

嘉实低价策略股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
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	10
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	16
§ 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	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实低价策略股票型证券投资基金
基金简称	嘉实低价策略股票
基金主代码	001577
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 27 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	118,284,930.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用低价策略优选个股,在严格控制投资风险的前提下,力争获得超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	对于股票市场,我们相信其长期是有效的,股票市场是经济的晴雨表,并能在长期内反应行业和企业应有的价值;股票市场短期也是有效的,反应了信息的传递和反馈的情绪;但股票市场中期是失效的,往往由于风格轮换、波动、经济和行业周期波动等原因,带来错误定价,这个时间段为投资带来较好的阶段,即以便宜的价格买到优质的资产。这时的错误定价优质股的表现特征往往是低股价、低估值,因此本基金将主要聚焦低股价、低估值股票。具体策略包括:大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金,属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-600-8800	021-60637228
传真	(010)65215588	021-60635778
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	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100020	100033

法定代表人	经雷	田国立
-------	----	-----

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	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)
本期已实现收益	13,128,276.84
本期利润	-296,871.91
加权平均基金份额本期利润	-0.0022
本期加权平均净值利润率	-0.10%
本期基金份额净值增长率	0.78%
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	141,695,661.23
期末可供分配基金份额利润	1.1979
期末基金资产净值	259,980,591.48
期末基金份额净值	2.198
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	119.80%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④

过去一个月	0.73%	0.76%	1.04%	0.69%	-0.31%	0.07%
过去三个月	-2.74%	0.84%	-3.77%	0.66%	1.03%	0.18%
过去六个月	0.78%	0.82%	0.00%	0.67%	0.78%	0.15%
过去一年	-1.66%	0.94%	-10.72%	0.79%	9.06%	0.15%
过去三年	34.27%	1.15%	-3.19%	0.96%	37.46%	0.19%
自基金合同生效起至今	119.80%	1.31%	2.64%	1.05%	117.16%	0.26%

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：

$$\text{Return}(t) = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

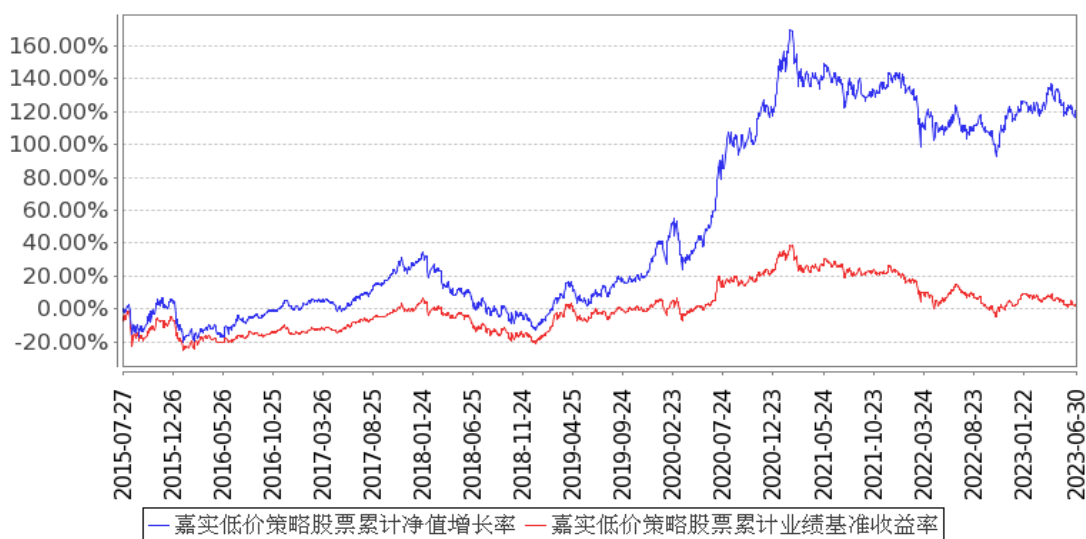
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

嘉实低价策略股票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

(2015年07月27日至2023年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 314 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
栾峰	本基金、嘉实稳健混合基金经理	2020 年 10 月 19 日	-	14 年	2008 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，历任行业研究员、投资经理。硕士研究生，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、《嘉实低价策略股票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

