

# 嘉实全球互联网股票型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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，并由代董事长签发。

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 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>5</b>  |
| 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.....                         | 6         |
| 2.4 境外资产托管人.....                             | 6         |
| 2.5 信息披露方式.....                              | 6         |
| 2.6 其他相关资料.....                              | 6         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7         |
| 3.3 其他指标.....                                | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b> |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况.....                        | 10        |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 11        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 12        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....       | 13        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 13        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 13        |
| 6.2 利润表.....                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表.....                              | 16        |
| 6.4 报表附注.....                                | 18        |
| <b>§7 投资组合报告</b> .....                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 39        |
| 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....              | 40        |
| 7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....                      | 40        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细 .....     | 41        |
| 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动 .....                   | 43        |
| 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合 .....                | 44        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 .....    | 44        |
| 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 ..... | 44        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细 ..... | 44        |
| 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....   | 44        |
| 7.11 投资组合报告附注 .....                         | 45        |
| <b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>                   | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 45        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 46        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 46        |
| <b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>                   | <b>47</b> |
| <b>§10 重大事件揭示 .....</b>                     | <b>47</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 47        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....      | 47        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 47        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 47        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 47        |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....         | 48        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 48        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 56        |
| <b>§11 备查文件目录 .....</b>                     | <b>57</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                           | 57        |
| 11.2 存放地点 .....                             | 57        |
| 11.3 查阅方式 .....                             | 57        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                      |                     |
|-----------------|----------------------|---------------------|
| 基金名称            | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金     |                     |
| 基金简称            | 嘉实全球互联网股票            |                     |
| 基金主代码           | 000988               |                     |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |                     |
| 基金合同生效日         | 2015年4月15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      | 421,181,293.98份      |                     |
| 基金合同存续期         | 不定期                  |                     |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元 |
| 下属分级基金的交易代码     | 000988               | 000989              |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 391,788,283.77份      | 29,393,010.21份      |

注：嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元现汇基金代码为 000989，嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元现钞基金代码为 000990。如无特指，美元现汇和美元现钞统称美元份额。

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金主要投资互联网行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。   |
| 投资策略   | <p>本基金主要投资全球互联网相关行业股票。对于境内投资，本基金采用中观驱动，精选个股的策略，从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期，充分考虑国内互联网企业处于成长初期，跨界和盈利模式创新丰富的特点，挖掘具有广阔成长空间，良好商业模式，独特竞争优势且估值合理的公司；对于境外投资，本基金采用中观驱动，合理对标的策略，从中观层面分析互联网各子行业发展趋势和景气周期，结合各国互联网企业的发展实际情况，充分利用市场的广度和深度，挖掘具有广阔成长空间，良好商业模式，独特竞争优势且估值合理的公司。</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、衍生品投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 40%×道琼斯互联网指数+45%×中证海外中国互联网指数+15%×中证全指互联网软件与服务指数   |
| 风险收益特征 | 本基金为主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金与混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。同时，本基金为行业基金，在享受全球互联网行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。   |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                           | 基金托管人                       |
|-------------|------|---------------------------------|-----------------------------|
| 名称          |      | 嘉实基金管理有限公司                      | 招商银行股份有限公司                  |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 胡勇钦                             | 张姗                          |
|             | 联系电话 | (010)65215588                   | 400-61-95555                |
|             | 电子邮箱 | service@jsfund.cn               | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 400-600-8800                    | 400-61-95555                |
| 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 境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                         |
|------|----|---------------------------------|
| 名称   | 英文 | Brown Brothers Harriman & Co.   |
|      | 中文 | 布朗兄弟哈里曼银行                       |
| 注册地址 |    | 140 Broadway New York, NY 10005 |
| 办公地址 |    | 140 Broadway New York, NY 10005 |
| 邮政编码 |    | -                               |

## 2.5 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 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               |

## 2.6 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 | 报告期(2024年1月1日-2024年6月30日) |
|-----------|---------------------------|

| 据和指标              | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-<br>人民币 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-<br>美元 |
|-------------------|--------------------------|-------------------------|
| 本期已实现收益           | 38,602,503.01            | 20,088,356.17           |
| 本期利润              | 39,691,033.89            | 29,346,384.10           |
| 加权平均基金份额<br>本期利润  | 0.1061                   | 0.9341                  |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | 4.67%                    | 6.77%                   |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | 6.63%                    | 5.97%                   |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2024年6月30日)         |                         |
| 期末可供分配利<br>润      | 503,025,079.48           | 229,137,716.33          |
| 期末可供分配基<br>金份额利润  | 1.2839                   | 7.7957                  |
| 期末基金资产净<br>值      | 894,813,363.25           | 409,408,140.01          |
| 期末基金份额净<br>值      | 2.284                    | 1.954                   |
| 3.1.3 累计期<br>末指标  | 报告期末(2024年6月30日)         |                         |
| 基金份额累计净<br>值增长率   | 128.40%                  | 95.40%                  |

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。

(4) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元的期末基金份额净值为美元。

## 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

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币

| 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      | -4.32%   | 0.98%       | -1.68%     | 0.56%         | -2.64% | 0.42% |
| 过去三个月      | 1.33%    | 1.90%       | -1.39%     | 1.23%         | 2.72%  | 0.67% |
| 过去六个月      | 6.63%    | 1.90%       | 2.85%      | 1.28%         | 3.78%  | 0.62% |
| 过去一年       | 24.40%   | 1.80%       | 5.10%      | 1.23%         | 19.30% | 0.57% |
| 过去三年       | 2.38%    | 1.94%       | -29.00%    | 1.74%         | 31.38% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 128.40%  | 1.73%       | 60.14%     | 1.50%         | 68.26% | 0.23% |

## 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元

| 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      | -4.54%   | 0.98%       | -1.68%     | 0.56%         | -2.86% | 0.42% |
| 过去三个月      | 0.88%    | 1.91%       | -1.39%     | 1.23%         | 2.27%  | 0.68% |
| 过去六个月      | 5.97%    | 1.91%       | 2.85%      | 1.28%         | 3.12%  | 0.63% |
| 过去一年       | 26.15%   | 1.81%       | 5.10%      | 1.23%         | 21.05% | 0.58% |
| 过去三年       | -7.22%   | 1.96%       | -29.00%    | 1.74%         | 21.78% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 95.40%   | 1.73%       | 60.14%     | 1.50%         | 35.26% | 0.23% |

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：

$$\text{Return}(t) = 40\% \times (\text{道琼斯互联网指数}(t) / \text{道琼斯互联网指数}(t-1) - 1) + 45\% \times (\text{中证海外中国互联网指数}(t) / \text{中证海外中国互联网指数}(t-1) - 1) + 15\% \times (\text{中证全指互联网软件与服务指数}(t) / \text{中证全指互联网软件与服务指数}(t-1) - 1)$$

