

嘉实稳怡债券型证券投资基金 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：招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。

基金托管人招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	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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	41
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	42
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	42
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	42
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.11 投资组合报告附注	42
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	43
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实稳怡债券型证券投资基金
基金简称	嘉实稳怡债券
基金主代码	004486
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 6 月 21 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	277,869,941.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本基金主要投资策略包括：</p> <p>大类资产配置策略：本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。</p> <p>债券投资策略：本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。具体策略包括利率策略、信用债券投资策略、期限结构配置策略、骑乘策略、息差策略、中小企业私募债券投资策略。</p> <p>此外，在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金还将运用股票投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略，以增厚组合收益。</p>
业绩比较基准	中债总全价指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	张姗
	联系电话	(010)65215588	0755-83077987
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	400-600-8800	95555
传真	(010)65215588	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100020	518040
法定代表人	经雷	缪建民

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	3,094,925.64
本期利润	1,673,264.71
加权平均基金份额本期利润	0.0067
本期加权平均净值利润率	0.63%
本期基金份额净值增长率	0.31%
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	3,274,663.89
期末可供分配基金份额利润	0.0118
期末基金资产净值	285,993,822.26
期末基金份额净值	1.0292
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	16.98%

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。

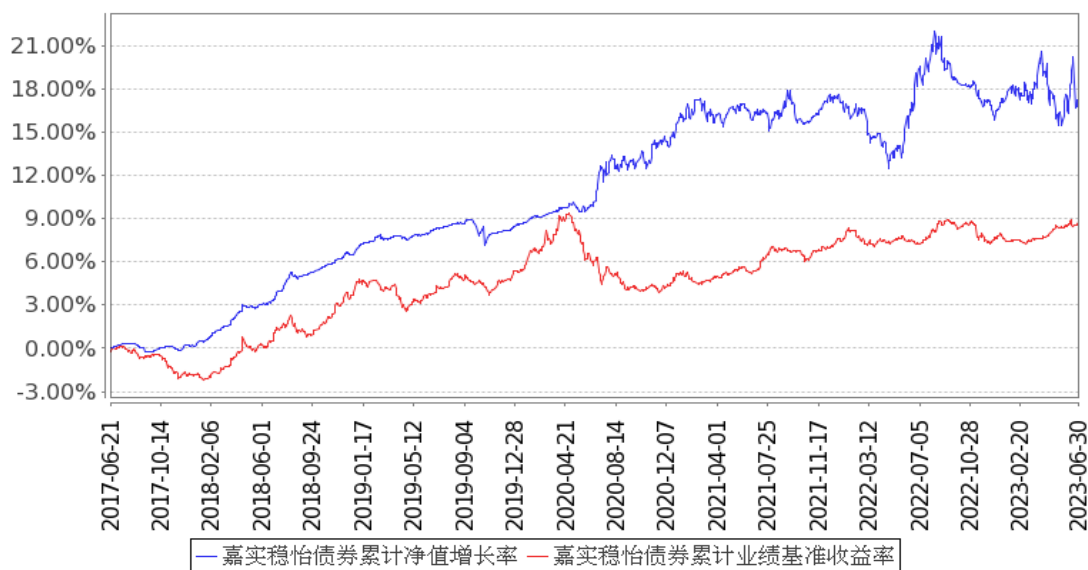
3.2 基金净值表现

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	-0.12%	0.64%	0.28%	0.08%	-0.40%	0.56%
过去三个月	-1.61%	0.53%	1.03%	0.06%	-2.64%	0.47%
过去六个月	0.31%	0.42%	0.87%	0.06%	-0.56%	0.36%
过去一年	-1.56%	0.35%	1.35%	0.08%	-2.91%	0.27%
过去三年	5.84%	0.28%	2.34%	0.09%	3.50%	0.19%
自基金合同生效起至今	16.98%	0.20%	8.75%	0.10%	8.23%	0.10%