上半年国内权益市场较为活跃，由于经济尚处于恢复初期，多数经济相关度较高的公司业绩趋势并不明朗，在宏观流动性较为充裕的背景下，权益市场呈现出较为明显的主题投资的特点：例如人工智能概念相关的不少股票在没有清晰盈利空间的情形下股价出现大幅上涨，以及小市值股票表现系统性优于大市值股票。除了主题投资之外，以“中特估”为代表的高股息类资产在上半年也有相对不错的表现，背后的原因一方面是国债收益率下降凸显了这一类资产的吸引力，另一方面部分传统行业龙头经过了资本开支的高峰期之后，良好的竞争格局和稳定的盈利能力带来巨大的自由现金流创造能力，也具备了高分红的客观条件。基于对经济周期位置和增长中枢的判断，我们在上半年主要增加了高股息类和逆周期类资产的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.198 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.78%，业绩比较基准收益率为 0.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着 7 月下旬一系列稳定信心和经济的政策举措陆续出台，以及库存周期对经济带来的内生修复的驱动，我们认为可以对经济走势乐观一些，那些因为之前对经济的悲观预期导致估值收缩的行业和公司可能会进入较为有利的投资窗口期。同时我们也认为在经济复苏的背景下，前期主题投资占优的风格也会有所调整，市场的关注点可能重新聚焦在公司业绩上。

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

力和相关工作经历。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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：嘉实低价策略股票型证券投资基金

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	35,362,797.23	18,573,722.99

结算备付金		233,877.37	566,549.20
存出保证金		65,273.04	45,825.77
交易性金融资产	6.4.7.2	222,861,032.33	245,119,653.13
其中：股票投资		222,679,496.08	244,946,388.52
基金投资		-	-
债券投资		181,536.25	173,264.61
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		2,625,428.25	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,242.19	24,647.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		261,158,650.41	264,330,398.55
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		-	-
应付赎回款		570,129.90	47,800.97
应付管理人报酬		338,287.25	335,215.03
应付托管费		56,381.22	55,869.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1.63	0.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	213,258.93	304,905.48
负债合计		1,178,058.93	743,791.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	118,284,930.25	120,846,959.57
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	141,695,661.23	142,739,647.66
净资产合计		259,980,591.48	263,586,607.23
负债和净资产总计		261,158,650.41	264,330,398.55

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.198 元，基金份额总额 118,284,930.25 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实低价策略股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,451,522.90	-11,235,952.43
1. 利息收入		61,146.77	37,154.54
其中：存款利息收入	6.4.7.13	61,146.77	37,154.54
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,544,594.61	318,631.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	10,931,191.16	-1,828,410.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	116.96	29.60
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	4,613,286.49	2,147,011.99
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	-13,425,148.75	-11,620,317.27
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	270,930.27	28,578.94

减：二、营业总支出		2,748,394.81	1,457,462.45
1. 管理人报酬		2,272,103.04	1,166,346.11
2. 托管费		378,683.82	194,390.98
3. 销售服务费		-	-
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		0.52	0.04
8. 其他费用	6.4.7.23	97,607.43	96,725.32
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-296,871.91	-12,693,414.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-296,871.91	-12,693,414.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-296,871.91	-12,693,414.88

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实低价策略股票型证券投资基金

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)	120,846,959.57	-	142,739,647.66	263,586,607.23
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)	120,846,959.57	-	142,739,647.66	263,586,607.23

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,562,029.32	-	-1,043,986.43	-3,606,015.75
(一)、综合收益总额	-	-	-296,871.91	-296,871.91
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,562,029.32	-	-747,114.52	-3,309,143.84
其中:1.基金申购款	49,154,966.77	-	61,567,354.15	110,722,320.92
2.基金赎回款	-51,716,996.09	-	-62,314,468.67	-114,031,464.76
(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	118,284,930.25	-	141,695,661.23	259,980,591.48

金净值)				
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	69,509,848.72	-	98,841,326.09	168,351,174.81
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	69,509,848.72	-	98,841,326.09	168,351,174.81
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,650,147.49	-	-10,929,255.30	-9,279,107.81
(一)、综合收益总额	-	-	-12,693,414.88	-12,693,414.88
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,650,147.49	-	1,764,159.58	3,414,307.07
其中:1.基金申购款	8,468,841.28	-	9,827,069.09	18,295,910.37
2.基金赎回	-6,818,693.79	-	-8,062,909.51	-14,881,603.30

回款				
(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)	71,159,996.21	-	87,912,070.79	159,072,067.00

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

嘉实低价策略股票型证券投资基金(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[2015]1341号《关于准予嘉实低价策略股票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《嘉实低价策略股票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,《嘉实低价策略股票型证券投资基金基金合同》于2015年7月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为746,462,455.76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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》、《嘉实低价策略股票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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税