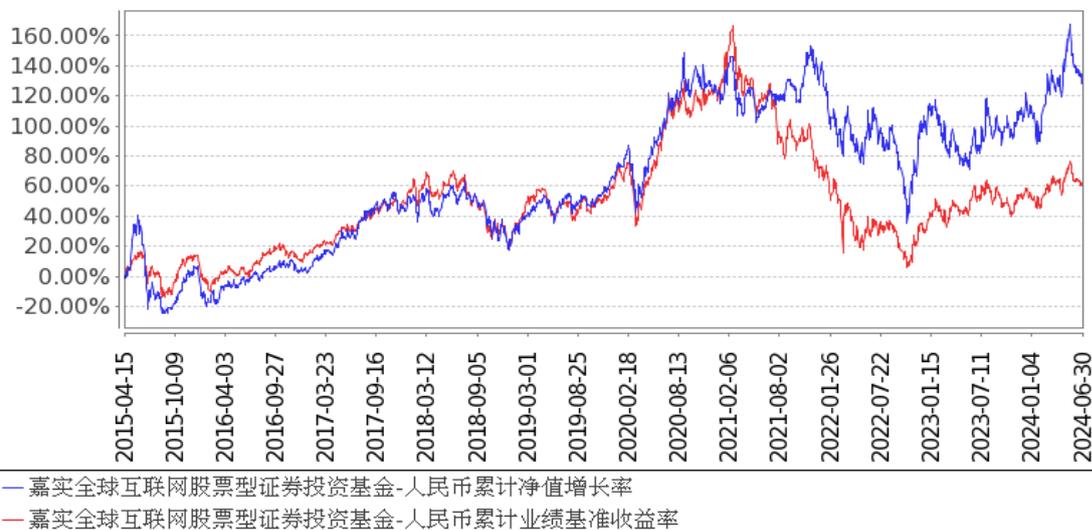
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

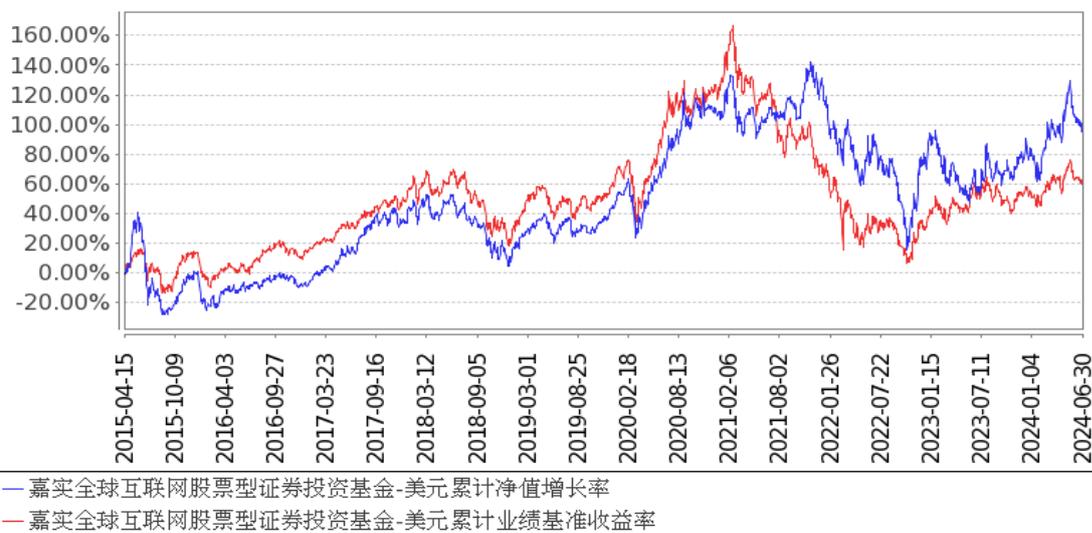
#### 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年04月15日至2024年06月30日)



#### 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元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04月15日至2024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 2024 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 351 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 |        |  |
| 王鑫晨 | 本基金、嘉实港股互联网产业核心资产混合基金经理 | 2021 年 2 月 24 日 | -    | 12 年   | 曾任 SPARX Group、Citigroup Global Markets 研究员。2017 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司任行业研究员。本科，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、《嘉实全球互联网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 9 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

2024 上半年，国内宏观经济预期一再波动。年初市场较悲观，但随着新年消费超预期，在 4 月市场意识到了中国资产的价值洼地，外资大行纷纷上调对中国股票市场的评级。然而临近二季报，我们专注的国内互联网产业的确观察到了一些业绩压力，上市公司对二季度业绩及全年展望都有不同程度的下调。市场悲观情绪又起。港股和中概市场再度调整。很多标的回到了 4 月反弹之前的位置。互联网行业 YTD 的整体表现明显好于去年，但是除了个别大幅度回购支撑股价的公司以外，股价仍有不小的压力。一些泛互联网行业（信息化、消费等）仍然感受到了一些二季度宏观带来的高基数影响，需求有所放缓。同时，我们长期布局的教培板块，由于前期涨幅较大，预期较满，以及市场对“双减”三周年的政策担忧，也迎来了不小的调整。龙头公司调整在 25% 以上。

美国科技股的表现也有结构分化。市场更喜欢半导体为主的 AI 相关标的。我们认为在 AI 应用及变现方式缺失的背景下，对资本支出的投入有下调的风险。AI 是个长期乐观的发展趋势，但是短期市场忽略了半导体天然周期性的属性。估值与业绩预期都在高位，我们抱谨慎态度。我们也积极关注 AI 对美国资产带来的实际影响，积极关注 AI 应用方面的美股资产，包括互联网和软件 software 的赛道。短期来看，估值上的很快，但 AI 应用仍然缺乏，我们配置比例不高。

2024 年上半年我们保持了相对稳定的仓位，也就是保持了中概互联网的绝大部分配置，辅以中国教育类资产的差异化高配置，在当前估值和基本面发展下我们认为仍然有较大空间。近期 Sundar Pichai 坦诚回答了分析师关于互联网厂会不会过度投资 AI 基础设施的问题，表示科技龙头投资不足的风险远远大于过度投资的风险，对 AI 算力的投入正在军备竞赛中。我们认为当前缺乏增收应用的情况如果持续下去，在某个时间点上这种军备竞赛将会产生松动，对整体美股 AI 投资会有较快速且较大的调整。我们仍然在此类标的上持谨慎态度。和其他 QDII 基金相比，我们继续保持对于中国资产的大幅超配。相对市场热捧的美国龙头科技股，我们认为中国资产被极度低估，投资潜力更大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币基金份额净值为 2.284 元,本报告期基金份额净值增长率为 6.63%;截至本报告期末嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元基金份额净值为 1.954 美元,本报告期基金份额净值增长率为 5.97%;业绩比较基准收益率为 2.85%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们重申自己的主要观点:海外中国资产被严重低估。美股 AI 标的存在泡沫。

2024 一季度全市场极度悲观,资本市场经历快速大幅下挫,市场对国内资产价格通缩的忧虑达到了顶点。这与 2023 年开年的预期形成了几乎完全的相反。我们认为 2024 年初的市场悲观过度了。在一季度末我们已经可以感受到经济和企业盈利明显地复苏,并且将保持全年的趋势。二季度业绩虽有下调,但考虑到大部分公司的估值水平,以及去年高基数的原因,也不影响宏观稳步复苏的大趋势。另一方面,海外加息周期已经确定过去,在等待经济数据的放缓来进入降息周期。虽然降息时间表一再被延迟,但整体方向不变,且对国内资产的影响已经不大。在全球配置的选择中,我们仍然偏向国内。从绝对收益的角度思考,海外中国资产有大量低估值标的可以挖掘。