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

嘉实稳怡债券累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2017年06月21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		
林洪钧	本基金、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实鑫福一年持有期混合基金经理	2022 年 4 月 6 日	-	17 年	曾任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，交银施罗德基金管理有限公司固定收益部助理总经理、基金经理，光大保德信基金管理有限公司固定收益部总监，兴证证券资产管理有限公司固定收益部投资总监，财通基金管理有限公司固定收益部投资总监。2021 年 11 月加入嘉实基金管理有限公司，现任固定收益部策略投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
左勇	本基金基金经理	2022 年 10 月 27 日	-	7 年	曾任益普索（中国）市场咨询研究部研究员、百事（中国）有限公司销售部收益管理主管、可口可乐（上海）有限公司商务部商务经理、光大证券股份有限公司研究所行业分析师，东吴证券股份有限公司研究所行业分析师。2018 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员。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、《嘉实稳怡债券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 1 季度，在 1 月全国疫情高峰后，伴随着春节消费旺季和节后复产复工，国内的经济和市场出现了明显的修复和改善趋势，整体市场也呈现了较好的反弹趋势。经过了 1 月疫情高峰后，2 月和 3 月信贷和社融数据持续超预期，地产在销售端在 22 年四季度政策发力的作用下，销售持续回暖，3 月百城销售数据增速转正，国内内需消费也呈现明显复苏，PMI 等经济高频指数也处于较高水平，国内经济逐步企稳。两会过后，23 年经济增长 5% 左右的目标，但对于政策强刺激的预期也逐步减弱，预计随着地产、消费等内需修复，全年经济呈现稳步修复的态势。

海外方面，海外市场一季度面临较大的波动，美联储面对通胀仍然采取了坚定加息的政策，但面临高利率环境下不断暴露的金融风险，联储对于加息步骤的两难选择加大，加息的预期和节奏波动较大。但总体海外市场逐渐转为交易加息放缓的边际变化，北上资金从 22 年底延续了总体回流的态势，对国内权益和债市均产生边际利好。

一季度债券市场收益率稳中有降，信用利差有所收窄，信用债表现好于利率债。资金面中枢相较去年四季度有所抬升，但整体流动性风险可控。机构行为方面，经历去年理财集中赎回事件

的影响之后，今年一季度流动性压力已经释放，机构配置需求恢复到正常状态。权益市场方面，伴随着经济的复苏和市场信心的修复，权益市场呈现回暖反弹的态势。年初在春节旺季催化下，出行链、地产链、消费链等消费类资产出现明显反弹，随着国家对数字经济方面的重点政策扶持和全球 AIGC 方面的产业突破，科技类资产也出现了明显的涨幅。

2023 年 2 季度，宏观环境的变化成为资本市场运行的主要矛盾。在今年年初，市场一致预期在上半年经济将处在疫情放开后的修复阶段，各项经济指标有望缓慢稳步上行。但宏观经济在 2 月之后，出现了几项不及预期的变化：首先是通胀数据表现低糜，CPI 和 PPI 持续下行，引发市场对通缩的担忧；其次是消费的复苏不及预期，虽然消费场景的修复较快，但消费能力和消费意愿的下降显著超出预期，这一现象在 2 季度表现的尤为明显；再次是生产和投资出现疲软迹象，数据上呈现出震荡下行。年初对经济的修复预期，在 2 季度出现了全面落空的情形。

外部环境方面，美国经济表现出比较强的韧性，通胀下行速度比较缓慢，库存去化的速度也趋缓，因此在 2 季度美元指数整体走势略强，人民币汇率也有较大压力，特别是在 6 月份以后，汇率贬值的压力进一步增大，对人民币资产的定价构成一定压力。

资本市场方面，二季度债券市场收益率稳中有降，信用利差平稳，各债券品种的表现都较好。资金面中枢相较一季度保持稳定，但整体流动性风险可控。机构行为方面，由于受到经济持续下行的影响，机构配置需求比较旺盛。整体来看，二季度债券市场在宏观下行的背景下，收益率在低位又出现了进一步下行。权益市场二季度表现惨淡，由于市场需要对年初的经济预期进行修正，因此前期表现较好的消费和顺周期板块都出现了明显的调整，市场结构性特征非常明显，AI 产业链继续表现强势，计算机、通信、传媒、电子等板块走势明显好于大盘，但上述行业波动巨大，且在 2 季度后半段，AI 行情逐步收敛到部分核心标的，表现较好的品种主要集中在业务落地较快的少数核心标的上。

操作方面，大类资产配置仍然偏向于权益类，始终保持了较高的权益类仓位配置。本基金在债券部分的久期维持稳定，重点配置中短久期的高流动性品种，久期保持相对稳定，主要以票息策略为主要获取收益的手段。权益资产方面，一季度对前期持仓较为分散的方向进行了压缩，重点集中在出行链、线下消费复苏、信创、计算机等主线，保持了相对成长和价值相对平衡的风格。2 季度重点配置在计算机、医药、电子、食品饮料、通信等板块，同时在配置了出行链和电信板块进行了配置。组合保持较高仓位运行，通过持仓行业的配置分散风险。