法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	35,362,797.23
等于：本金	35,359,511.84
加：应计利息	3,285.39
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	35,362,797.23

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	225,358,770.25	-	222,679,496.08	-2,679,274.17
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	49.35	181,536.25	17,486.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	49.35	181,536.25	17,486.90
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	225,522,770.25	49.35	222,861,032.33	-2,661,787.27

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	949.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	125,529.03
其中：交易所市场	125,529.03
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	213,258.93

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	120,846,959.57	120,846,959.57
本期申购	49,154,966.77	49,154,966.77
本期赎回 (以“-”号填列)	-51,716,996.09	-51,716,996.09
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	118,284,930.25	118,284,930.25

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	170,334,940.71	-27,595,293.05	142,739,647.66
本期利润	13,128,276.84	-13,425,148.75	-296,871.91
本期基金份额交易产生的变动数	-5,257,448.98	4,510,334.46	-747,114.52
其中：基金申购款	69,704,321.68	-8,136,967.53	61,567,354.15
基金赎回款	-74,961,770.66	12,647,301.99	-62,314,468.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	178,205,768.57	-36,510,107.34	141,695,661.23

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	56,842.76
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	3,136.80
其他	1,167.21
合计	61,146.77

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	10,931,191.16
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	10,931,191.16

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	281,329,457.85
减：卖出股票成本总额	269,719,732.71
减：交易费用	678,533.98
买卖股票差价收入	10,931,191.16

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	116.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	116.96

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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	4,613,286.49
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	4,613,286.49

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	-13,425,148.75

股票投资	-13,433,445.95
债券投资	8,297.20
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	-13,425,148.75

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	268,601.20
基金转出费收入	2,329.07
合计	270,930.27

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	1,826.98
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	97,607.43

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,272,103.04	1,166,346.11
其中：支付销售机构的客户维护费	541,886.36	334,433.44

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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
当期发生的基金应支付的托管费	378,683.82		194,390.98	

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。

6.4.10.3 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		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司_活期	35,362,797.23	56,842.76	10,103,359.05	35,502.85

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
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023年3月31日	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股锁定	11.88	21.02	465	5,524.20	9,774.30	-
001324	长青科技	2023年5月12日	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023年6月15日	6个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股锁定	41.20	42.69	254	10,464.80	10,843.26	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	141	7,966.50	7,463.13	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股锁定	34.00	34.93	222	7,548.00	7,754.46	-

		日								
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月内(含)	新发未上市	25.82	25.82	2,083	53,783.06	53,783.06	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	6个月	新股锁定	25.82	25.82	232	5,990.24	5,990.24	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股锁定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	298	14,900.00	9,151.58	-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	492	15,178.20	11,625.96	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月内(含)	新发未上市	36.90	36.90	1,496	55,202.40	55,202.40	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个月	新股锁定	36.90	36.90	167	6,162.30	6,162.30	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股锁定	30.22	25.50	429	12,964.38	10,939.50	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股锁定	29.60	71.42	296	8,761.60	21,140.32	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	8.96	2,100	10,500.00	18,816.00	-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	476	12,756.80	10,624.32	-
301310	鑫宏业	2023年5月26日	6个月	新股锁定	67.28	65.43	269	18,098.32	17,600.67	-
301315	威士顿	2023年6月13日	6个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-

		日									
301320	豪江智能	2023年6月1日	6个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04		-
301322	绿通科技	2023年2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	135	11,799.90	7,187.40		-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股锁定	39.06	39.36	197	7,694.82	7,753.92		-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股锁定	14.81	13.73	738	10,929.78	10,132.74		-
301337	亚华电子	2023年5月16日	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84		-
301355	南王科技	2023年6月2日	6个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25		-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股锁定	50.00	48.39	165	8,250.00	7,984.35		-
301358	湖南裕能	2023年2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	348	8,271.96	14,925.72		-
301360	荣旗科技	2023年4月17日	6个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40		-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股锁定	33.73	31.85	239	8,061.47	7,612.15		-
301376	致欧科技	2023年6月14日	6个月	新股锁定	24.66	22.51	360	8,877.60	8,103.60		-
301382	蜂助手	2023年5月9日	6个月	新股锁定	23.80	32.84	340	8,092.00	11,165.60		-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股锁定	46.16	35.72	383	17,679.28	13,680.76		-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	309	9,266.91	7,351.11		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月内(含)	新发未上市	26.68	26.68	3,507	93,566.76	93,566.76		-
301395	仁信新材	2023年6月21日	6个月	新股锁定	26.68	26.68	390	10,405.20	10,405.20		-

