另一方面，国内从春节后逐步进入开工旺季，但高频数据显示经济复苏进程弱于预期，加上对强刺激政策的期待不断落空，市场对经济回升的信心大幅削弱，相应的 A 股指数也见顶回落。

进入二季度，市场表现进一步反应宏观经济的“弱现实”。随着各项宏观指标开始走弱，对强力刺激政策的期待也不断落空，投资者对经济复苏的前景愈发悲观，市场波动也显著加大。在相对宽松的流动性环境下，市场主线转向与经济周期弱相关的主题类资产，以“人工智能”和“中特估”为代表。相应的，市场交易也呈现出比较明显的主题炒作特征，这对基本面研究驱动的机构投资者普遍造成了更大的挑战。

报告期内，面对市场波动和预期反复，我们坚持既定的投资策略。按照之前的评估，当前股票市场的估值仍然处于低位，但基本面缺乏强力的经济周期支撑或者重大的产业趋势引领，因此预计今年市场仍将以结构性行情和个股性机会为主，而企业盈利的增长则是我们最为关注的驱动因素。回顾和反思具体的组合操作：好的方面是，我们尽量规避了“新半军”等拥挤赛道，避免了净值的重大损失。不足之处，一是我们重点配置的顺周期类资产，因为经济预期走弱，在二季度经历了较大回撤；二是我们选择的计算机、电子行业优质公司，因与主题关联度较低，没有取得预期的超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实价值丰润混合 A 基金份额净值为 1.0507 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.06%；截至本报告期末嘉实价值丰润混合 C 基金份额净值为 1.0444 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.67%；业绩比较基准收益率为-0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

后续 A 股市场的演绎，可能很大程度上仍取决于宏观经济的走势。我们在此简单谈谈自己的看法：首先，从库存周期的角度，我们认为当前经济周期仍然处于复苏象限——本轮库存周期在 2022 年中见顶，依据产业链验证，目前基本进入主动去库存的尾声，部分行业已经启动被动去库存；按照时间推演，有望在今年底或明年初重启补库存，进而带动库存周期重回上行阶段。其次，市场对复苏前景的悲观，很大程度上也来自于对政策预期的落空，而近期政策面亦开始传达积极

信号；我们认为当前经济的关键还是在于地产产业链，如果地产相关政策能够进一步托底和放松，还是能够有效提振本轮复苏的进程和强度。

展望后市，中国宏观经济遵循其内在的周期规律，大概率仍处于温和复苏的通道。随着经济复苏的前景逐步明朗，A 股市场也会在波动中逐步企稳。预计市场仍将以结构性行情为主，我们继续重点关注由盈利增长驱动的个股投资机会。当前我们看好的投资线索包括但不限于：

1) 房地产产业链：短期行业供需两端均充分出清，需求端在去年危机模式下成交量大幅回落，已显著低于长期均衡水平；供给端经历充分洗牌，多数中小型和不规范企业彻底退出。中长期竞争格局和盈利模式改善，市场份额进一步向头部央企和最优民企集中，行业加速从高杠杆高周转的高风险模式、向以产品和服务为本的稳健模式转型。目前政策面已经明显掉头，其中供给侧已经打通融资渠道，需求侧预计也会有相机抉择，行业从危机模式回归常态，有助于龙头开发商和产业链相关公司的价值回归。

2) 出行等服务型消费行业：服务型消费是今年国内需求端为数不多的亮点，国内航空酒店等量价数据已经接近甚至超过了疫情前 19 年的同期水平。疫情期间行业供给侧加快出清，有利于行业里最优秀的龙头企业扩大市场份额和领先优势。随着海外通行逐步恢复常态，明年龙头公司有望兑现更大的业绩弹性。

3) 化工机械等中游制造业：化工、机械细分行业众多，适合自下而上挖掘估值合理的优质个股。今年受益于上游原材料成本的回落，很多中游制造业企业的业绩是超预期的。目前总体上仍处于周期底部，随着宏观经济的企稳回升，可以期待下游需求改善和盈利持续恢复。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：嘉实价值丰润混合型证券投资基金