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 1.0292 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.31%，业绩比较基准收益率为 0.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为三季度市场核心矛盾依然集中在宏观和微观基本面。宏观角度，由于当前经济已经出现明显下行，对政策的预期较高，虽然从库存周期角度看，去库存仍将持续一段时间，但当前权益市场的估值水平已经回落到历史较低位置，因此若有政策刺激或者库存去化到低位，对权益市场将带来一定的利好。另外，从海外角度来看，虽然当前美国经济表现出较强的韧性，但从中期看仍将出现货币政策的边际放松，因此中期维度看 RMB 汇率的贬值压力整体可控，随着下半年美联储紧缩的货币政策正式告一段落，来自汇率端的压力也会逐步减少。因此从权益市场角度看，当前位置应该用寻找买点的思路看待市场更为合适。债券市场方面，由于当前收益率已经在较低位置，因此我们判断债券可能将维持震荡格局，收益率上有顶下有底。在行业配置方面，数字经济+AI 依然有望成为中期主线，同时在当前位置可逢低布局有业绩支撑的顺周期标的，受益于全球产业周期触底回升的半导体和创新药板块也值得关注。策略方面，本基金将保持久期稳定，以获取票息作为主要策略。权益方面，本基金将关注市场主线，行业方面均衡配置组合资产，加大对顺周期类资产的左侧布局机会，并且对组合回撤风险进行动态控制。

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，本基金实施了利润分配，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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：嘉实稳怡债券型证券投资基金

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	4,442,236.20	30,953,185.43
结算备付金		539,566.68	265,443.66
存出保证金		58,861.49	22,046.84
交易性金融资产	6.4.7.2	335,230,921.05	191,013,588.54
其中：股票投资		100,159,428.58	27,221,712.24
基金投资		-	-
债券投资		235,071,492.47	163,791,876.30
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	-2,133.69	25,000,000.00

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		8,097,625.32	-
应收股利		-	-
应收申购款		49.97	399.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		348,367,127.02	247,254,664.43
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		62,038,435.45	20,043,061.96
应付清算款		-	25,000,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		122,824.18	89,137.16
应付托管费		20,470.69	14,856.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		84.16	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	191,490.28	58,783.10
负债合计		62,373,304.76	45,205,838.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	277,869,941.44	173,253,277.98
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	8,123,880.82	28,795,548.07
净资产合计		285,993,822.26	202,048,826.05
负债和净资产总计		348,367,127.02	247,254,664.43

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0292 元，基金份额总额 277,869,941.44 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实稳怡债券型证券投资基金

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		3,108,377.01	451,782.18
1. 利息收入		34,435.78	4,940.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	30,189.88	3,330.87
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		4,245.90	1,609.51
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,485,066.21	230,740.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,661,198.03	-686,366.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2,391,475.64	878,419.84
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	432,392.54	38,687.03
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	-1,421,660.93	215,810.38
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	10,535.95	291.34
减：二、营业总支出		1,435,112.30	202,768.11
1. 管理人报酬		782,418.80	124,984.07
2. 托管费		130,403.19	20,830.68
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		508,677.24	29,258.68
其中：卖出回购金融资产支出		508,677.24	29,258.68
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		9.01	13.02

8. 其他费用	6.4.7.23	13,604.06	27,681.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,673,264.71	249,014.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,673,264.71	249,014.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,673,264.71	249,014.07

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实稳怡债券型证券投资基金

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)	173,253,277.98	-	28,795,548.07	202,048,826.05
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)	173,253,277.98	-	28,795,548.07	202,048,826.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	104,616,663.46	-	-20,671,667.25	83,944,996.21
(一)、综合收益总额	-	-	1,673,264.71	1,673,264.71
(二)、本期基金份额	104,616,663.46	-	10,799,247.02	115,415,910.48