301408	华人健康	2023年 2月22 日	6个月	新股锁 定	16.24	16.95	640	10,393.60	10,848.00	-
301419	阿莱德	2023年 2月2日	6个月	新股锁 定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒 通	2023年 5月10 日	6个月	新股锁 定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电 力	2023年 3月10 日	6个月	新股锁 定	19.99	16.90	361	7,216.39	6,100.90	-
601061	中信金 属	2023年 3月30 日	6个月	新股锁 定	6.58	7.58	1,031	6,783.98	7,814.98	-
601065	江盐集 团	2023年 3月31 日	6个月	新股锁 定	10.36	11.84	388	4,019.68	4,593.92	-
601133	柏诚股 份	2023年 3月31 日	6个月	新股锁 定	11.66	12.26	289	3,369.74	3,543.14	-
603125	常青科 技	2023年 3月30 日	6个月	新股锁 定	25.98	24.53	109	2,831.82	2,673.77	-
603172	万丰股 份	2023年 4月28 日	6个月	新股锁 定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特 气	2023年 4月13 日	6个月	新股锁 定	36.15	38.13	311	11,242.65	11,858.43	-
688249	晶合集 成	2023年 4月24 日	6个月	新股锁 定	19.86	18.06	1,716	34,079.76	30,990.96	-
688334	西高院	2023年 6月9日	6个月	新股锁 定	14.16	16.21	706	9,996.96	11,444.26	-
688352	颀中科 技	2023年 4月11 日	6个月	新股锁 定	12.10	12.07	925	11,192.50	11,164.75	-
688361	中科飞 测	2023年 5月12 日	6个月	新股锁 定	23.60	64.67	303	7,150.80	19,595.01	-
688429	时创能 源	2023年 6月20 日	6个月	新股锁 定	19.20	25.53	324	6,220.80	8,271.72	-
688433	华曙高	2023年	6个月	新股锁	26.66	31.50	310	8,264.60	9,765.00	-

	科	4月7日		定							
688458	美芯晟	2023年 5月15日	6个月	新股锁 定	75.00	90.76	127	9,525.00	11,526.52		-
688469	中芯集 成	2023年 4月28日	6个月	新股锁 定	5.69	5.41	3,595	20,455.55	19,448.95		-
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股锁 定	11.10	17.04	1,468	16,294.80	25,014.72		-
688478	晶升股 份	2023年 4月13日	6个月	新股锁 定	32.52	42.37	342	11,121.84	14,490.54		-
688479	友车科 技	2023年 5月4日	6个月	新股锁 定	33.99	29.49	230	7,817.70	6,782.70		-
688484	南芯科 技	2023年 3月28日	6个月	新股锁 定	39.99	36.71	312	12,476.88	11,453.52		-
688507	索辰科 技	2023年 4月10日	6个月	新股锁 定	245.56	122.11	80	13,260.24	9,768.80		-
688512	慧智微	2023年 5月8日	6个月	新股锁 定	20.92	19.16	447	9,351.24	8,564.52		-
688523	航天环 宇	2023年 5月26日	6个月	新股锁 定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20		-
688535	华海诚 科	2023年 3月28日	6个月	新股锁 定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03		-
688543	国科军 工	2023年 6月14日	6个月	新股锁 定	43.67	53.05	202	8,821.34	10,716.10		-
688552	航天南 湖	2023年 5月8日	6个月	新股锁 定	21.17	23.50	448	9,484.16	10,528.00		-
688562	航天软 件	2023年 5月15日	6个月	新股锁 定	12.68	22.31	697	8,837.96	15,550.07		-
688570	天玛智 控	2023年 5月29日	6个月	新股锁 定	30.26	25.33	339	10,258.14	8,586.87		-
688576	西山科 技	2023年 5月30日	6个月	新股锁 定	135.80	120.41	126	17,110.80	15,171.66		-
688581	安杰思	2023年 5月12日	6个月	新股锁 定	125.80	118.03	78	9,812.40	9,206.34		-