展望下半年,我们预期组合内互联网产业标的有持续业绩复苏表现。经过近期调整,估值又回到了较便宜的位置。教培合规化运营后预期持续增长,是放眼国内增速较快的行业之一。我们预期保持较大仓位露出。美股标的虽然目前低配,在有限的配置中我们也倾向于偏软的互联网与计算机标的,而规避资本支出属性较强的半导体标的。AI 最终需要终端应用的爆发来驱动,没有能产生收入的应用,基础设施军备竞赛的结束只是时间问题。当前估值和展望下,我们预计继续保持对海外中国资产的超配。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求,履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会,估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序,研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验,具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统,设有完善的风险监测、控制和报告机制,与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场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

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：嘉实全球互联网股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 货币资金       | 6.4.7.1 | 167,712,152.40         | 89,621,254.68            |
| 结算备付金      |         | -                      | -                        |
| 存出保证金      |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 1,143,900,369.02       | 1,159,652,916.23         |
| 其中：股票投资    |         | 1,143,900,369.02       | 1,159,652,916.23         |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | -                         | -                           |
| 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         |            | 8,285,042.90              | 9,910,581.87                |
| 应收股利          |            | 2,697,985.55              | 1,428,651.42                |
| 应收申购款         |            | 1,924,248.43              | 1,902,856.35                |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | 8,284,779.21              | 9,910,888.55                |
| 资产总计          |            | 1,332,804,577.51          | 1,272,427,149.10            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                           |                             |
| 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         |            | -                         | 1,919,529.41                |
| 应付赎回款         |            | 17,768,569.90             | 12,214,753.92               |
| 应付管理人报酬       |            | 2,012,113.45              | 1,897,364.58                |
| 应付托管费         |            | 391,244.29                | 368,931.98                  |
| 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          | 6.4.7.9    | 8,411,146.61              | 10,146,785.48               |
| 负债合计          |            | 28,583,074.25             | 26,547,365.37               |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 572,058,707.45            | 582,890,256.42              |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | 732,162,795.81            | 662,989,527.31              |
| 净资产合计         |            | 1,304,221,503.26          | 1,245,879,783.73            |
| 负债和净资产总计      |            | 1,332,804,577.51          | 1,272,427,149.10            |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币基金份额净值

2.284 元，基金份额总额 391,788,283.77 份，嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元基金份额净值 1.954 美元，基金份额总额 29,393,010.21 份，基金份额总额合计为 421,181,293.98 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实全球互联网股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |            | 83,424,190.14                            | -49,685,623.57                                |
| 1. 利息收入                |            | 88,476.70                                | 61,084.09                                     |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13   | 88,476.70                                | 61,084.09                                     |
| 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             |            | -  | -   |
| 其他利息收入                 |            | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 72,023,159.77                            | 14,086,513.76                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14   | 67,268,860.52                            | 12,064,554.94                                 |
| 基金投资收益                 | 6.4.7.15   | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.16   | -  | -   |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.17   | -  | -   |
| 收益                     |            |  |   |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.18   | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.19   | -  | -   |
| 股利收益                   | 6.4.7.20   | 4,754,299.25                             | 2,021,958.82                                  |
| 其他投资收益                 |            | -  | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21   | 10,346,558.81                            | -67,323,150.78                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | 7,010.82                                 | 3,031,277.16                                  |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.22   | 958,984.04                               | 458,652.20                                    |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |            | 14,386,772.15                            | 13,317,715.82                                 |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 11,467,703.22                            | 10,690,290.24                                 |
| 其中：暂估管理人报酬             |            | -  | -   |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 2,229,831.23                             | 2,078,667.49                                  |
| 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. 23 | -                | -                 |
| 7. 税金及附加            |             | -                | -                 |
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 24 | 689, 237. 70     | 548, 758. 09      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |             | 69, 037, 417. 99 | -63, 003, 339. 39 |
| 减：所得税费用             |             | -                | -                 |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |             | 69, 037, 417. 99 | -63, 003, 339. 39 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -                | -                 |
| 六、综合收益总额            |             | 69, 037, 417. 99 | -63, 003, 339. 39 |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实全球互联网股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                  | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 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                           | 582, 890, 256. 42                     | -      | 662, 989, 527. 31  | 1, 245, 879, 783. 73 |
| 二、本期期初净资产                           | 582, 890, 256. 42                     | -      | 662, 989, 527. 31  | 1, 245, 879, 783. 73 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                | -10, 831, 548. 97                     | -      | 69, 173, 268. 50   | 58, 341, 719. 53     |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -      | 69, 037, 417. 99   | 69, 037, 417. 99     |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -10, 831, 548. 97                     | -      | 135, 850. 51       | -10, 695, 698. 46    |
| 其中：1. 基金申购款                         | 147, 352, 050. 03                     | -      | 208, 898, 333. 80  | 356, 250, 383. 83    |
| 2. 基金赎回款                            | -158, 183, 599. 00                    | -      | -208, 762, 483. 29 | -366, 946, 082. 29   |
| （三）、本期向基金份额持有人分                     | -                                     | -      | -                  | -                    |

|  |                                 |        |                |                  |
|--|---------------------------------|--------|----------------|------------------|
| 配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）                |                                 |        |                |                  |
| 四、本期期末净资产                                | 572,058,707.45                  | -      | 732,162,795.81 | 1,304,221,503.26 |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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                                | 624,295,093.50                  | -      | 583,562,558.50 | 1,207,857,652.00 |
| 二、本期期初净资产                                | 624,295,093.50                  | -      | 583,562,558.50 | 1,207,857,652.00 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -13,771,490.48                  | -      | -75,574,243.84 | -89,345,734.32   |
| （一）、综合收益总额                               | -                               | -      | -63,003,339.39 | -63,003,339.39   |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | -13,771,490.48                  | -      | -12,570,904.45 | -26,342,394.93   |
| 其中：1. 基金申购款                              | 88,856,129.33                   | -      | 85,023,828.42  | 173,879,957.75   |
| 2. 基金赎回款                                 | -102,627,619.81                 | -      | -97,594,732.87 | -200,222,352.68  |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                               | -      | -              | -                |
| 四、本期期末净资产                                | 610,523,603.02                  | -      | 507,988,314.66 | 1,118,511,917.68 |

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

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实全球互联网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[2014]1440号《关于准予嘉实全球互联网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《嘉实全球互联网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,《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》于2015年4月15日正式生效,基金合同生效日嘉实全球互联网股票人民币份额3,320,056,116.98份和嘉实全球互联网股票美元份额34,364,248.71份。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,境外托管人为布朗兄弟哈里曼银行。

### 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》、《嘉实全球互联网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[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关境内外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) 对基金从境内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) 对基金在境内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。对基金在境内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。对基金在境内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) 基金在境内卖出股票按 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。自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。

(5) 目前基金取得的源自境外的差价收入, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂不征收企业所得税。

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

(7) 目前基金取得的源自境外的其他收益, 其涉及的境外所得税税收政策, 按照相关国家或地区税收法律和法规执行, 在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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

(9) 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 货币资金

单位: 人民币元

| 项目              | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款            | 167,712,152.40         |
| 等于: 本金          | 167,703,307.70         |
| 加: 应计利息         | 8,844.70               |
| 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          | 167,712,152.40 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目                | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |      |                  |                |
|-------------------|------------------------|------|------------------|----------------|
|                   | 成本                     | 应计利息 | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票                | 984,924,767.10         | -    | 1,143,900,369.02 | 158,975,601.92 |
| 贵金属投资-金交所<br>黄金合约 | -                      | -    | -                | -              |
| 债券                | 交易所市场                  | -    | -                | -              |
|                   | 银行间市场                  | -    | -                | -              |
|                   | 合计                     | -    | -                | -              |
| 资产支持证券            | -                      | -    | -                | -              |
| 基金                | -                      | -    | -                | -              |
| 其他                | -                      | -    | -                | -              |
| 合计                | 984,924,767.10         | -    | 1,143,900,369.02 | 158,975,601.92 |