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	182,938,213.11	-	17,436,776.26	200,374,989.37
2. 基金赎回款	-78,321,549.65	-	-6,637,529.24	-84,959,078.89
（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）	-	-	-33,144,178.98	-33,144,178.98
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	277,869,941.44	-	8,123,880.82	285,993,822.26
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）	42,559,582.65	-	7,473,089.38	50,032,672.03
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	42,559,582.65	-	7,473,089.38	50,032,672.03
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,217,206.40	-	-61,988.48	-3,279,194.88
(一)、综合收益总额	-	-	249,014.07	249,014.07
(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)	-3,217,206.40	-	-311,002.55	-3,528,208.95
其中:1. 基金申购款	11,690,143.36	-	2,073,110.22	13,763,253.58
2. 基金赎回款	-14,907,349.76	-	-2,384,112.77	-17,291,462.53
(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 期末净资产(基 金净值)	39,342,376.25	-	7,411,100.90	46,753,477.15

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

嘉实稳怡债券型证券投资基金(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[2016]2254号《关于准予嘉实稳怡债券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《嘉实稳怡债券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,《嘉实稳怡债券型证券投资基金基金合同》于2017年6月21日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为245,715,176.45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,基金托管人为招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》、《嘉实稳怡债券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	4,442,236.20
等于: 本金	4,441,119.76
加: 应计利息	1,116.44
减: 坏账准备	—
定期存款	—
等于: 本金	—
加: 应计利息	—
减: 坏账准备	—
其中: 存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于: 本金	—
加: 应计利息	—
减: 坏账准备	—
合计	4,442,236.20

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	104,032,704.41	-	100,159,428.58	-3,873,275.83	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	31,743,533.35	108,575.39	31,865,495.39	13,386.65
	银行间市场	200,459,900.00	2,555,997.08	203,205,997.08	190,100.00
	合计	232,203,433.35	2,664,572.47	235,071,492.47	203,486.65
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	336,236,137.76	2,664,572.47	335,230,921.05	-3,669,789.18	

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-2,133.69	-
银行间市场	-	-
合计	-2,133.69	-

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	191,490.28
其中：交易所市场	189,149.67
银行间市场	2,340.61
应付利息	-
合计	191,490.28

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	173,253,277.98	173,253,277.98

本期申购	182,938,213.11	182,938,213.11
本期赎回（以“-”号填列）	-78,321,549.65	-78,321,549.65
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	277,869,941.44	277,869,941.44

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	24,539,525.98	4,256,022.09	28,795,548.07
本期利润	3,094,925.64	-1,421,660.93	1,673,264.71
本期基金份额交易产生的变动数	8,784,391.25	2,014,855.77	10,799,247.02
其中：基金申购款	12,962,991.20	4,473,785.06	17,436,776.26
基金赎回款	-4,178,599.95	-2,458,929.29	-6,637,529.24
本期已分配利润	-33,144,178.98	-	-33,144,178.98
本期末	3,274,663.89	4,849,216.93	8,123,880.82

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	22,782.38
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	4,354.30
其他	3,053.20
合计	30,189.88

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	1,661,198.03
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	1,661,198.03

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	225,085,768.60
减：卖出股票成本总额	222,826,434.38
减：交易费用	598,136.19
买卖股票差价收入	1,661,198.03

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	2,480,322.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-88,847.04
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	2,391,475.64

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	104,856,648.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	102,943,002.13
减：应计利息总额	2,000,268.50
减：交易费用	2,224.91
买卖债券差价收入	-88,847.04

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	432,392.54
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	432,392.54

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	-1,421,660.93
股票投资	-1,866,329.71
债券投资	444,668.78
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	-1,421,660.93

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	10,400.95
基金转出费收入	135.00
合计	10,535.95

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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,004.06
债券托管账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	13,604.06

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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	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	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	782,418.80	124,984.07
其中：支付销售机构的客户维护费	18,705.92	42.21

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 0.60%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×0.60%/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	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	130,403.19	20,830.68

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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×0.10%/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

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	18,217,343.77	18,217,343.77
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	18,217,343.77	-
报告期末持有的基金份额	-	18,217,343.77
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	46.30%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司活期	4,442,236.20	22,782.38	471,382.72	1,199.37

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

单位：人民币元

序号	权益 登记 日	除息日		每 10 份基金 份额分 红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2023 年 1 月 30 日	-	2023 年 1 月 30 日	1.4160	28,144,209.40	4,999,969.58	33,144,178.98	-
合计	-	-	-	1.4160	28,144,209.40	4,999,969.58	33,144,178.98	-

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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券款余额 62,038,435.45 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
220211	22 国开 11	2023 年 7 月 10 日	101.60	128,000	13,004,964.82
210202	21 国开 02	2023 年 7 月 5 日	101.89	300,000	30,567,180.82
220408	22 农发 08	2023 年 7 月 5 日	101.31	229,000	23,200,366.44
合计				657,000	66,772,512.08