		日								
688582	芯动联科	2023年 6月21 日	6个月	新股锁定	26.74	40.68	300	8,022.00	12,204.00	-
688593	新相微	2023年 5月25 日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	890	9,950.20	12,985.10	-
688620	安凯微	2023年 6月15 日	6个月	新股锁定	10.68	12.34	788	8,415.84	9,723.92	-
688623	双元科技	2023年 5月31 日	6个月	新股锁定	125.88	86.79	95	11,958.60	8,245.05	-
688629	华丰科技	2023年 6月16 日	6个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023年 6月19 日	6个月	新股锁定	25.28	29.87	230	5,814.40	6,870.10	-

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

本基金为股票型证券投资基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。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采用低价策略

优选个股，在严格控制投资风险的前提下，力争获得超过业绩比较基准的投资回报。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

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	162,694.57	155,036.35
AAA 以下	18,841.68	18,228.26
未评级	-	-
合计	181,536.25	173,264.61

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时间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	35,362,797.23	-	-	-	35,362,797.23
结算备付金	233,877.37	-	-	-	233,877.37
存出保证金	65,273.04	-	-	-	65,273.04
交易性金融资产	-	181,536.25	-	-222,679,496.08	222,861,032.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,625,428.25	2,625,428.25
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,242.19	10,242.19
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,661,947.64	181,536.25	-	-225,315,166.52	261,158,650.41
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	570,129.90	570,129.90
应付管理人报酬	-	-	-	338,287.25	338,287.25
应付托管费	-	-	-	56,381.22	56,381.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.63	1.63
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	213,258.93	213,258.93
负债总计	-	-	-	1,178,058.93	1,178,058.93
利率敏感度缺口	35,661,947.64	181,536.25	-	-224,137,107.59	259,980,591.48
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,573,722.99	-	-	-	18,573,722.99
结算备付金	566,549.20	-	-	-	566,549.20
存出保证金	45,825.77	-	-	-	45,825.77
交易性金融资产	-	173,264.61	-	-244,946,388.52	245,119,653.13
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	-	-	-	24,647.46	24,647.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	19,186,097.96	173,264.61	-	-244,971,035.98	264,330,398.55
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	47,800.97	47,800.97
应付管理人报酬	-	-	-	335,215.03	335,215.03
应付托管费	-	-	-	55,869.15	55,869.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.69	0.69
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,905.48	304,905.48
负债总计	-	-	-	743,791.32	743,791.32

利率敏感度缺口	19,186,097.96	173,264.61	-244,227,244.66	263,586,607.23
---------	---------------	------------	-----------------	----------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-1,793.29	-1,903.42
	市场利率下降 25 个基点	1,815.81	1,929.44

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交

易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	222,679,496.08	85.65	244,946,388.52	92.93
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	222,679,496.08	85.65	244,946,388.52	92.93

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%	13,039,040.11	13,212,902.63
	业绩比较基准下降5%	-13,039,040.11	-13,212,902.63

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	221,858,912.93	244,766,716.13
第二层次	225,109.96	-
第三层次	777,009.44	352,937.00
合计	222,861,032.33	245,119,653.13

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	222,679,496.08	85.27
	其中：股票	222,679,496.08	85.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	181,536.25	0.07
	其中：债券	181,536.25	0.07
	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	35,596,674.60	13.63
8	其他各项资产	2,700,943.48	1.03
9	合计	261,158,650.41	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	7,434,143.00	2.86
C	制造业	70,757,315.25	27.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,040,350.47	9.63
E	建筑业	29,494,002.14	11.34
F	批发和零售业	2,612,536.07	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	8,214,428.92	3.16
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,992,899.68	1.92
J	金融业	52,667,096.54	20.26
K	房地产业	17,125,617.00	6.59
L	租赁和商务服务业	5,374.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	4,306,852.69	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	21,140.32	0.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	222,679,496.08	85.65