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息  | -                 |
| 其他应收款 | 8,284,779.21      |
| 待摊费用  | -                 |
| 合计    | 8,284,779.21      |

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 17,202.19         |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | -                 |
| 其中：交易所市场    | -                 |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 108,901.52        |
| 其他          | 8,285,042.90      |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 8,411,146.61 |
|----|--------------|

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                 |
|---------------|----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额            |
| 上年度末          | 375,082,329.08             | 375,082,329.08  |
| 本期申购          | 141,644,076.84             | 141,644,076.84  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -124,938,122.15            | -124,938,122.15 |
| 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           | 391,788,283.77             | 391,788,283.77  |

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元

| 项目            | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 33,882,900.01              | 207,807,927.34 |
| 本期申购          | 930,615.67                 | 5,707,973.19   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -5,420,505.47              | -33,245,476.85 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                          | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                          | -              |
| 本期申购          | -                          | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                          | -              |
| 本期末           | 29,393,010.21              | 180,270,423.68 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币

| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 553,773,331.95  | -125,397,917.31 | 428,375,414.64  |
| 本期期初           | 553,773,331.95  | -125,397,917.31 | 428,375,414.64  |
| 本期利润           | 38,602,503.01   | 1,088,530.88    | 39,691,033.89   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 27,389,617.71   | 7,569,013.24    | 34,958,630.95   |
| 其中：基金申购款       | 219,855,061.19  | -18,727,832.03  | 201,127,229.16  |
| 基金赎回款          | -192,465,443.48 | 26,296,845.27   | -166,168,598.21 |

|         |                |                 |                |
|---------|----------------|-----------------|----------------|
| 本期已分配利润 | -              | -               | -              |
| 本期末     | 619,765,452.67 | -116,740,373.19 | 503,025,079.48 |

## 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 303,438,602.46 | -68,824,489.79 | 234,614,112.67 |
| 本期期初           | 303,438,602.46 | -68,824,489.79 | 234,614,112.67 |
| 本期利润           | 20,088,356.17  | 9,258,027.93   | 29,346,384.10  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -41,404,338.05 | 6,581,557.61   | -34,822,780.44 |
| 其中：基金申购款       | 8,733,220.41   | -962,115.77    | 7,771,104.64   |
| 基金赎回款          | -50,137,558.46 | 7,543,673.38   | -42,593,885.08 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 282,122,620.58 | -52,984,904.25 | 229,137,716.33 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 88,345.70            |
| 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 | -                    |
| 其他        | 131.00               |
| 合计        | 88,476.70            |

## 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                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 67,268,860.52        |
| 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               | 67,268,860.52        |

## 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                   |
|------------|----------------------|
|            | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 349,660,505.50       |
| 减：卖出股票成本总额 | 280,919,869.90       |
| 减：交易费用     | 1,471,775.08         |

|          |               |
|----------|---------------|
| 买卖股票差价收入 | 67,268,860.52 |
|----------|---------------|

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.15 基金投资收益

无。

#### 6.4.7.16 债券投资收益

##### 6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

##### 6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.18 贵金属投资收益

##### 6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.19 衍生工具收益

## 6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                   |
|---------------|----------------------|
|               | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 4,754,299.25         |
| 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            | 4,754,299.25         |

## 6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产             | 10,346,558.81        |
| 股票投资                   | 10,346,558.81        |
| 债券投资                   | -                    |
| 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                     | 10,346,558.81        |

## 6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2024年1月1日至2024年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 958,984.04           |
| 合计      | 958,984.04           |

**6.4.7.23 信用减值损失**

无。

**6.4.7.24 其他费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 49,229.18                  |
| 信息披露费     | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金   | -                          |
| 银行划款手续费   | 2,603.23                   |
| 债券托管账户维护费 | 9,000.00                   |
| 其他        | 568,732.95                 |
| 合计        | 689,237.70                 |

**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   |
| 布朗兄弟哈里曼银行          | 境外资产托管人 |

**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 基金交易**

无。

**6.4.10.1.5 权证交易**

无。

**6.4.10.1.6 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 11,467,703.22              | 10,690,290.24                   |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 4,364,024.01               | 4,266,206.68                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 7,103,679.21               | 6,424,083.56                    |

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 1.80%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×1.80%/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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,229,831.23               | 2,078,667.49                    |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.35%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×0.35%/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固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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |           | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023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 | 85,553,443.52              | 88,345.70 | 23,802,711.07                   | 61,001.35 |
| 布朗兄弟哈里曼银行_活期  | 82,158,708.88              | -         | 97,094,309.42                   | -         |

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（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024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

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

本基金为主动投资的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，为证券投资基金中的较高预期风险、较高预期收益的投资品种。同时本基金为行业基金，在享受全球互联网行业收益的同时，也必须承担单一行业带来的风险。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是主要投资互联网行业股票，在严格控制风险的前提下，追求超越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 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

#### 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<br>2024年6月30日 | 1年以内           | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
|-------------------|----------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产                |                |      |      |                  |                  |
| 货币资金              | 167,712,152.40 | -    | -    | -                | 167,712,152.40   |
| 结算备付金             | -              | -    | -    | -                | -                |
| 存出保证金             | -              | -    | -    | -                | -                |
| 交易性金融资产           | -              | -    | -    | 1,143,900,369.02 | 1,143,900,369.02 |
| 衍生金融资产            | -              | -    | -    | -                | -                |
| 买入返售金融资产          | -              | -    | -    | -                | -                |
| 应收清算款             | -              | -    | -    | 8,285,042.90     | 8,285,042.90     |
| 债权投资              | -              | -    | -    | -                | -                |