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

本基金为债券型证券投资基金，风险与收益高于货币市场基金，低于股票型基金、混合型基金。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在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	97,533,819.84	131,946,305.89
合计	97,533,819.84	131,946,305.89

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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	8,086,131.51	-
AAA 以下	17,510,565.96	-
未评级	111,940,975.16	31,845,570.41
合计	137,537,672.63	31,845,570.41

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综合持仓集中度指标、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	4,442,236.20	-	-	-	4,442,236.20
结算备付金	539,566.68	-	-	-	539,566.68
存出保证金	58,861.49	-	-	-	58,861.49
交易性金融资产	138,401,521.21	94,654,866.58	2,015,104.68	100,159,428.58	335,230,921.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-2,133.69	-	-	-	-2,133.69
应收清算款	-	-	-	8,097,625.32	8,097,625.32
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	49.97	49.97
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	143,440,051.89	94,654,866.58	2,015,104.68	108,257,103.87	348,367,127.02
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	62,038,435.45	-	-	-	62,038,435.45
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	122,824.18	122,824.18
应付托管费	-	-	-	20,470.69	20,470.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	84.16	84.16
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	191,490.28	191,490.28
负债总计	62,038,435.45	-	-	334,869.31	62,373,304.76
利率敏感度缺口	81,401,616.44	94,654,866.58	2,015,104.68	107,922,234.56	285,993,822.26

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	30,953,185.43	-	-	-	30,953,185.43
结算备付金	265,443.66	-	-	-	265,443.66
存出保证金	22,046.84	-	-	-	22,046.84
交易性金融资产	153,326,840.68	10,465,035.62	-	27,221,712.24	191,013,588.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	25,000,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	399.96	399.96
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	209,567,516.61	10,465,035.62	-	27,222,112.20	247,254,664.43
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	20,043,061.96	-	-	-	20,043,061.96
应付清算款	-	-	-	25,000,000.00	25,000,000.00
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	89,137.16	89,137.16
应付托管费	-	-	-	14,856.16	14,856.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
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	-	-	-	58,783.10	58,783.10
负债总计	20,043,061.96	-	-	25,162,776.42	45,205,838.38
利率敏感度缺口	189,524,454.65	10,465,035.62	-	2,059,335.78	202,048,826.05

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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	-638,260.88	-232,050.48
	市场利率下降 25 个基点	643,565.15	232,926.42

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	100,159,428.58	35.02	27,221,712.24	13.47
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	100,159,428.58	35.02	27,221,712.24	13.47

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%	4,224,626.95	1,130,766.83
	业绩比较基准下降 5%	-4,224,626.95	-1,130,766.83

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	125,756,126.05	27,221,712.24
第二层次	209,474,795.00	163,791,876.30
第三层次	-	-
合计	335,230,921.05	191,013,588.54

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	100,159,428.58	28.75
	其中：股票	100,159,428.58	28.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	235,071,492.47	67.48
	其中：债券	235,071,492.47	67.48
	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	-2,133.69	-0.00
	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	4,981,802.88	1.43
8	其他各项资产	8,156,536.78	2.34
9	合计	348,367,127.02	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	-	-
C	制造业	57,631,608.38	20.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,970,000.00	0.69
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,027,366.00	1.06
H	住宿和餐饮业	1,693,600.00	0.59
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,146,506.20	10.89
J	金融业	1,051,680.00	0.37
K	房地产业	685,368.00	0.24
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	2,246,800.00	0.79
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	706,500.00	0.25
S	综合	-	-
	合计	100,159,428.58	35.02

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	002230	科大讯飞	105,700	7,183,372.00	2.51
2	688111	金山办公	12,190	5,756,361.80	2.01