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	24,552,012.34	35,527,970.63
结算备付金		44,124.76	1,732,477.54
存出保证金		44,377.38	16,933.97
交易性金融资产	6.4.7.2	157,477,108.97	160,298,712.45
其中：股票投资		153,895,085.27	147,839,644.81
基金投资		-	-
债券投资		3,582,023.70	12,459,067.64
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	-	48,862,920.51
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		-	1,006,990.46
应收股利		440,000.00	105,600.00
应收申购款		73,959.78	4,218.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		182,631,583.23	247,555,823.69
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		3.51	376,663.48
应付赎回款		53,142.35	15,157,064.72
应付管理人报酬		221,484.25	319,134.09
应付托管费		36,914.04	53,189.03
应付销售服务费		13,165.59	15,907.77
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	6.4.7.9	148,698.60	243,415.06
负债合计		473,408.34	16,165,374.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	173,488,295.10	222,605,752.97
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,669,879.79	8,784,696.57
净资产合计		182,158,174.89	231,390,449.54
负债和净资产总计		182,631,583.23	247,555,823.69

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，嘉实价值丰润混合 A 基金份额净值 1.0507 元，基金份额总额 152,972,473.16 份，嘉实价值丰润混合 C 基金份额净值 1.0444 元，基金份额总额 20,515,821.94

份，基金份额总额合计为 173,488,295.10 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实价值丰润混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		2,103,843.66
1. 利息收入		62,569.64
其中：存款利息收入	6.4.7.13	38,772.62
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		23,797.02
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,295,352.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	13,215,115.61
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	24,779.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	2,055,457.27
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	-13,714,241.95
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	460,163.19
减：二、营业总支出		1,317,288.70
1. 管理人报酬		1,012,367.53
2. 托管费		168,727.91
3. 销售服务费		44,813.29
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	91,379.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号		786,554.96

填列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		786,554.96
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		786,554.96

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实价值丰润混合型证券投资基金

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)	222,605,752.97	-	8,784,696.57	231,390,449.54
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)	222,605,752.97	-	8,784,696.57	231,390,449.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-49,117,457.87	-	-114,816.78	-49,232,274.65
(一)、综合收益总额	-	-	786,554.96	786,554.96
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-49,117,457.87	-	-901,371.74	-50,018,829.61

（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	146,474,774.40	-	14,324,543.23	160,799,317.63
2. 基金赎回款	-195,592,232.27	-	-15,225,914.97	-210,818,147.24
（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）	173,488,295.10	-	8,669,879.79	182,158,174.89

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

嘉实价值丰润混合型证券投资基金(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[2022]1751 号《关于准予嘉实价值丰润混合型证券投资基金注册的

批复》注册，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《嘉实价值丰润混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实价值丰润混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 242,078,411.13 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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》、《嘉实价值丰润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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	24,552,012.34
等于：本金	24,549,913.68
加：应计利息	2,098.66
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	24,552,012.34

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	158,822,183.10	-	153,895,085.27	-4,927,097.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	82,373.70	3,582,023.70	-14,350.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	82,373.70	3,582,023.70	-14,350.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	162,336,183.10	82,373.70	157,477,108.97	-4,941,447.83
----	----------------	-----------	----------------	---------------

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 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	61,918.15
其中：交易所市场	61,918.15
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	148,698.60

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实价值丰润混合 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	202,590,434.63	202,590,434.63
本期申购	125,024,123.38	125,024,123.38
本期赎回（以“-”号填列）	-174,642,084.85	-174,642,084.85
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	152,972,473.16	152,972,473.16

嘉实价值丰润混合 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	20,015,318.34	20,015,318.34
本期申购	21,450,651.02	21,450,651.02
本期赎回（以“-”号填列）	-20,950,147.42	-20,950,147.42
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	20,515,821.94	20,515,821.94