|                          |                |       |       |                  |                  |
|--------------------------|----------------|-------|-------|------------------|------------------|
| 应收股利                     | -              | -     | -     | 2,697,985.55     | 2,697,985.55     |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 1,924,248.43     | 1,924,248.43     |
| 递延所得税资产                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 其他资产                     | -              | -     | -     | 8,284,779.21     | 8,284,779.21     |
| 资产总计                     | 167,712,152.40 | -     | -     | 1,165,092,425.11 | 1,332,804,577.51 |
| 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                    | -              | -     | -     | 17,768,569.90    | 17,768,569.90    |
| 应付管理人报酬                  | -              | -     | -     | 2,012,113.45     | 2,012,113.45     |
| 应付托管费                    | -              | -     | -     | 391,244.29       | 391,244.29       |
| 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                     | -              | -     | -     | 8,411,146.61     | 8,411,146.61     |
| 负债总计                     | -              | -     | -     | 28,583,074.25    | 28,583,074.25    |
| 利率敏感度缺口                  | 167,712,152.40 | -     | -     | 1,136,509,350.86 | 1,304,221,503.26 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | 1 年以内          | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息              | 合计               |
| 资产                       |                |       |       |                  |                  |
| 货币资金                     | 89,621,254.68  | -     | -     | -                | 89,621,254.68    |
| 结算备付金                    | -              | -     | -     | -                | -                |
| 存出保证金                    | -              | -     | -     | -                | -                |
| 交易性金融资产                  | -              | -     | -     | 1,159,652,916.23 | 1,159,652,916.23 |
| 衍生金融资产                   | -              | -     | -     | -                | -                |
| 买入返售金融资产                 | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应收清算款                    | -              | -     | -     | 9,910,581.87     | 9,910,581.87     |
| 债权投资                     | -              | -     | -     | -                | -                |
| 应收股利                     | -              | -     | -     | 1,428,651.42     | 1,428,651.42     |
| 应收申购款                    | -              | -     | -     | 1,902,856.35     | 1,902,856.35     |
| 递延所得税资产                  | -              | -     | -     | -                | -                |
| 其他资产                     | -              | -     | -     | 9,910,888.55     | 9,910,888.55     |
| 资产总计                     | 89,621,254.68  | -     | -     | 1,182,805,894.42 | 1,272,427,149.10 |
| 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     | -             | - | 1,919,529.41     | 1,919,529.41     |
| 应付赎回款     | -             | - | 12,214,753.92    | 12,214,753.92    |
| 应付管理人报酬   | -             | - | 1,897,364.58     | 1,897,364.58     |
| 应付托管费     | -             | - | 368,931.98       | 368,931.98       |
| 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      | -             | - | 10,146,785.48    | 10,146,785.48    |
| 负债总计      | -             | - | 26,547,365.37    | 26,547,365.37    |
| 利率敏感度缺口   | 89,621,254.68 | - | 1,156,258,529.05 | 1,245,879,783.73 |

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 |                             |                   |
|-------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析          | 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（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |
|             | 市场利率上升25个基点        | -                           | -                 |
| 市场利率下降25个基点 | -                  | -                           |                   |

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024年6月30日 |    |      |    |
|----|-------------------|----|------|----|
|    | 美元                | 港币 | 其他币种 | 合计 |
|    |                   |    |      |    |

|          | 折合人民币          | 折合人民币          | 折合人民币 |                  |
|----------|----------------|----------------|-------|------------------|
| 以外币计价的资产 |                |                |       |                  |
| 货币资金     | 85,883,144.91  | -              | -     | 85,883,144.91    |
| 结算备付金    | -              | -              | -     | -                |
| 存出保证金    | -              | -              | -     | -                |
| 交易性金融资产  | 746,958,678.64 | 396,941,690.38 | -     | 1,143,900,369.02 |
| 衍生金融资产   | -              | -              | -     | -                |
| 债权投资     | -              | -              | -     | -                |
| 应收股利     | 2,697,985.55   | -              | -     | 2,697,985.55     |
| 应收申购款    | 234,653.60     | -              | -     | 234,653.60       |
| 应收清算款    | -              | 8,285,042.90   | -     | 8,285,042.90     |
| 其他资产     | 8,284,779.21   | -              | -     | 8,284,779.21     |
| 资产合计     | 844,059,241.91 | 405,226,733.28 | -     | 1,249,285,975.19 |
| 以外币计价的负债 |                |                |       |                  |
| 应付清算款    | -              | -              | -     | -                |
| 衍生金融负债   | -              | -              | -     | -                |
| 应付赎回款    | 1,931,624.28   | -              | -     | 1,931,624.28     |
| 应付管理人报酬  | -              | -              | -     | -                |
| 应付托管费    | -              | -              | -     | -                |
| 应付销售服务费  | -              | -              | -     | -                |
| 应付投资顾问   | -              | -              | -     | -                |

|                   |                     |                |               |                  |
|-------------------|---------------------|----------------|---------------|------------------|
| 费                 |                     |                |               |                  |
| 其他负债              | 353.70              | 8,285,042.90   | -             | 8,285,396.60     |
| 负债合计              | 1,931,977.98        | 8,285,042.90   | -             | 10,217,020.88    |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净额 | 842,127,263.93      | 396,941,690.38 | -             | 1,239,068,954.31 |
| 项目                | 上年度末<br>2023年12月31日 |                |               |                  |
|                   | 美元<br>折合人民币         | 港币<br>折合人民币    | 其他币种<br>折合人民币 | 合计               |
| 以外币计价的<br>资产      |                     |                |               |                  |
| 货币资金              | 59,042,330.76       | -              | -             | 59,042,330.76    |
| 结算备付金             | -                   | -              | -             | -                |
| 存出保证金             | -                   | -              | -             | -                |
| 交易性金融资产           | 774,202,162.34      | 385,450,753.89 | -             | 1,159,652,916.23 |
| 衍生金融资产            | -                   | -              | -             | -                |
| 债权投资              | -                   | -              | -             | -                |
| 应收股利              | 1,428,651.42        | -              | -             | 1,428,651.42     |
| 应收申购款             | 44,292.02           | -              | -             | 44,292.02        |
| 应收清算款             | -                   | 9,910,581.87   | -             | 9,910,581.87     |
| 其他资产              | 9,910,888.55        | -              | -             | 9,910,888.55     |
| 资产合计              | 844,628,325.09      | 395,361,335.76 | -             | 1,239,989,660.85 |
| 以外币计价的<br>负债      |                     |                |               |                  |
| 应付清算款             | 1,919,529           | -              | -             | 1,919,529.41     |

|                   |                       |                   |   |                      |
|-------------------|-----------------------|-------------------|---|----------------------|
|                   | . 41                  |                   |   |                      |
| 衍生金融负债            | -                     | -                 | - | -                    |
| 应付赎回款             | 1, 826, 135<br>. 52   | -                 | - | 1, 826, 135. 52      |
| 应付管理人报酬           | -                     | -                 | - | -                    |
| 应付托管费             | -                     | -                 | - | -                    |
| 应付销售服务费           | -                     | -                 | - | -                    |
| 应付投资顾问费           | -                     | -                 | - | -                    |
| 其他负债              | 819. 82               | 9, 910, 581. 87   | - | 9, 911, 401. 69      |
| 负债合计              | 3, 746, 484<br>. 75   | 9, 910, 581. 87   | - | 13, 657, 066. 62     |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净额 | 840, 881, 8<br>40. 34 | 385, 450, 753. 89 | - | 1, 226, 332, 594. 23 |

#### 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  |                             |                   |
|---------------|-------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析            | 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（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |
|               | 所有外币相对人民币升值5%     | 61, 953, 447. 72            | 61, 316, 629. 71  |
| 所有外币相对人民币贬值5% | -61, 953, 447. 72 | -61, 316, 629. 71           |                   |

#### 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<br>2024年6月30日 |                   | 上年度末<br>2023年12月31日 |                   |
|---------------|-------------------|-------------------|---------------------|-------------------|
|               | 公允价值              | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 1,143,900,369.02  | 87.71             | 1,159,652,916.23    | 93.08             |
| 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            | 1,143,900,369.02  | 87.71             | 1,159,652,916.23    | 93.08             |

#### 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 |                             |                   |
|------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析         | 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（2024年6月30日）             | 上年度末（2023年12月31日） |
|            | 业绩比较基准上升5%         | 82,147,453.45               | 71,923,254.55     |
| 业绩比较基准下降5% | -82,147,453.45     | -71,923,254.55              |                   |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 1,143,900,369.02       | 1,159,652,916.23         |
| 第二层次          | -                      | -                        |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 1,143,900,369.02       | 1,159,652,916.23         |