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	000333	美的集团	285,700	16,833,444.00	6.47
2	601668	中国建筑	2,692,200	15,453,228.00	5.94
3	601318	中国平安	329,400	15,284,160.00	5.88
4	002415	海康威视	415,133	13,745,053.63	5.29
5	600048	保利发展	933,400	12,162,202.00	4.68
6	601601	中国太保	451,600	11,732,568.00	4.51
7	600886	国投电力	791,400	10,011,210.00	3.85
8	600023	浙能电力	1,956,300	9,918,441.00	3.82
9	600919	江苏银行	1,282,800	9,428,580.00	3.63
10	600486	扬农化工	104,400	9,126,648.00	3.51
11	002078	太阳纸业	845,114	9,034,268.66	3.47
12	600036	招商银行	271,000	8,877,960.00	3.41
13	600426	华鲁恒升	270,380	8,281,739.40	3.19
14	002352	顺丰控股	182,088	8,210,347.92	3.16
15	600309	万华化学	84,700	7,440,048.00	2.86
16	601398	工商银行	1,522,600	7,338,932.00	2.82
17	601186	中国铁建	743,900	7,327,415.00	2.82
18	601390	中国中铁	885,200	6,709,816.00	2.58
19	300750	宁德时代	23,200	5,307,928.00	2.04
20	600803	新奥股份	267,400	5,075,252.00	1.95
21	600325	华发股份	503,900	4,963,415.00	1.91
22	002410	广联达	150,360	4,885,196.40	1.88
23	603259	药明康德	68,800	4,286,928.00	1.65
24	600583	海油工程	669,800	3,918,330.00	1.51
25	601899	紫金矿业	309,100	3,514,467.00	1.35
26	603368	柳药集团	104,000	2,569,840.00	0.99
27	301395	仁信新材	3,897	103,971.96	0.04
28	301261	恒工精密	1,663	61,364.70	0.02
29	301202	朗威股份	2,315	59,773.30	0.02
30	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
31	688249	晶合集成	1,716	30,990.96	0.01
32	688472	阿特斯	1,468	25,014.72	0.01

33	301293	三博脑科	296	21,140.32	0.01
34	688361	中科飞测	303	19,595.01	0.01
35	688469	中芯集成	3,595	19,448.95	0.01
36	301301	川宁生物	2,100	18,816.00	0.01
37	301310	鑫宏业	269	17,600.67	0.01
38	688562	航天软件	697	15,550.07	0.01
39	688576	西山科技	126	15,171.66	0.01
40	301358	湖南裕能	348	14,925.72	0.01
41	688478	晶升股份	342	14,490.54	0.01
42	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.01
43	301383	天键股份	383	13,680.76	0.01
44	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.01
45	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.01
46	688593	新相微	890	12,985.10	0.00
47	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
48	688582	芯动联科	300	12,204.00	0.00
49	688146	中船特气	311	11,858.43	0.00
50	301260	格力博	492	11,625.96	0.00
51	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
52	688458	美芯晟	127	11,526.52	0.00
53	688484	南芯科技	312	11,453.52	0.00
54	688334	西高院	706	11,444.26	0.00
55	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
56	301382	蜂助手	340	11,165.60	0.00
57	688352	颀中科技	925	11,164.75	0.00
58	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
59	301262	海看股份	429	10,939.50	0.00
60	301408	华人健康	640	10,848.00	0.00
61	301141	中科磁业	254	10,843.26	0.00
62	688543	国科军工	202	10,716.10	0.00
63	301303	真兰仪表	476	10,624.32	0.00
64	688552	航天南湖	448	10,528.00	0.00
65	301391	卡莱特	89	10,428.13	0.00
66	301332	德尔玛	738	10,132.74	0.00
67	001287	中电港	465	9,774.30	0.00
68	688507	索辰科技	80	9,768.80	0.00
69	688433	华曙高科	310	9,765.00	0.00
70	688620	安凯微	788	9,723.92	0.00
71	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
72	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
73	688581	安杰思	78	9,206.34	0.00
74	301246	宏源药业	298	9,151.58	0.00
75	688570	天玛智控	339	8,586.87	0.00

76	688512	慧智微	447	8,564.52	0.00
77	688429	时创能源	324	8,271.72	0.00
78	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
79	688623	双元科技	95	8,245.05	0.00
80	301376	致欧科技	360	8,103.60	0.00
81	301357	北方长龙	165	7,984.35	0.00
82	601061	中信金属	1,031	7,814.98	0.00
83	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
84	301170	锡南科技	222	7,754.46	0.00
85	301323	新莱福	197	7,753.92	0.00
86	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
87	301373	凌玮科技	239	7,612.15	0.00
88	301157	华塑科技	141	7,463.13	0.00
89	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
90	301386	未来电器	309	7,351.11	0.00
91	301322	绿通科技	135	7,187.40	0.00
92	301290	东星医疗	220	7,051.00	0.00
93	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
94	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
95	688631	莱斯信息	230	6,870.10	0.00
96	688479	友车科技	230	6,782.70	0.00
97	301265	华新环保	531	6,170.22	0.00
98	301439	泓淋电力	361	6,100.90	0.00
99	000977	浪潮信息	112	5,432.00	0.00
100	301091	深城交	291	5,389.32	0.00
101	301102	兆讯传媒	200	5,374.00	0.00
102	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
103	603730	岱美股份	317	5,008.60	0.00
104	301179	泽宇智能	146	4,920.20	0.00
105	301221	光庭信息	88	4,913.04	0.00
106	301068	大地海洋	144	4,839.84	0.00
107	301033	迈普医学	108	4,747.68	0.00
108	301193	家联科技	264	4,627.92	0.00
109	601065	江盐集团	388	4,593.92	0.00
110	301181	标榜股份	148	4,453.32	0.00
111	301182	凯旺科技	186	4,272.42	0.00
112	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
113	301087	可孚医疗	86	4,239.80	0.00
114	301207	华兰疫苗	126	4,190.76	0.00
115	300992	泰福泵业	200	4,024.00	0.00
116	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
117	301079	邵阳液压	182	3,880.24	0.00
118	301200	大族数控	97	3,868.36	0.00