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

嘉实价值丰润混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	492,855.81	7,541,598.76	8,034,454.57
本期利润	13,227,833.92	-12,820,651.18	407,182.74
本期基金份额交易产生的变动数	8,865,726.85	-9,547,594.52	-681,867.67
其中：基金申购款	16,346,337.75	-3,128,456.72	13,217,881.03
基金赎回款	-7,480,610.90	-6,419,137.80	-13,899,748.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,586,416.58	-14,826,646.94	7,759,769.64

嘉实价值丰润混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,865.75	744,376.25	750,242.00
本期利润	1,272,962.99	-893,590.77	379,372.22
本期基金份额交易产生的变动数	1,609,569.56	-1,829,073.63	-219,504.07
其中：基金申购款	2,647,312.81	-1,540,650.61	1,106,662.20
基金赎回款	-1,037,743.25	-288,423.02	-1,326,166.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,888,398.30	-1,978,288.15	910,110.15

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	33,456.19
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	4,949.67
其他	366.76
合计	38,772.62

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	13,215,115.61
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	13,215,115.61

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	135,297,611.39
减：卖出股票成本总额	121,699,370.24
减：交易费用	383,125.54
买卖股票差价收入	13,215,115.61

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	49,294.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-24,515.00
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	24,779.90

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	8,923,143.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,835,200.00
减：应计利息总额	112,458.84
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-24,515.00

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,055,457.27
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	2,055,457.27

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	-13,714,241.95
股票投资	-13,735,561.95
债券投资	21,320.00
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	-13,714,241.95

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	458,144.72
基金转出费收入	2,018.47
合计	460,163.19

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,985.42
深港通证券组合费	614.10
合计	91,379.97

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
当期发生的基金应支付的管理费	1,012,367.53
其中：支付销售机构的客户维护费	358,057.40

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 1.50%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×1.50%/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
	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	168,727.91

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		
	嘉实价值丰润混合 A	嘉实价值丰润混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	2,371.28	2,371.28
中国工商银行	-	6,557.70	6,557.70
嘉实财富	-	-	-
合计	-	8,928.98	8,928.98

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.8%，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×0.8%/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

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	24,552,012.34	33,456.19

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(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
688334	西高院	2023年6月9日	6个月	新股锁定	14.16	16.21	372	5,267.52	6,030.12	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	117	2,761.20	7,566.39	-
688429	时创能源	2023年6月20日	6个月	新股锁定	19.20	25.53	200	3,840.00	5,106.00	-

688458	美芯晟	2023年 5月15 日	6个月	新股锁定	75.00	90.76	473,525.00	4,265.72	-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	7668,502.60	13,052.64	-
688523	航天环 宇	2023年 5月26 日	6个月	新股锁定	21.86	23.85	2485,421.28	5,914.80	-
688543	国科军 工	2023年 6月14 日	6个月	新股锁定	43.67	53.05	1205,240.40	6,366.00	-
688562	航天软 件	2023年 5月15 日	6个月	新股锁定	12.68	22.31	2703,423.60	6,023.70	-
688570	天玛智 控	2023年 5月29 日	6个月	新股锁定	30.26	25.33	1735,234.98	4,382.09	-
688576	西山科 技	2023年 5月30 日	6个月	新股锁定	135.80	120.41	638,555.40	7,585.83	-
688582	芯动联 科	2023年 6月21 日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	1885,027.12	7,647.84	-
688593	新相微	2023年 5月25 日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	4605,142.80	6,711.40	-
688620	安凯微	2023年 6月15 日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	4735,051.64	5,836.82	-
688623	双元科 技	2023年 5月31 日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	526,545.76	4,513.08	-
688629	华丰科 技	2023年 6月16 日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	4824,463.32	8,960.38	-
688631	莱斯信 息	2023年 6月19 日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	1373,463.36	4,092.19	-