##### 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   | 1,143,900,369.02 | 85.83         |
|    | 其中：普通股 | 558,067,741.51   | 41.87         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 存托凭证              | 585,832,627.51   | 43.95  |
|   | 优先股               | -                | -      |
|   | 房地产信托凭证           | -                | -      |
| 2 | 基金投资              | -                | -      |
| 3 | 固定收益投资            | -                | -      |
|   | 其中：债券             | -                | -      |
|   | 资产支持证券            | -                | -      |
| 4 | 金融衍生品投资           | -                | -      |
|   | 其中：远期             | -                | -      |
|   | 期货                | -                | -      |
|   | 期权                | -                | -      |
|   | 权证                | -                | -      |
| 5 | 买入返售金融资产          | -                | -      |
|   | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -                | -      |
| 6 | 货币市场工具            | -                | -      |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计      | 167,712,152.40   | 12.58  |
| 8 | 其他各项资产            | 21,192,056.09    | 1.59   |
| 9 | 合计                | 1,332,804,577.51 | 100.00 |

## 7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------------|--------------|
| 美国     | 746,958,678.64   | 57.27        |
| 中国香港   | 396,941,690.38   | 30.44        |
| 合计     | 1,143,900,369.02 | 87.71        |

## 7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------------|--------------|
| 通信服务   | 346,147,744.31   | 26.54        |
| 非必需消费品 | 671,811,506.79   | 51.51        |
| 必需消费品  | -                | -            |
| 能源     | -                | -            |
| 金融     | 37,714,968.59    | 2.89         |
| 医疗保健   | -                | -            |
| 工业     | -                | -            |
| 信息技术   | 57,972,883.33    | 4.45         |
| 原材料    | -                | -            |
| 房地产    | 30,253,266.00    | 2.32         |
| 公用事业   | -                | -            |
| 合计     | 1,143,900,369.02 | 87.71        |

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

## 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称<br>(英文)              | 公司名称<br>(中文) | 证券代<br>码 | 所在证<br>券市场 | 所属<br>国家<br>(地<br>区) | 数量<br>(股) | 公允价值           | 占基<br>金资<br>产净<br>值比<br>例(%) |
|----|---------------------------|--------------|----------|------------|----------------------|-----------|----------------|------------------------------|
| 1  | Tencent Holdings Ltd      | 腾讯控股有限公司     | 700 HK   | 香港证券交易所    | 中国香港                 | 367,000   | 124,736,705.74 | 9.56                         |
| 2  | Meituan                   | 美团           | 3690 HK  | 香港证券交易所    | 中国香港                 | 1,180,000 | 119,650,522.64 | 9.17                         |
| 3  | TAL Education Group       | 好未来教育集团      | TAL UN   | 纽约证券交易所    | 美国                   | 1,555,000 | 118,246,796.58 | 9.07                         |
| 4  | Alibaba Group Holding Ltd | 阿里巴巴集团控股有限公司 | 9988 HK  | 香港证券交易所    | 中国香港                 | 974,000   | 62,670,997.56  | 4.81                         |
| 4  | Alibaba Group Holding Ltd | 阿里巴巴集团控股有限公司 | BABA UN  | 纽约证券交易所    | 美国                   | 107,600   | 55,212,744.96  | 4.23                         |
| 5  | PDD Holdings Inc          | 拼多多          | PDD UW   | 纳斯达克证券交易所  | 美国                   | 103,500   | 98,067,084.21  | 7.52                         |
| 6  | Gaotu Techedu Inc         | 高途教育科技集团有限公司 | GOTU UN  | 纽约证券交易所    | 美国                   | 2,473,915 | 86,392,377.37  | 6.62                         |
| 7  | iQIYI Inc                 | 爱奇艺          | IQ UW    | 纳斯达克证券交易所  | 美国                   | 2,670,000 | 69,834,800.52  | 5.35                         |
| 8  | GigaCloud Technology Inc  | 大健云仓科技有限公司   | GCT UQ   | 纳斯达克证券交易所  | 美国                   | 302,950   | 65,678,728.71  | 5.04                         |
| 9  | Microsoft Corp            | 微软           | MSFT UW  | 纳斯达克证券交易所  | 美国                   | 18,200    | 57,972,883.33  | 4.45                         |
| 10 | Kuaishou Technology       | 快手科技         | 1024 HK  | 香港证券交易所    | 中国香港                 | 1,270,000 | 53,492,631.14  | 4.10                         |

|    |   |               |          |           |      |         |               |      |
|----|---|---------------|----------|-----------|------|---------|---------------|------|
| 11 | New Oriental Education & Technology Group Inc | 新东方教育科技集团     | EDU UN   | 纽约证券交易所   | 美国   | 90,000  | 49,856,954.76 | 3.82 |
| 12 | Baidu Inc                                     | 百度集团股份有限公司    | BIDU UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 35,600  | 21,941,193.64 | 1.68 |
| 12 | Baidu Inc                                     | 百度集团股份有限公司    | 9888 HK  | 香港证券交易所   | 中国香港 | 170,000 | 13,227,014.90 | 1.01 |
| 13 | Bilibili Inc                                  | 哔哩哔哩股份有限公司    | 9626 HK  | 香港证券交易所   | 中国香港 | 200,000 | 23,163,818.40 | 1.78 |
| 13 | Bilibili Inc                                  | 哔哩哔哩股份有限公司    | BILI UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 100,000 | 11,003,779.20 | 0.84 |
| 14 | KE Holdings Inc                               | 贝壳控股有限公司      | BEKE UN  | 纽约证券交易所   | 美国   | 300,000 | 30,253,266.00 | 2.32 |
| 15 | Futu Holdings Ltd                             | 富途控股有限公司      | FUTU UQ  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 62,000  | 28,988,330.27 | 2.22 |
| 16 | Meta Platforms Inc                            | Meta 平台股份有限公司 | META UW  | 纳斯达克证券交易所 | 美国   | 8,000   | 28,747,800.77 | 2.20 |
| 17 | Vipshop Holdings Ltd                          | 唯品会控股有限公司     | VIPS UN  | 纽约证券交易所   | 美国   | 100,000 | 9,279,093.60  | 0.71 |
| 18 | Berkshire Hathaway Inc                        | 伯克希尔哈撒韦公司     | BRK/A UN | 纽约证券交易所   | 美国   | 2       | 8,726,638.32  | 0.67 |
| 19 | ATRenew Inc                                   | 万物新生          | RERE UN  | 纽约证券交易所   | 美国   | 400,000 | 6,756,206.40  | 0.52 |

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

## 7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

## 7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                  | 证券代码    | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|---------------------------|---------|---------------|----------------|
| 1  | GigaCloud Technology Inc  | GCT UQ  | 70,847,984.60 | 5.69           |
| 2  | Meituan                   | 3690 HK | 35,152,444.81 | 2.82           |
| 3  | TAL Education Group       | TAL UN  | 27,213,881.12 | 2.18           |
| 4  | Meta Platforms Inc        | META UW | 26,940,352.38 | 2.16           |
| 5  | Alibaba Group Holding Ltd | BABA UN | 18,086,409.23 | 1.45           |
| 5  | Alibaba Group Holding Ltd | 9988 HK | 4,439,234.01  | 0.36           |
| 6  | iQIYI Inc                 | IQ UW   | 18,746,196.70 | 1.50           |
| 7  | Futu Holdings Ltd         | FUTU UQ | 13,586,623.14 | 1.09           |
| 8  | KE Holdings Inc           | BEKE UN | 10,856,081.32 | 0.87           |
| 9  | Kuaishou Technology       | 1024 HK | 9,393,165.29  | 0.75           |
| 10 | ATRenew Inc               | RERE UN | 8,200,892.88  | 0.66           |
| 11 | Tencent Holdings Ltd      | 700 HK  | 5,689,943.02  | 0.46           |
| 12 | Baidu Inc                 | BIDU UW | 5,667,555.38  | 0.45           |

