

嘉实文体娱乐股票型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 24 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 2023 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实文体娱乐股票
基金主代码	003053
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 9 月 7 日
报告期末基金份额总额	525,729,754.90 份
投资目标	本基金通过投资于文体娱乐行业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	<p>本基金将从宏观面、政策面、基本面，资金面和估值等五个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。本基金所指的文体娱乐行业由涉及文化娱乐、体育行业主题的相关公司组成。文体娱乐行业内的公司因所处子行业不同需要通过不同的投资逻辑进行筛选，因此在个股选择上本基金采用定性和定量相结合的方法。</p> <p>具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。</p>
业绩比较基准	中证文体指数*80%+中债综合指数*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。

基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
下属分级基金的交易代码	003053	003054
报告期末下属分级基金的份额总额	159,665,495.39 份	366,064,259.51 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）	
	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
1. 本期已实现收益	-6,576,926.62	-16,725,346.22
2. 本期利润	-56,216,849.53	-138,097,962.68
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.3833	-0.3945
4. 期末基金资产净值	281,895,167.86	625,399,848.22
5. 期末基金份额净值	1.766	1.708

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实文体娱乐股票 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-18.20%	1.80%	-12.15%	1.30%	-6.05%	0.50%
过去六个月	-9.30%	2.38%	-9.41%	1.77%	0.11%	0.61%
过去一年	22.21%	2.12%	29.36%	1.53%	-7.15%	0.59%
过去三年	16.34%	1.82%	-9.33%	1.35%	25.67%	0.47%
过去五年	91.54%	1.83%	16.65%	1.39%	74.89%	0.44%
自基金合同	76.60%	1.69%	-26.89%	1.28%	103.49%	0.41%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

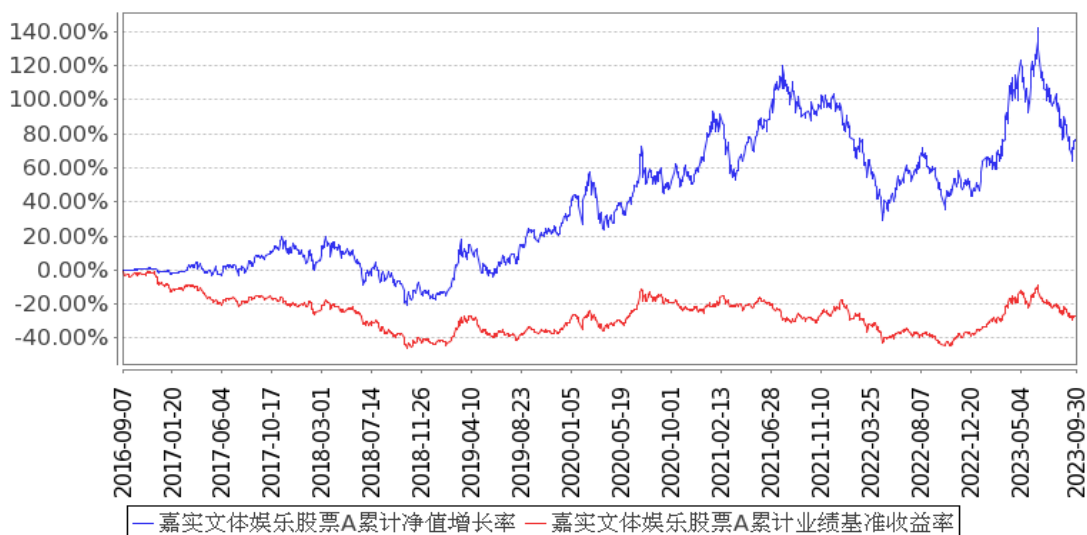
嘉实文体娱乐股票 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-18.36%	1.80%	-12.15%	1.30%	-6.21%	0.50%
过去六个月	-9.58%	2.38%	-9.41%	1.77%	-0.17%	0.61%
过去一年	21.48%	2.12%	29.36%	1.53%	-7.88%	0.59%
过去三年	14.55%	1.82%	-9.33%	1.35%	23.88%	0.47%
过去五年	86.87%	1.83%	16.65%	1.39%	70.22%	0.44%
自基金合同生效起至今	70.80%	1.69%	-26.89%	1.28%	97.69%	0.41%

