

嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资
基金
2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 01 月 17 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 10 月 01 日起至 2023 年 12 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实品质蓝筹一年持有期混合
基金主代码	014872
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 2 月 11 日
报告期末基金份额总额	175,308,397.90 份
投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，通过稳健的投资策略精选蓝筹股票，实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	<p>资产配置策略：本基金将根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、市场面、政策面等多种因素的综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，以确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。</p> <p>股票投资策略：蓝筹股票的界定（本基金所指的蓝筹股票是指基金管理人认为具备较高内在价值的上市公司股票，表现为该上市公司具备成熟的商业模式，拥有较强盈利能力，财务状况良好，市场地位领先，治理结构健康，并且公司股票估值相对合理；本基金对具备“蓝筹”特性的公司也进行了定量指标的界定）、行业配置策略、个股精选策略、港股通投资策略、存托凭证投资策略。</p> <p>其他投资策略包括：债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资策略、风险管理策略等。</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×20%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	014872	014873
报告期末下属分级基金的份额总额	169,049,043.45 份	6,259,354.45 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 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	-9,577,102.54	-360,615.08
2. 本期利润	-14,267,745.05	-536,225.75
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0837	-0.0842
4. 期末基金资产净值	123,513,300.68	4,504,750.55
5. 期末基金份额净值	0.7306	0.7197

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-10.28%	1.17%	-5.05%	0.64%	-5.23%	0.53%

过去六个月	-11.71%	1.26%	-8.07%	0.69%	-3.64%	0.57%
过去一年	-26.76%	1.24%	-8.38%	0.69%	-18.38%	0.55%
自基金合同生效起至今	-26.94%	1.53%	-20.36%	0.89%	-6.58%	0.64%

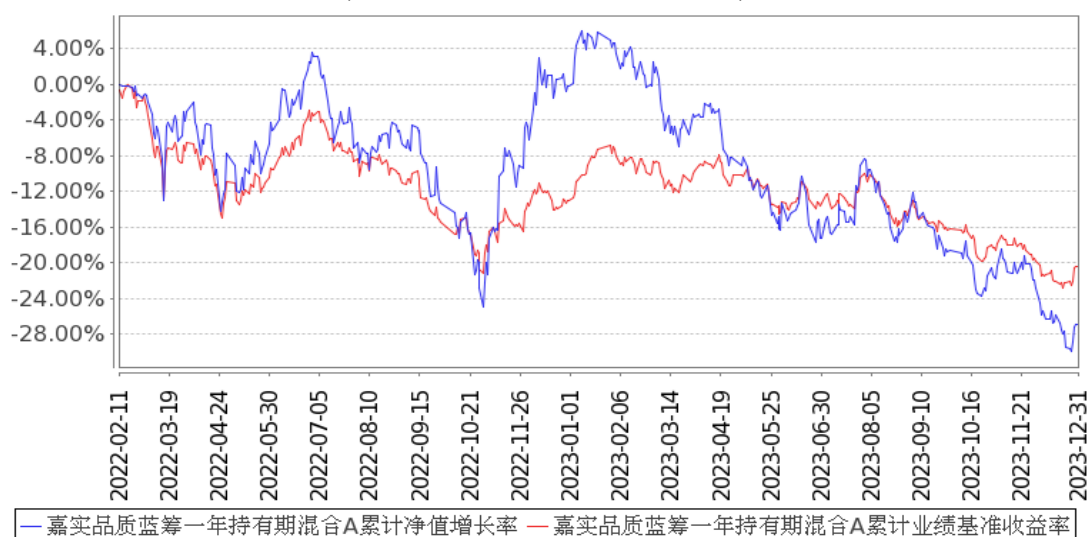
嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准	①-③	②-④
				收益率标准差④		
过去三个月	-10.45%	1.17%	-5.05%	0.64%	-5.40%	0.53%
过去六个月	-12.06%	1.26%	-8.07%	0.69%	-3.99%	0.57%
过去一年	-27.33%	1.25%	-8.38%	0.69%	-18.95%	0.56%
自基金合同生效起至今	-28.03%	1.53%	-20.36%	0.89%	-7.67%	0.64%