注：报告期内，本基金累计买入金额前 20 名的股票明细仅包括上述 13 只股票。

## 7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                                      | 证券代码    | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|---|---------|---------------|----------------|
| 1  | Gaotu Techedu Inc                             | GOTU UN | 97,978,130.22 | 7.86           |
| 2  | New Oriental Education & Technology Group Inc | 9901 HK | 29,400,200.85 | 2.36           |
| 2  | New Oriental Education & Technology Group Inc | EDU UN  | 23,842,092.31 | 1.91           |
| 3  | Bilibili Inc                                  | 9626 HK | 28,550,423.28 | 2.29           |
| 3  | Bilibili Inc                                  | BILI UW | 20,867,236.97 | 1.67           |
| 4  | Kanzhun Ltd                                   | BZ UW   | 37,479,769.29 | 3.01           |
| 5  | Baidu Inc                                     | 9888 HK | 14,044,235.50 | 1.13           |
| 5  | Baidu Inc                                     | BIDU UW | 6,436,455.75  | 0.52           |
| 6  | Apple Inc                                     | AAPL UW | 19,628,311.20 | 1.58           |

|    |   |         |               |      |
|----|---|---------|---------------|------|
| 7  | Microsoft Corp                              | MSFT UW | 13,993,684.14 | 1.12 |
| 8  | Kuaishou Technology                         | 1024 HK | 13,326,792.29 | 1.07 |
| 9  | Monolithic Power Systems Inc                | MPWR UW | 12,546,572.74 | 1.01 |
| 10 | Meituan                                     | 3690 HK | 8,311,045.78  | 0.67 |
| 11 | NVIDIA Corp                                 | NVDA UW | 6,767,733.14  | 0.54 |
| 12 | Alibaba Group Holding Ltd                   | BABA UN | 6,367,669.09  | 0.51 |
| 13 | Kingdee International Software Group Co Ltd | 268 HK  | 5,204,139.87  | 0.42 |
| 14 | Weimob Inc                                  | 2013 HK | 3,608,240.74  | 0.29 |
| 15 | Tongdao Liepin Group                        | 6100 HK | 1,307,772.34  | 0.10 |

注：报告期内，本基金累计卖出金额前 20 名的股票明细仅包括上述 18 只股票。

### 7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

|            |                |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 254,820,763.88 |
| 卖出收入（成交）总额 | 349,660,505.50 |

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 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。

### 7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

### 7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

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 | -             |
| 2  | 应收清算款 | 8,285,042.90  |
| 3  | 应收股利  | 2,697,985.55  |
| 4  | 应收利息  | -             |
| 5  | 应收申购款 | 1,924,248.43  |
| 6  | 其他应收款 | 8,284,779.21  |
| 7  | 待摊费用  | -             |
| 8  | 其他    | -             |
| 9  | 合计    | 21,192,056.09 |

### 7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 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

| 份额级别         | 持有人户数<br>(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<br>(%) | 持有份额           | 占总份额比例<br>(%) |
| 嘉实全球互联网股票型证券 | 70,785       | 5,534.91  | 56,419,557.45 | 14.40         | 335,368,726.32 | 85.60         |

|                     |        |          |               |       |                |        |
|---------------------|--------|----------|---------------|-------|----------------|--------|
| 投资基金-人民币            |        |          |               |       |                |        |
| 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元 | 3,782  | 7,771.82 | -             | -     | 29,393,010.21  | 100.00 |
| 合计                  | 74,205 | 5,675.92 | 56,419,557.45 | 13.40 | 364,761,736.53 | 86.60  |

注：(1) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币总份额比例、个人投资者持有嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币份额占嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币总份额比例；

(2) 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元份额占嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元总份额比例、个人投资者持有嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元份额占嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元总份额比例。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别                 | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|----------------------|--------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | 5,058,432.39 | 1.29        |
|                  | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元  | 13,019.88    | 0.04        |
|                  | 合计                   | 5,071,452.27 | 1.20        |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|----------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | >100              |
|                                | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元  | 0                 |
|                                | 合计                   | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | 0~10              |
|                                | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元  | 0                 |
|                                | 合计                   | 0~10              |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-人民币 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金-美元 |
|-----------------------------------|----------------------|---------------------|
| 基金合同生效日<br>(2015年4月15日)<br>基金份额总额 | 3,320,056,116.98     | 34,364,248.71       |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 375,082,329.08       | 33,882,900.01       |
| 本报告期基金总申购份额                       | 141,644,076.84       | 930,615.67          |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 124,938,122.15       | 5,420,505.47        |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -                    | -                   |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 391,788,283.77       | 29,393,010.21       |

## § 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

## (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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员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 (%) |      |
| 招商证券<br>(香港)有限公司<br>China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.     | -      | 142,221,917.03 | 23.53            | 393,925.20 | 30.36          | -    |
| 元大证券<br>(香港)有限公司<br>Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited | -      | 97,713,409.38  | 16.16            | 217,020.44 | 16.73          | -    |
| 招银国际<br>证券有限公司<br>CMB International Securities Limited            | -      | 87,231,441.38  | 14.43            | 134,715.77 | 10.38          | 新增1个 |
| 花旗环球<br>金融亚洲  | -      | 73,833,495.55  | 12.21            | 46,025.26  | 3.55           | -    |

|  |   |               |      |            |       |   |
|--|---|---------------|------|------------|-------|---|
| 有限公司<br>Citigroup<br>Global Markets Asia<br>Limited  |   |               |      |            |       |   |
| 信达国际<br>证券有限公司<br>CINDA<br>INTERNATIONAL SECURITIES<br>LIMITED                                       | - | 43,854,486.34 | 7.25 | 87,708.97  | 6.76  | - |
| 华兴证券<br>有限公司<br>China<br>Renaissance Security  | - | 41,928,618.39 | 6.94 | 33,656.84  | 2.59  | - |
| 中国国际<br>金融香港<br>证券有限公司<br>China<br>International Capital Corporation<br>Hong Kong Securities Limited | - | 40,997,647.56 | 6.78 | 242,127.44 | 18.66 | - |
| 里昂证券<br>有限公司<br>CLSA Limited   | - | 39,864,441.22 | 6.59 | 12,785.24  | 0.99  | - |
| 申万宏源<br>(香港)有限公司<br>Shenwan<br>Hongyuan Securities<br>(H.K.) Limited                                 | - | 26,197,300.60 | 4.33 | 86,915.18  | 6.70  | - |