3	002777	久远银海	110,000	3,901,700.00	1.36
4	688146	中船特气	90,000	3,798,000.00	1.33
5	300308	中际旭创	24,800	3,656,760.00	1.28
6	300604	长川科技	69,000	3,276,810.00	1.15
7	688266	泽璟制药	70,000	3,258,500.00	1.14
8	002920	德赛西威	20,000	3,116,200.00	1.09
9	603885	吉祥航空	196,200	3,027,366.00	1.06
10	000568	泸州老窖	14,400	3,017,808.00	1.06
11	603258	电魂网络	70,000	2,975,700.00	1.04
12	300002	神州泰岳	200,000	2,800,000.00	0.98
13	688369	致远互联	50,420	2,788,226.00	0.97
14	600587	新华医疗	70,500	2,490,765.00	0.87
15	600085	同仁堂	38,000	2,187,280.00	0.76
16	300394	天孚通信	20,000	2,136,600.00	0.75
17	002050	三花智控	70,000	2,118,200.00	0.74
18	000063	中兴通讯	44,700	2,035,638.00	0.71
19	688581	安杰思	16,262	1,991,932.38	0.70
20	601186	中国铁建	200,000	1,970,000.00	0.69
21	603369	今世缘	35,400	1,869,120.00	0.65
22	603986	兆易创新	16,300	1,731,875.00	0.61
23	600661	昂立教育	180,000	1,715,400.00	0.60
24	688498	源杰科技	6,000	1,710,000.00	0.60
25	600754	锦江酒店	40,000	1,693,600.00	0.59
26	002850	科达利	12,000	1,587,000.00	0.55
27	300624	万兴科技	12,000	1,405,800.00	0.49
28	603039	泛微网络	17,000	1,387,710.00	0.49
29	300750	宁德时代	5,940	1,359,012.60	0.48
30	000999	华润三九	22,000	1,334,520.00	0.47
31	002847	盐津铺子	15,650	1,331,032.50	0.47
32	603345	安井食品	8,700	1,277,160.00	0.45
33	301269	华大九天	10,060	1,235,770.40	0.43
34	002709	天赐材料	30,000	1,235,700.00	0.43
35	300395	菲利华	25,000	1,230,000.00	0.43
36	688192	迪哲医药	30,992	1,075,422.40	0.38
37	300896	爱美客	2,400	1,067,880.00	0.37
38	300033	同花顺	6,000	1,051,680.00	0.37
39	002555	三七互娱	30,000	1,046,400.00	0.37
40	688488	艾迪药业	80,000	985,600.00	0.34
41	603267	鸿远电子	15,000	979,500.00	0.34
42	002236	大华股份	44,700	882,825.00	0.31
43	002345	潮宏基	108,000	848,880.00	0.30
44	002603	以岭药业	30,000	770,700.00	0.27
45	600600	青岛啤酒	7,300	756,499.00	0.26

46	601595	上海电影	25,000	706,500.00	0.25
47	688326	经纬恒润	4,850	700,291.50	0.24
48	600223	福瑞达	66,800	685,368.00	0.24
49	601728	中国电信	118,200	665,466.00	0.23
50	300049	福瑞股份	28,100	646,300.00	0.23
51	000526	学大教育	20,000	531,400.00	0.19
52	000858	五粮液	2,900	474,353.00	0.17
53	600702	舍得酒业	3,000	371,850.00	0.13
54	000596	古井贡酒	1,300	321,594.00	0.11

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	300002	神州泰岳	14,797,177.86	7.32
2	688111	金山办公	10,941,047.84	5.42
3	300496	中科创达	8,211,652.48	4.06
4	002230	科大讯飞	8,169,382.00	4.04
5	300308	中际旭创	8,045,480.00	3.98
6	601728	中国电信	6,934,068.00	3.43
7	002777	久远银海	6,896,242.40	3.41
8	300170	汉得信息	6,663,589.00	3.30
9	301269	华大九天	6,634,979.32	3.28
10	000977	浪潮信息	5,924,667.76	2.93
11	601360	三六零	5,488,669.00	2.72
12	300049	福瑞股份	5,374,794.00	2.66
13	300624	万兴科技	5,148,186.20	2.55
14	688023	安恒信息	4,924,892.43	2.44
15	002920	德赛西威	4,908,924.08	2.43
16	688369	致远互联	4,711,708.33	2.33
17	300604	长川科技	4,471,751.00	2.21
18	002384	东山精密	4,393,022.02	2.17
19	688146	中船特气	4,365,811.35	2.16
20	000858	五粮液	4,249,101.00	2.10
21	002415	海康威视	4,090,035.00	2.02

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	300002	神州泰岳	15,702,026.66	7.77
2	300496	中科创达	8,859,319.00	4.38
3	601728	中国电信	6,879,007.00	3.40