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

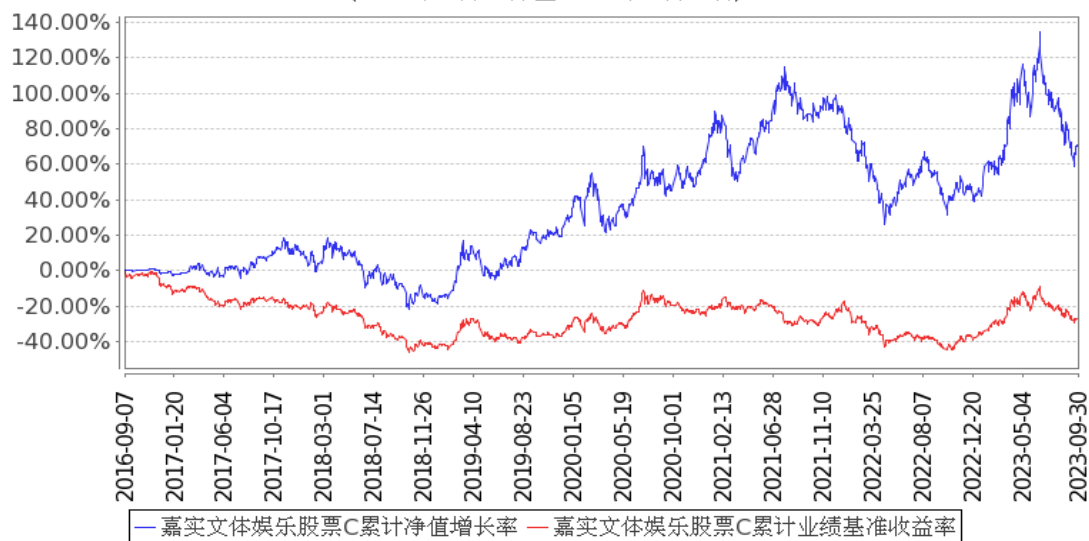
嘉实文体娱乐股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年09月07日至2023年09月30日)



嘉实文体娱乐股票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

(2016年09月07日至2023年09月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王贵重	本基金、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实科技创新混合、嘉实前沿创新混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实港股互联网产业核心资产混合基金	2020年8月21日	-	9年	曾任上海重阳投资管理股份有限公司TMT行业研究员。2015年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任TMT行业研究员、科技组组长，现任大科技研究总监。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

经理				
----	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 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、《嘉实文体娱乐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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 2 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金的投资范围主要聚焦在文化体育娱乐相关，文体娱乐包含文化和体育两个部分，“文化，广义指人类在社会实践过程中所获得的物质、精神的生产能力和创造的物质、精神财富的总和，狭义指精神生产能力和精神产品，包括一切社会意识形态；自然科学、技术科学、社会意识形态，有时又专指教育、科学、艺术等方面的知识与设施。”，在我们具体投资的过程中，对于文化的投资主要在信息技术的范围，包括信息的计算、存储、传播、消费。

由于本基金投资聚焦于信息技术领域，契合了本轮人工智能（AIGC）带来的信息技术的变革，抓住了人工智能中算法、算力和应用中的一些机会。三季度 AIGC 板块出现了普遍调整，本基金也出现了回调。我始终认为企业的价值创造是投资收益的主要来源，AI 行情能否持续则取决于能否