|  |   |                   |      |           |      |          |
|--|---|-------------------|------|-----------|------|----------|
| imited   |   |                   |      |           |      |          |
| 华泰金融<br>控股<br>Huatai<br>Financi<br>al Holdi<br>ngs                                       | - | 10,638,511.9<br>2 | 1.76 | 42,612.00 | 3.28 | 新增<br>1个 |
| 德意志银<br>行股份有<br>限公司<br>Deutsche<br>Bank  | - | -                 | -    | -         | -    | -        |
| 法国巴黎<br>证券(亚<br>洲)有限公<br>司BNP<br>PARIBAS<br>Securitie<br>s (Asia)<br>Limited             | - | -                 | -    | -         | -    | -        |
| 高盛(亚<br>洲)有限责<br>任公司<br>Goldman<br>Sachs<br>(Asia) L<br>.L.C                             | - | -                 | -    | -         | -    | -        |
| 工银国际<br>证券有限<br>公司<br>ICBC I<br>nternatio<br>nal Secu<br>rities L<br>imited              | - | -                 | -    | -         | -    | -        |
| 广发证券<br>(香港)经<br>济有限公<br>司<br>GF Sec<br>urities<br>(Hong Ko<br>ng) Brok<br>erage Lt<br>d | - | -                 | -    | -         | -    | -        |

|  |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|
| 海通国际<br>证券有限<br>公司<br>Haitong<br>Interna<br>tional S<br>ecurities<br>Company<br>Ltd. | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券<br>股份有限<br>公司<br>HUATAI<br>SECURIT<br>IES CO.,<br>LTD.                          | - | - | - | - | - | - |
| 建银国际<br>证券有限<br>公司<br>CCB In<br>ternation<br>al Secur<br>ities Li<br>mited           | - | - | - | - | - | - |
| 金贝塔证<br>券有限公<br>司<br>iGoldenbe<br>ta Sec<br>urities<br>Company<br>Limited            | - | - | - | - | - | - |
| 联昌证券<br>有限公司<br>CIMB S<br>ecurities<br>Limited                                       | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理银<br>行有限公<br>司香港分<br>行<br>Macquaire<br>Bank<br>Limited<br>Hong K                  | - | - | - | - | - | - |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| ong Branch.   |   |   |   |   |   |   |
| 麦格理资本证券<br>股份有限公司<br>Macquarie<br>Securities<br>Group                           | - | - | - | - | - | - |
| 美林(亚太)<br>有限公司<br>Merrill<br>Lynch<br>(Asia Pacific)<br>Limited                 | - | - | - | - | - | - |
| 摩根大通<br>证券(亚太)<br>有限公司<br>J.P.Morgan<br>Securities<br>(Asia Pacific)<br>Limited | - | - | - | - | - | - |
| 摩根士丹<br>利亚洲有<br>限公司<br>Morgan<br>Stanley<br>Asia<br>Limited                     | - | - | - | - | - | - |
| 瑞士信贷<br>(香港)有<br>限公司<br>Credit<br>Suisse<br>(Hong Kong)<br>Limited              | - | - | - | - | - | - |
| 瑞穗证券<br>亚洲有限  | - | - | - | - | - | - |

|  |   |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|---|
| 公司<br>Mizuho<br>Securiti<br>ies Asia<br>Limited  |   |   |   |   |   |   |   |
| 瑞银集团<br>Union<br>Bank of<br>Switzer<br>land  | - | - | - | - | - | - | - |
| 盛博香港<br>有限公司<br>Sanford<br>C. Ber<br>nstein<br>(Hong Ko<br>ng) Limi<br>ted                                       | - | - | - | - | - | - | - |
| 野村证券<br>NOMURA   | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰国际<br>证券有限<br>公司<br>ZHONGTAI<br>INTER<br>NATIONAL<br>SECURIT<br>IES<br>LIMITED                                 | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投<br>(国际)证<br>券有限公<br>司<br>China<br>Securitie<br>s<br>(Internat<br>ional) B<br>rokerage<br>Company<br>Limited | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司<br>Citic  | - | - | - | - | - | - | - |

|   |   |   |   |   |   |   |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Securities Company Limited  |   |   |   |   |   |   |
| 中银国际<br>证券有限公司<br>BOCI Securities Limited                                     | - | - | - | - | - | - |
| 美林证券<br>公司<br>Bank of America Merrill Lynch                                   | - | - | - | - | - | - |
| 香港上海<br>汇丰银行<br>有限公司<br>The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited | - | - | - | - | - | - |

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。

## 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 | 基金交易 |
|------|------|--------|------|------|
|------|------|--------|------|------|

|  | 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 (%) | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 (%) |
|--|------|------------------|------|--------------------|------|------------------|------|------------------|
| 招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.                                 | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited                             | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 招银国际证券有限公司<br>CMB International Securities Limited                                     | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 花旗环球金融亚洲有限公司<br>Citigroup Global Markets Asia Limited                                  | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 信达国际证券有限公司<br>CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED                                   | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 华兴证券有限公司 China Renaissance Security  | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 中国国际金融香港证券有限公司<br>China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 里昂证券有限公司 CLSA Limited  | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 申万宏源(香港)有限公司 Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited                                | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 华泰金融控股 Huatai Financial Holdings   | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank  | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited                                   | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C  | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 工银国际证券有限公司<br>ICBC International Securities Limited                                    | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd                                 | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |
| 海通国际证券有限公司   | -    | -                | -    | -                  | -    | -                | -    | -                |

|  |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Haitong International Securities Company Ltd.                                | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 HUATAI SECURITIES CO.,LTD.  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 建银国际证券有限公司<br>CCB International Securities Limited                           | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 金贝塔证券有限公司<br>iGoldenbeta Securities Company Limited                          | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理银行有限公司香港分行<br>Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.                    | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 麦格理资本证券股份有限公司<br>Macquarie Securities Group                                  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 美林（亚太）有限公司 Merrill Lynch<br>(Asia Pacific) Limited                           | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 摩根大通证券（亚太）有限公司 J.P.Morgan Securities<br>(Asia Pacific) Limited               | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 摩根士丹利亚洲有限公司<br>Morgan Stanley Asia Limited                                   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞士信贷（香港）有限公司 Credit Suisse<br>(Hong Kong) Limited                            | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞穗证券亚洲有限公司<br>Mizuho Securities Asia Limited                                 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银集团 Union Bank of Switzerland   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein<br>(Hong Kong) Limited                         | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 野村证券 NOMURA  | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中泰国际证券有限公司<br>ZHONGTAI INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED                      | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投（国际）证券有限公司 China Securities<br>(International) Brokerage Company Limited | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司<br>Citic Securities Company Limited                               | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch   | - | - | - | - | - | - | - | - |
| 香港上海汇丰银行有限公司<br>The Hongkong and Shanghai Banking Corporation<br>Limited     | - | - | - | - | - | - | - | - |

## 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  | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 1 月 15 日暂停申购、赎回及定投业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 1 月 11 日 |
| 2  | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 2 月                     | 上海证券报、基金管理                  | 2024 年 2 月 7 日  |

|   |  |                             |                 |
|---|--|-----------------------------|-----------------|
|   | 19 日暂停申购、赎回及定投业务的公告                                    | 人网站及中国证监会基金电子披露网站           |                 |
| 3 | 嘉实全球互联网股票型证券投资基金暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告                   | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 23 日 |
| 4 | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 3 月 29 日、4 月 1 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 5 | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 5 月 15 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 5 月 13 日 |
| 6 | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 5 月 27 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 5 月 23 日 |
| 7 | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 6 月 19 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告         | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 17 日 |
| 8 | 关于嘉实全球互联网股票 2024 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告          | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024 年 6 月 27 日 |

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实全球互联网股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实全球互联网股票型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实全球互联网股票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) 报告期内嘉实全球互联网股票型证券投资基金公告的各项原稿。

### 11.2 存放地点

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

### 11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日