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

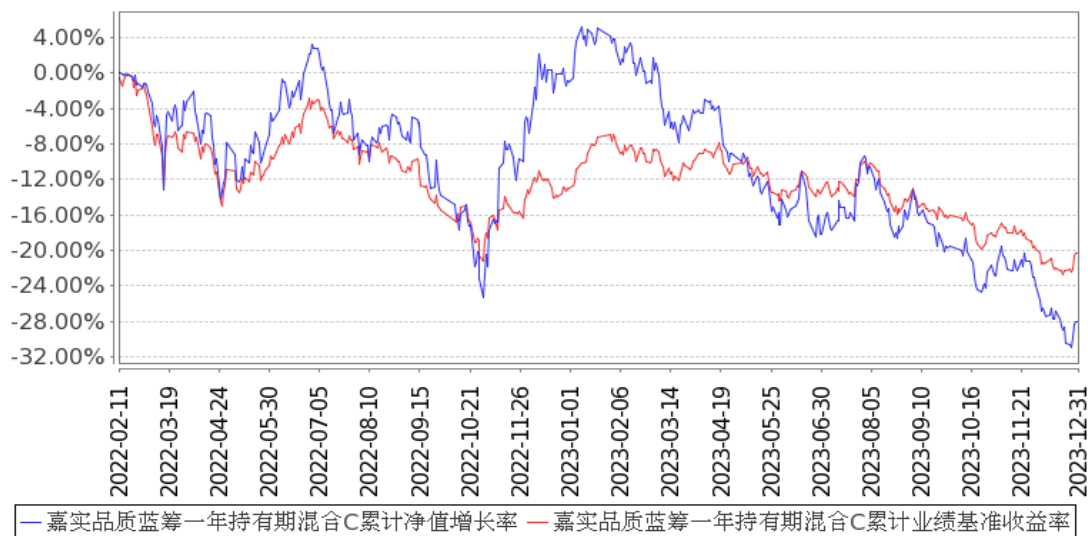
嘉实品质蓝筹一年持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年02月11日至2023年12月31日)



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

(2022年02月11日至2023年12月31日)



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

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖觅	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实周期优选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实新财富混合、嘉实物流产业股票、嘉实基础产业优选股票、嘉实	2022年2月11日	-	14年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司任职于研究部，先后任钢铁行业、交通运输行业研究员等职位，现任大周期研究总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
肖觅	公募基金	8	4,321,212,629.98	2016年12月29日
	私募资产管理计划	1	260,219,773.48	2022年3月24日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	4,581,432,403.46	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实品质蓝筹一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 5 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

回顾 2023 年国内权益市场，除春节前有一次基于对疫后复苏的期待而驱动的市场整体上行外，以中证 800 为代表的宽基指数基本呈现单边下跌的走势。全年中证 800 下跌 10.37%，连续第三年下跌。结构上，上半年 AI 产业趋势和“中特估”是两个相对独立的阶段性机会，下半年开始“微盘股”表现突出，红利风格在市场下行中相对坚挺。节奏上，对疫后强复苏的交易持续到春节前，返工后实际呈现弱复苏状态；“中特估”行情持续到 4 月底，和顺周期相关行业基本面相对较好的时间段基本一致；AI 在连续上涨后面临应用落地的问题，后续波动明显加大；7 月政治局会议显著提振了市场信心，但后续政策落地偏慢，小幅反弹在 8 月初即结束；尤其在接近年底，因为各种意义上的信心不足，市场再次经历了一次明显的下跌过程，让 2023 年显得尤其艰难。这是从市场表现来看，我们给出的一个简要回顾。

实际经济基本面的情况，全年总体来看确实是一个弱复苏的状态，和市场表现一定程度上是比较匹配的。粗略的划分产业部门来看，复苏压力最大的还是房地产，以及与地产实物量相关的地产产业链、与地产投资和资产价格相关的 to G 产业链。人口结构的压力已经切切实实体现在了房地产需求端，全社会也已经形成了“房住不炒”的一致预期。消费方面，实物消费相对平稳，线下服务业恢复较快，出行产业链在累计需求释放的背景下甚至在主要节假日都出现了相当程度的景气。但在结构上，2023 年同样呈现出高性价比产品/渠道份额明显提升的趋势，而品牌作为另一个消费端的重要要素，没有特别突出的表现。出口方面，在过去几年的高基数背景下，2023 年出口总量表现一般，亮点一是在于中国品牌和中国渠道的出海取得突破，二是汽车在新能源时代内卷出了极强产品力后，一跃成为第一大汽车出口国。此外，全球范围内，大语言模型为代表的生成式人工智能毫无疑问是最重要的产业趋势，大语言模型和其多模态应用已经可以在相当多的场景下提高工作效率，意味着巨大的应用空间和明确的变现潜力。