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

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，通常情况下，其长期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。本基金运用价值投资方法，精选在基本上具备核心竞争力、且市场估值水平具备相对优势的企业投资，并持续优化投资组合中风险与收益的匹配程度，力争获取中长期、持续、稳定的超额收益。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	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	3,582,023.70	12,459,067.64
合计	3,582,023.70	12,459,067.64

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 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	24,552,012.34	-	-	-	24,552,012.34
结算备付金	44,124.76	-	-	-	44,124.76
存出保证金	44,377.38	-	-	-	44,377.38
交易性金融资产	3,582,023.70	-	-	-153,895,085.27	157,477,108.97
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	-	-	-	440,000.00	440,000.00
应收申购款	-	-	-	73,959.78	73,959.78
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,222,538.18	-	-	-154,409,045.05	182,631,583.23
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	-	-	-	3.51	3.51
应付赎回款	-	-	-	53,142.35	53,142.35
应付管理人报酬	-	-	-	221,484.25	221,484.25
应付托管费	-	-	-	36,914.04	36,914.04
应付销售服务费	-	-	-	13,165.59	13,165.59
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	-	-	-	148,698.60	148,698.60
负债总计	-	-	-	473,408.34	473,408.34
利率敏感度缺口	28,222,538.18	-	-	-153,935,636.71	182,158,174.89
上年度末 2022年12月31日					
资产					
银行存款	35,527,970.63	-	-	-	35,527,970.63
结算备付金	1,732,477.54	-	-	-	1,732,477.54
存出保证金	16,933.97	-	-	-	16,933.97
交易性金融资产	12,459,067.64	-	-	-147,839,644.81	160,298,712.45
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	48,862,920.51	-	-	-	48,862,920.51

金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	15,640,929.71	-	15,640,929.71
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	15,640,929.71	-	15,640,929.71
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	15,640,929.71	-	15,640,929.71
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	40,306,709.57	-	40,306,709.57
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	40,306,709.57	-	40,306,709.57
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问	-	-	-	-

费				
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	40,306,709.57	-	40,306,709.57

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%	782,046.49	2,015,335.48
	所有外币相对人民币 贬值 5%	-782,046.49	-2,015,335.48

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	153,895,085.27	84.48	147,839,644.81	63.89
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	153,895,085.27	84.48	147,839,644.81	63.89

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%	8,494,429.27	5,264,249.97
	业绩比较基准下降5%	-8,494,429.27	-5,264,249.97

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	153,791,030.27	147,839,644.81
第二层次	3,582,023.70	12,459,067.64
第三层次	104,055.00	-

合计	157,477,108.97	160,298,712.45
----	----------------	----------------

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	153,895,085.27	84.27
	其中：股票	153,895,085.27	84.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,582,023.70	1.96
	其中：债券	3,582,023.70	1.96
	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	24,596,137.10	13.47
8	其他各项资产	558,337.16	0.31
9	合计	182,631,583.23	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 15,640,929.71 元，占基金资产净值的比例为 8.59%。

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	13,658,679.00	7.50
C	制造业	84,155,118.59	46.20
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	11,208,464.00	6.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,567,924.65	5.80
J	金融业	18,657,939.20	10.24
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	6,030.12	0.00
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	138,254,155.56	75.90

7.2.2 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	7,679,632.41	4.22
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	7,961,297.30	4.37