真正的实现价值创造。以目前的技术水平来看，我依然是乐观的。

信息作为重要的生产要素，消除生产和生活过程中的不确定性。一直伴随着整个人类进步，从人类发明语言和文字、到我们国家的造纸和印刷，再到 1947 年以来的基于硅基材料体系的信息革命，信息的生产、存储、传播和应用都有很大量级、效率的提升。而本轮人工智能最直接影响的领域就是信息生成和信息交互，可以进一步的提升信息生产和人机交互效率，它将改变人们工作、学习、娱乐、医疗以及彼此交流的方式，甚至未来随着算力成本的下降，我们每一个人有一个 AI 助理也不是不可能。而未来随着多模态的落地，机器人也会变成可能。几乎每一个行业都会被 AI 影响和改变。在大机会面前不要机会主义，在大技术变革面前最优策略是拥抱，无论投资还是生活。

展望四季度，随着大模型的开源以及无监督学习、有监督学习和 RLHF 过程 know how 的扩散，我认为应用会加速落地。

1， 曾经被互联网改变的行业会再一次被 AI 改变。首先是内容，无论是一维媒介文字，二维媒介图片，三维媒介视频，四维媒介游戏，还是社交、搜索、短视频、电商，我们用的互联网应用都会集成 AI 功能。

2， 软件行业。软件会从功能软件到智能软件，软件的能力会进一步提升，帮我们做更多的事情，交互也会更加友好。无论是办公、OA、CRM、ERP，甚至一些专业的画图、EDA 等工具。

我相信 AI 应用的落地会让我们的生活变的效率更高，体验更好。我的组合也围绕着这个方向进行了布局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实文体娱乐股票 A 基金份额净值为 1.766 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.20%；截至本报告期末嘉实文体娱乐股票 C 基金份额净值为 1.708 元，本报告期基金份额净值增长率为-18.36%；业绩比较基准收益率为-12.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	853,078,964.63	93.50
	其中：股票	853,078,964.63	93.50

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,592,346.58	1.27
	其中：债券	11,592,346.58	1.27
	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	42,534,851.74	4.66
8	其他资产	5,218,651.74	0.57
9	合计	912,424,814.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	148,263,559.54	16.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,563.97	0.00
E	建筑业	30,820.80	0.00
F	批发和零售业	1,110,128.89	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	556,560,688.36	61.34
J	金融业	45,267,548.04	4.99
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,095.40	0.00
M	科学研究和技术服务业	516,563.85	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	480,867.68	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	69,830,334.38	7.70
Q	卫生和社会工作	139,887.02	0.02
R	文化、体育和娱乐业	30,841,906.70	3.40
S	综合	-	-
	合计	853,078,964.63	94.02

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002415	海康威视	2,544,956	86,019,512.80	9.48
2	300624	万兴科技	593,719	59,104,726.45	6.51
3	002315	焦点科技	1,582,160	51,261,984.00	5.65
4	300002	神州泰岳	5,021,300	50,514,278.00	5.57
5	688111	金山办公	130,148	48,258,878.40	5.32
6	300378	鼎捷软件	1,923,300	47,678,607.00	5.26
7	002230	科大讯飞	926,500	46,936,490.00	5.17
8	301269	华大九天	446,000	46,794,320.00	5.16
9	688369	致远互联	1,069,246	45,688,881.58	5.04
10	300033	同花顺	302,874	45,267,548.04	4.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	11,592,346.58	1.28
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	11,592,346.58	1.28

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	115,000	11,592,346.58	1.28

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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

无。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	438,582.53
2	应收证券清算款	1,386,586.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,393,482.51
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	5,218,651.74
---	----	--------------

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实文体娱乐股票 A	嘉实文体娱乐股票 C
报告期期初基金份额总额	129,319,077.39	304,110,053.66
报告期期间基金总申购份额	50,803,033.05	122,364,464.08
减：报告期期间基金总赎回份额	20,456,615.05	60,410,258.23
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	159,665,495.39	366,064,259.51

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实文体娱乐股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实文体娱乐股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实文体娱乐股票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) 报告期内嘉实文体娱乐股票型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

8.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2023 年 10 月 24 日