对于基本面的回顾，必然会涉及到经济相关政策的讨论，最近几年，经济政策、产业政策、行业政策对微观层面企业经营状态的影响程度有明显的提升。我们在此前季报中对政策有一次比较详细的讨论，这里不再次过多展开，在此重复一下我们的主要结论：7 月份政治局会议从一个很高的高度对一些市场关心的各种层面的问题给出了相当正面的方向性指引，应该是抓住了是市场主体的信心能否在未来真正修复的关键。而具体哪些落地的政策会更有用？我们倾向于认为如果能从行业内部视角、从纯粹针对冒出的问题去解决这种导向跳出来，站在更高的位置上，通过改变更深一层的行业微观运行机制，改变相关方行为逻辑，去引导相关方自发的去往解决问题的方向上走，这种政策才有可能真正意义上解决一些长期存在问题。年中推出的城中村改造，从

传统的房地产政策框架中跳出来，叠加了城市规划这个工具，改变了城中村拆迁和开发环节的运行机制，也因此是 7 月份以来出的诸多政策中，真正有可能可以起到一些作用的政策。

我们在此前的季报中讨论过主动管理型权益基金的问题，从今年权益市场的结构和节奏两方面来看，都不太有利于主动管理型权益基金获得相对收益。结构的层面，今年为数不多的板块性机会，一是有估值驱动因素和传统的普通投研框架不匹配的问题，二是有产业趋势从零到一刚刚出现的阶段可投资标的有限的问题；而在节奏的层面，公募基金作为天然多头对方向性的利好是非常敏感的，2023 年在 1 月、7 月两个时间节点上市场分别看到了疫情和政策的明确变化，结合相关资产的估值位置也已经经历过明显收缩，公募基金普遍选择了加大多头配置，且在基本面复苏的方向上增加风险暴露，后续市场下跌后，这种偏乐观的主动选择就带来了负向的超额收益。最终全年万得偏股混合型基金指数下跌 13.52%，跑输中证 800 超过 3 个百分点。

以上是对 2023 年的一个简单回顾，更重要的问题永远是怎么看未来。基本面层面上，存在较大压力的显然还是在房地产和相关产业链上。进一步拆解问题所在，可以很明显的看到人口结构的问题已经开始真真切切的影响地产需求了，根据目前的统计数字预估，2023 年全国出生人口在 800 万左右，低于 2022 年的 956 万，相比 2000 年到 2015 年 1600 万左右更是有明显的下滑，而出生人口所对应的正好是房地产的刚需属性，也正好是这两年房地产的细分需求里表现相对较差的部分。如果刚需无法启动，改善性需求中需要通过置换方式才能满足条件的这部分需求也会受到影响，最终影响整体的房地产需求。再看初婚人口，2022 年仅 1051 万人，连续第 9 年下滑，相比十年前 2300-2400 万人的水平也有显著的降幅，这对应着未来的出生人口还会面临比较大的下行压力，会继续压制地产需求。目前来看，房地产行业相关政策仍然集中在限购限贷等原有框架内，唯一跳出房地产本身框架的城中村改造政策应用范围有限，这可能意味着过去两年持续压制地产行业的需求问题在 2024 年仍然是一个现实的压力。但如果反过来看，引入潜在的政策变量，如果我们能看到力度相当大的生育政策，用财政杠杆改变人们的行为，如果还能进一步用一些机制创新改变人们的预期，就有可能一举解决从房地产到总需求所面临的各种问题，当然这类政策出台的可能性有多大，是需要谨慎的去评估的。

房地产的压力仍然存在，意味着和房地产相关的各条产业链的需求都会一定程度上受到拖累，如果把经济作为一个整体来看待，各行各业会互相影响，那么大多数需要对总需求做出一定假设的行业理论上都会受到影响。从投研角度出发，就应该去在需求端受影响相对较小的行业中寻找机会，大致可以分为两类，一类是需求受到影响较小，但供给端有明确总量受限或集中度提升逻辑的行业，第二类是有一些结构性因素驱动需求出现扩张的行业。第一类行业的逻辑可以用 16-17 年供给侧改革的历史帮助了解：在经历了相当一段时间不景气后，行业自身有淘汰出清的客观诉

求，供给侧改革又从政策端给了出清的条件（钢铁行业自身淘汰落后产能配合打击地条钢等不合格生产方式），真正推动了行业的供给侧出清，在需求并没有快速增长的情况下实现了供需格局的逆转，带来一次显著的 ROE 反转。第二类的行业中，最值得关注的仍然是 AI 产业趋势相关的各个行业，大语言模型能否有效降低成本？真正可用？找到商业化路径？尚不能做出 100% 的准确判断，但一定需要持续关注。另外，在创新、出海这些线索上，也可以找到需求仍在扩张的行业。