公用事业	-	-
合计	15,640,929.71	8.59

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	600060	海信视像	398,500	9,862,875.00	5.41
2	601021	春秋航空	166,000	9,540,020.00	5.24
3	601128	常熟银行	1,237,360	8,438,795.20	4.63
4	600309	万华化学	95,700	8,406,288.00	4.61
5	3900 HK	绿城中国	1,100,000	7,961,297.30	4.37
6	603383	顶点软件	138,600	7,681,212.00	4.22
7	3888 HK	金山软件	270,000	7,679,632.41	4.22
8	002028	思源电气	157,100	7,339,712.00	4.03
9	002372	伟星新材	340,500	6,993,870.00	3.84
10	002078	太阳纸业	644,890	6,893,874.10	3.78
11	601857	中国石油	895,500	6,689,385.00	3.67
12	300415	伊之密	300,100	5,761,920.00	3.16
13	600166	福田汽车	1,671,800	5,684,120.00	3.12
14	300628	亿联网络	152,440	5,346,070.80	2.93
15	002541	鸿路钢构	184,900	5,326,969.00	2.92
16	002791	坚朗五金	82,000	5,306,220.00	2.91
17	601328	交通银行	900,200	5,221,160.00	2.87
18	600486	扬农化工	58,798	5,140,121.16	2.82
19	601939	建设银行	798,400	4,997,984.00	2.74
20	600583	海油工程	737,000	4,311,450.00	2.37
21	600183	生益科技	299,300	4,250,060.00	2.33
22	688323	瑞华泰	128,900	3,085,866.00	1.69
23	688201	信安世纪	66,366	2,836,482.84	1.56
24	688166	博瑞医药	123,681	2,719,745.19	1.49
25	600028	中国石化	417,900	2,657,844.00	1.46
26	603901	永创智能	124,900	1,818,544.00	1.00
27	002468	申通快递	154,200	1,668,444.00	0.92
28	688582	芯动联科	1,874	86,636.94	0.05
29	688429	时创能源	1,995	57,071.25	0.03
30	688631	莱斯信息	1,369	44,206.11	0.02
31	688472	阿特斯	766	13,052.64	0.01
32	688629	华丰科技	482	8,960.38	0.00
33	688576	西山科技	63	7,585.83	0.00
34	688361	中科飞测	117	7,566.39	0.00
35	688593	新相微	460	6,711.40	0.00
36	688543	国科军工	120	6,366.00	0.00
37	688334	西高院	372	6,030.12	0.00
38	688562	航天软件	270	6,023.70	0.00

39	688523	航天环宇	248	5,914.80	0.00
40	688620	安凯微	473	5,836.82	0.00
41	688623	二元科技	52	4,513.08	0.00
42	688570	天玛智控	173	4,382.09	0.00
43	688458	美芯晟	47	4,265.72	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	601021	春秋航空	9,751,095.70	4.21
2	002541	鸿路钢构	9,289,277.85	4.01
3	3900 HK	绿城中国	7,453,825.56	3.22
4	601857	中国石油	6,721,970.76	2.91
5	603383	顶点软件	6,103,829.00	2.64
6	600309	万华化学	5,858,170.00	2.53
7	601128	常熟银行	5,852,618.66	2.53
8	600166	福田汽车	5,792,630.00	2.50
9	600183	生益科技	5,490,442.00	2.37
10	3888 HK	金山软件	5,336,605.31	2.31
11	300628	亿联网络	5,108,460.00	2.21
12	601328	交通银行	5,087,748.00	2.20
13	601939	建设银行	5,055,886.00	2.19
14	300415	伊之密	4,898,817.83	2.12
15	600583	海油工程	4,809,918.00	2.08
16	002028	思源电气	4,628,003.00	2.00
17	002791	坚朗五金	4,575,300.00	1.98
18	002078	太阳纸业	4,312,894.00	1.86
19	002372	伟星新材	4,098,158.00	1.77
20	600486	扬农化工	3,816,679.10	1.65

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	700 HK	腾讯控股	8,683,233.00	3.75
2	300628	亿联网络	8,249,414.00	3.57
3	960 HK	龙湖集团	8,168,858.23	3.53
4	3888 HK	金山软件	7,326,588.16	3.17
5	601128	常熟银行	6,752,880.41	2.92
6	285 HK	比亚迪电子	6,729,785.00	2.91
7	002372	伟星新材	6,428,166.00	2.78
8	002078	太阳纸业	6,174,257.38	2.67