119	301037	保立佳	212	3,777.84	0.00
120	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
121	301201	诚达药业	86	3,543.20	0.00
122	601133	柏诚股份	289	3,543.14	0.00
123	002595	豪迈科技	100	3,513.00	0.00
124	301100	风光股份	169	3,491.54	0.00
125	002555	三七互娱	100	3,488.00	0.00
126	000963	华东医药	80	3,469.60	0.00
127	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
128	002180	纳思达	100	3,425.00	0.00
129	301123	奕东电子	131	3,345.74	0.00
130	600332	白云山	100	3,188.00	0.00
131	301096	百诚医药	51	3,091.11	0.00
132	301190	善水科技	159	2,987.61	0.00
133	600315	上海家化	100	2,901.00	0.00
134	301093	华兰股份	82	2,837.20	0.00
135	301189	奥尼电子	92	2,814.28	0.00
136	301036	双乐股份	146	2,734.58	0.00
137	000034	神州数码	101	2,685.59	0.00
138	603125	常青科技	109	2,673.77	0.00
139	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
140	002624	完美世界	150	2,533.50	0.00
141	601138	工业富联	100	2,520.00	0.00
142	300834	星辉环材	102	2,488.80	0.00
143	002773	康弘药业	119	2,275.28	0.00
144	002156	通富微电	100	2,260.00	0.00
145	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
146	002001	新和成	144	2,217.60	0.00
147	600884	杉杉股份	145	2,195.30	0.00
148	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
149	301219	腾远钴业	56	2,092.16	0.00
150	603809	豪能股份	182	2,043.86	0.00
151	300136	信维通信	100	2,008.00	0.00
152	002236	大华股份	100	1,975.00	0.00
153	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
154	300415	伊之密	100	1,920.00	0.00
155	301196	唯科科技	55	1,867.25	0.00
156	002572	索菲亚	100	1,742.00	0.00
157	002174	游族网络	100	1,680.00	0.00
158	002601	龙佰集团	100	1,650.00	0.00
159	603885	吉祥航空	100	1,543.00	0.00
160	600233	圆通速递	100	1,456.00	0.00
161	601211	国泰君安	100	1,399.00	0.00

162	600988	赤峰黄金	100	1,346.00	0.00
163	600312	平高电气	100	1,239.00	0.00
164	601881	中国银河	100	1,161.00	0.00
165	601788	光大证券	71	1,128.19	0.00
166	002468	申通快递	100	1,082.00	0.00
166	300253	卫宁健康	100	1,082.00	0.00
167	600967	内蒙一机	100	1,010.00	0.00
168	002292	奥飞娱乐	100	998.00	0.00
169	002055	得润电子	100	956.00	0.00
170	002602	世纪华通	120	910.80	0.00
171	300315	掌趣科技	100	780.00	0.00
172	600114	东睦股份	100	762.00	0.00
173	600999	招商证券	55	746.35	0.00
174	002600	领益智造	100	691.00	0.00
175	300459	汤姆猫	100	649.00	0.00
176	000488	晨鸣纸业	100	485.00	0.00
177	000166	申万宏源	100	462.00	0.00
178	000100	TCL 科技	110	433.40	0.00
179	000725	京东方 A	100	409.00	0.00
180	688343	云天励飞	1	63.61	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	601601	中国太保	12,381,313.69	4.70
2	600036	招商银行	11,360,881.00	4.31
3	600919	江苏银行	11,310,553.80	4.29
4	601186	中国铁建	11,056,744.00	4.19
5	603259	药明康德	10,710,096.00	4.06
6	002384	东山精密	9,579,569.00	3.63
7	000001	平安银行	9,165,482.00	3.48
8	300002	神州泰岳	8,746,383.00	3.32
9	600325	华发股份	8,541,822.00	3.24
10	002415	海康威视	8,484,461.00	3.22
11	300170	汉得信息	8,022,316.00	3.04
12	600583	海油工程	7,772,171.00	2.95
13	601398	工商银行	7,632,782.00	2.90
14	000975	银泰黄金	7,365,340.00	2.79
15	600023	浙能电力	7,253,590.00	2.75
16	600079	人福医药	7,050,338.00	2.67
17	601390	中国中铁	6,945,278.00	2.63
18	600511	国药股份	6,165,599.40	2.34