4	688111	金山办公	6,630,985.49	3.28
5	300170	汉得信息	6,605,201.42	3.27
6	300049	福瑞股份	6,557,024.00	3.25
7	300308	中际旭创	6,283,549.50	3.11
8	000977	浪潮信息	5,625,420.36	2.78
9	300624	万兴科技	5,533,026.84	2.74
10	601360	三六零	5,430,704.00	2.69
11	002384	东山精密	5,083,481.00	2.52
12	301269	华大九天	5,067,182.00	2.51
13	688023	安恒信息	4,858,784.22	2.40
14	000858	五粮液	4,712,529.00	2.33
15	301165	锐捷网络	4,191,007.24	2.07
16	002777	久远银海	4,056,831.40	2.01
17	002415	海康威视	3,756,180.00	1.86
18	603259	药明康德	3,459,835.00	1.71
19	600570	恒生电子	3,109,623.00	1.54
20	688041	海光信息	2,946,095.41	1.46

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	297,630,480.43
卖出股票收入（成交）总额	225,085,768.60

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	6,268,797.92	2.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	203,205,997.08	71.05
	其中：政策性金融债	203,205,997.08	71.05
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）	25,596,697.47	8.95
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	235,071,492.47	82.19

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	220202	22 国开 02	600,000	60,774,065.57	21.25
2	210202	21 国开 02	300,000	30,567,180.82	10.69
3	220211	22 国开 11	300,000	30,480,386.30	10.66
4	220408	22 农发 08	300,000	30,393,493.15	10.63
5	220411	22 农发 11	300,000	30,391,142.47	10.63

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 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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

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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	58,861.49
2	应收清算款	8,097,625.32
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	49.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,156,536.78

7.11.4 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	113044	大秦转债	8,086,131.51	2.83
2	113626	伯特转债	3,629,315.75	1.27
3	127036	三花转债	2,863,989.04	1.00
4	127038	国微转债	2,105,364.25	0.74
5	127069	小熊转债	1,610,031.78	0.56
6	123075	贝斯转债	1,569,382.19	0.55
7	113534	鼎胜转债	1,532,804.71	0.54
8	128074	游族转债	1,139,230.68	0.40
9	128111	中矿转债	1,086,957.81	0.38
10	113582	火炬转债	1,012,170.41	0.35
11	110068	龙净转债	556,246.44	0.19
12	113061	拓普转债	405,072.90	0.14

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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 (%)
534	520,355.70	268,660,707.77	96.69	9,209,233.67	3.31

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	790,124.22	0.28

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年6月21日） 基金份额总额	245,715,176.45
本报告期期初基金份额总额	173,253,277.98
本报告期基金总申购份额	182,938,213.11
减：本报告期基金总赎回份额	78,321,549.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	277,869,941.44

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	2	251,645,090.89	48.14	158,866.64	47.86	-
东北证券股份有限公司	2	79,404,324.52	15.19	50,127.88	15.10	-
国盛证券有限责任公司	4	76,734,406.14	14.68	48,440.89	14.59	-
中信证券股份有限公司	2	41,583,514.25	7.96	28,166.93	8.49	-
方正证券股份有限公司	2	36,065,427.16	6.90	22,767.14	6.86	-
中国中金财富证券有限公司	4	33,533,490.07	6.42	21,169.45	6.38	-
华创证券有限责任公司	2	3,749,996.00	0.72	2,367.40	0.71	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国融证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
南京证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	-

西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：国融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。

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	31,796,507.82	96.95	85,500,000.00	38.03	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	67,000,000.00	29.80	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	23,800,000.00	10.59	-	-

中信证券股份有限公司	-	-	13,000,000.00	5.78	-	-
方正证券股份有限公司	999,940.00	3.05	9,500,000.00	4.23	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	19,000,000.00	8.45	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	7,000,000.00	3.11	-	-
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	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国融证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
南京证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
五矿证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 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	嘉实稳怡债券型证券投资基金暂停大额申购（含转入）业务的公告	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 1 月 4 日
2	嘉实稳怡债券型证券投资基金 2023 年第一次收益分配公告	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 1 月 20 日
3	嘉实稳怡债券型证券投资基金恢复大额申购（含转入）业务的公告	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 1 月 31 日
4	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
5	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
6	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 5 月 30 日
7	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	2023-01-04 至 2023-06-30	-	85,587,127.69	-	85,587,127.69	30.80

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稳怡债券型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实稳怡债券型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实稳怡债券型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实稳怡债券型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实稳怡债券型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 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

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