估值方面，市场从 2021 年高点经历了持续的回调，目前不管是 A 股还是港股，整体估值都来到了历史上较低的水平，至少部分行业已经没有此前的明显溢价。具体看，和总需求相关性更高的行业，估值水平基本回到了个位数市盈率，低于 1 的市净率的水平上；新能源作为已经发展到一定规模的新兴产业，估值也普遍回到了市盈率十几倍的水平上，历史最低水平；消费相关的各类资产，白酒基本消灭了 20 倍以上的估值水平，所在的位置也是历史少见的低位。当然这里的估值是会动态变化的，所基于的盈利预测也不见得准确，投资也不能只参考估值低这一个维度，但至少在现在时间点，从估值的角度去考察，权益资产的风险收益比是在明显提升的。如果有企业能兑现前述的第一类机会或第二类机会，当前的估值水平不仅能提供相当不错的安全边际，还蕴含着相当大的上行空间。港股更甚之，估值明显更便宜，对相当一部分资产甚至给出了全球最低的定价水平。为什么定价这么低原因可能很多，比较容易找到的一个解释是客观上确实存在海外投资者投资意愿下降的问题，从资产定价的角度来看，这种并非市场驱动的行为一定会蕴含着巨大的定价错误，未来会是超额收益的重要来源。

展望 2024 年，考虑以上对基本面和估值的观察：估值告诉我们哪怕压力再大也应该更积极一些，而基本面告诉我们需要更多以结构而不是总量的视角去寻找积极的因素。在本基金的可投资范围内，相对符合这些条件的子行业包括快递、航空、燃气等，当然每个子行业在具体的每个要素上会有比较大的差异，因此会呈现出显著不同的风险收益特征。另外港股市场有包括互联网、职业教育、创新药等相当多板块是完全符合我们对基本面和估值的要求的，在基本面实际上有改善的情况下估值又回到了 2022 年的低点附近，我们仍然非常、非常、非常看好港股市场的未来表现。

2023 年我们在快递行业的竞争格局判断、房地产政策和需求的互动两个方面的判断上都有明显失分的地方，持仓的主要上市公司都经历了显著的估值收缩，组合表现不佳，创出了成立了以来的最大回撤，在此向各位信任我们的持有人表示抱歉。未来我们还是希望能够通过自己在个股 alpha 方面的努力，结合一些组合管理的方法，尽可能去改善不利情况下的回撤，在实践中让我们的低波动东权益投资框架实现应有的效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A 基金份额净值为 0.7306 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.28%；截至本报告期末嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C 基金份额净值为 0.7197 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.45%；业绩比较基准收益率为-5.05%。

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	117,843,008.55	91.75
	其中：股票	117,843,008.55	91.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	301,945.48	0.24
	其中：债券	301,945.48	0.24
	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	10,290,448.79	8.01
8	其他资产	8,735.36	0.01
9	合计	128,444,138.18	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 57,792,767.73 元，占基金资产净值的比例为 45.14%。

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	6,181,717.00	4.83
C	制造业	7,594,651.00	5.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,229,338.00	4.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,067,004.00	0.83

G	交通运输、仓储和邮政业	35,214,365.82	27.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	250,455.00	0.20
J	金融业	570,555.00	0.45
K	房地产业	3,942,155.00	3.08
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	60,050,240.82	46.91

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	20,506,898.60	16.02
非必需消费品	8,082,413.07	6.31
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	16,478,187.94	12.87
工业	4,811,810.71	3.76
信息技术	692,714.57	0.54
原材料	-	-
房地产	7,220,742.84	5.64
公用事业	-	-
合计	57,792,767.73	45.14

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	600233	圆通速递	942,700	11,585,783.00	9.05
2	1801 HK	信达生物	199,500	7,728,810.55	6.04
3	700 HK	腾讯控股	27,900	7,423,246.76	5.80
4	1030 HK	新城发展	6,274,000	7,220,742.84	5.64
5	9626 HK	哔哩哔哩-W	82,460	6,994,437.95	5.46
6	002120	韵达股份	840,617	6,271,002.82	4.90
7	603885	吉祥航空	513,248	6,158,976.00	4.81
8	1024 HK	快手-W	126,900	6,089,213.89	4.76
9	002352	顺丰控股	145,800	5,890,320.00	4.60

10	6855 HK	亚盛医药-B	237,100	5,865,808.00	4.58
----	---------	--------	---------	--------------	------

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	301,945.48	0.24
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	301,945.48	0.24

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	019727	23 国债 24	3,000	301,945.48	0.24

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,735.36
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	8,735.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 A	嘉实品质蓝筹一年持有期混合 C
报告期期初基金份额总额	171,864,886.38	6,565,338.84
报告期期间基金总申购份额	133,600.08	100,208.16
减：报告期期间基金总赎回份额	2,949,443.01	406,192.55
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	169,049,043.45	6,259,354.45

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

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

8.2 存放地点

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

8.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 1 月 19 日