19	000999	华润三九	5,758,963.11	2.18
20	688036	传音控股	5,746,359.83	2.18
21	600048	保利发展	5,490,067.00	2.08
22	300750	宁德时代	5,365,645.00	2.04

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300002	神州泰岳	16,472,358.50	6.25
2	002384	东山精密	14,381,263.00	5.46
3	600036	招商银行	13,574,402.00	5.15
4	002475	立讯精密	12,822,589.00	4.86
5	600887	伊利股份	11,560,417.00	4.39
6	600919	江苏银行	11,219,614.84	4.26
7	300795	米奥会展	10,459,851.50	3.97
8	000002	万 科 A	9,826,786.00	3.73
9	601009	南京银行	8,660,886.00	3.29
10	000001	平安银行	8,547,436.00	3.24
11	600690	海尔智家	8,027,875.90	3.05
12	688036	传音控股	7,993,619.49	3.03
13	000975	银泰黄金	7,710,722.00	2.93
14	600511	国药股份	7,426,655.60	2.82
15	000999	华润三九	7,385,075.50	2.80
16	600153	建发股份	7,170,235.00	2.72
17	002415	海康威视	7,100,424.59	2.69
18	600079	人福医药	7,026,986.32	2.67
19	600030	中信证券	6,630,116.90	2.52
20	300170	汉得信息	6,381,206.00	2.42
21	000651	格力电器	6,244,537.52	2.37

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	260,886,286.22
卖出股票收入（成交）总额	281,329,457.85

注：7.4.1 项“买入金额”、7.4.2 项“卖出金额”及 7.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	181,536.25	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	181,536.25	0.07

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	132026	G 三峡 EB2	1,470	162,694.57	0.06
2	113633	科沃转债	170	18,841.68	0.01

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 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，江苏银行股份有限公司、中国平安保险(集团)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	65,273.04
2	应收清算款	2,625,428.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,242.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,700,943.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132026	G 三峡 EB2	162,694.57	0.06
2	113633	科沃转债	18,841.68	0.01

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

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 (%)
5,066	23,348.78	46,774,967.30	39.54	71,509,962.95	60.46

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,152,640.22	1.82

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	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	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年7月27日）	746,462,455.76
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	120,846,959.57
本报告期基金总申购份额	49,154,966.77
减：本报告期基金总赎回份额	51,716,996.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	118,284,930.25

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

报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	143,212,457.36	26.83	92,862.94	26.29	-
华泰证券股份有限公司	1	91,807,293.40	17.20	64,265.10	18.19	-
招商证券股份有限公司	1	86,856,914.43	16.27	60,800.31	17.21	-
长江证券股份有限公司	1	59,374,418.81	11.12	37,485.22	10.61	-
开源证券股份有限公司	2	55,906,673.02	10.47	35,294.81	9.99	-
兴业证券股份有限公司	2	45,005,850.54	8.43	28,410.92	8.04	-
广发证券股份有限公司	3	28,652,623.68	5.37	18,088.05	5.12	-

申万宏源 证券有限 公司	2	22,920,534.9 3	4.29	16,044.38	4.54	-
安信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
财信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证券有 限责任公 司	1	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
银泰证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	2	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国盛证券有限责任公司退租交易单元 2 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：银泰证券有限责任公司新增交易单元 1 个，中航证券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 (%)
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
银泰证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

中航证 券有限 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修订旗下部分基金托管协议的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 28 日
2	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 21 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 20 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023-02-20 至 2023-04-10, 2023-05-17 至 2023-06-30	18,950,327.38	17,072,174.71	744,181.46	35,278,320.63	29.82

产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实低价策略股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实低价策略股票型证券投资基金基金合同》；

- (3) 《嘉实低价策略股票型证券投资基金招募说明书》;
- (4) 《嘉实低价策略股票型证券投资基金基金托管协议》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实低价策略股票型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

1) 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) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日