9	600060	海信视像	6,102,039.00	2.64
10	603383	顶点软件	5,653,869.00	2.44
11	600309	万华化学	4,857,288.00	2.10
12	3900 HK	绿城中国	4,719,881.50	2.04
13	688201	信安世纪	4,681,752.36	2.02
14	300415	伊之密	4,599,015.32	1.99
15	002028	思源电气	4,588,073.04	1.98
16	300496	中科创达	4,385,828.91	1.90
17	600486	扬农化工	4,204,476.88	1.82
18	1800 HK	中国交通建设	4,045,767.30	1.75
19	002791	坚朗五金	4,015,139.00	1.74
20	603901	永创智能	3,562,725.05	1.54

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	141,490,372.65
卖出股票收入（成交）总额	135,297,611.39

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	3,582,023.70	1.97
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	3,582,023.70	1.97

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	019638	20 国债 09	35,000	3,582,023.70	1.97

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	44,377.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	440,000.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	73,959.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	558,337.16

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 (%)
嘉实价值丰润混合 A	628	243,586.74	109,862,816.39	71.82	43,109,656.77	28.18
嘉实价值丰润混合 C	2,820	7,275.11	10,530,872.51	51.33	9,984,949.43	48.67
合计	3,425	50,653.52	120,393,688.90	69.40	53,094,606.20	30.60

注：(1)嘉实价值丰润混合 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价值丰润混合 A 份额占嘉实价值丰润混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实价值丰润混合 A 份额占嘉实价值丰润混合 A 总份额比例；

(2)嘉实价值丰润混合 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价值丰润混合 C 份额占嘉实价值丰润混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实价值丰润混合 C 份额占嘉实价值丰润混合 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	嘉实价值丰润混合 A	2,209,489.61	1.44
	嘉实价值丰润混合 C	56,421.67	0.28
	合计	2,265,911.28	1.31

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	嘉实价值丰润混合 A	>=100
	嘉实价值丰润混合 C	0
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实价值丰润混合 A	10~50
	嘉实价值丰润混合 C	0
	合计	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实价值丰润混合 A	嘉实价值丰润混合 C
基金合同生效日 (2022 年 9 月 27 日) 基金份额总额	219,333,557.01	22,744,854.12
本报告期期初基金份额总额	202,590,434.63	20,015,318.34
本报告期基金总申购份额	125,024,123.38	21,450,651.02
减：本报告期基金总赎回份额	174,642,084.85	20,950,147.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	152,972,473.16	20,515,821.94

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

本报告期内托管人及其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 (%)	
浙商证券股份有限公司	2	92,741,354.41	33.64	62,515.74	33.10	-
海通证券股份有限公司	3	40,704,053.85	14.76	28,493.01	15.08	-
中国国际金融股份有限公司	2	40,450,593.97	14.67	28,315.53	14.99	-
招商证券	2	30,249,640.4	10.97	21,174.96	11.21	-

股份有限 公司		5				
民生证券 股份有限 公司	1	22,593,249.7 4	8.20	15,815.27	8.37	-
开源证券 股份有限 公司	2	19,810,383.5 1	7.19	13,867.31	7.34	-
国盛证券 有限责任 公司	4	14,662,247.4 2	5.32	9,256.63	4.90	-
天风证券 股份有限 公司	2	9,897,841.55	3.59	6,248.47	3.31	-
国泰君安 证券股份 有限公司	3	4,570,729.50	1.66	3,199.64	1.69	-
安信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券有 限责任公 司	2	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
广发证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
中信证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
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. 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：长江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，广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国盛证券有限责任公司新增交易单元 2 个，华泰证券股份有限公司新增交易单元 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(%)
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国	7,509,406.0	85.23	-	-	-	-

际金融 股份有 限公司	0						
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	1,301,279.0 0	14.77	-	-	-	-	-
开源证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-	-
安信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 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	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

司						
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于调整旗下	证券时报、基金管理人	2023年3月16日

	部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
2	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 21 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 20 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实价值丰润混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实价值丰润混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实价值丰润混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实价值丰润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) 报告期内嘉实价值丰润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

2023 年 8 月 29 日