

# 嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <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                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 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>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 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             | 13        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 15        |
| 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       | 15        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>15</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 15        |
| 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 | 15        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>15</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 15        |
| 6.2 利润表                                 | 17        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表                        | 18        |
| 6.4 报表附注                                | 21        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>49</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 49        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 50        |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 51        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 54        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 55        |

|   |           |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....    | 55        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 ..... | 55        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 ..... | 56        |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....    | 56        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 56        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 56        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 56        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>57</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 57        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 57        |
| 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 .....      | 57        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>58</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>58</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 58        |
| 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 .....      | 58        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 59        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 59        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 59        |
| 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 .....         | 59        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 59        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 65        |
| <b>§ 11 备查文件目录 .....</b>                    | <b>66</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                           | 66        |
| 11.2 存放地点 .....                             | 66        |
| 11.3 查阅方式 .....                             | 66        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                 |
|-----------------|--------------------|-----------------|
| 基金名称            | 嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金    |                 |
| 基金简称            | 嘉实核心蓝筹混合           |                 |
| 基金主代码           | 012671             |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式             |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 7 月 23 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       |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 1,113,587,944.32 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉实核心蓝筹混合 A         | 嘉实核心蓝筹混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 012671             | 012672          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,052,453,821.65 份 | 61,134,122.67 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 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   | 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。具体投资策略包括：<br>(一) 资产配置策略 (二) 股票投资策略 (三) 债券投资策略 (四) 衍生品投资策略 (五) 资产支持证券投资策略 (六) 融资策略 (七) 风险管理策略 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+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。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      | 基金管理人      | 基金托管人               |
|---------|------------|---------------------|
| 名称      | 嘉实基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露负责人 | 姓名         | 胡勇钦                 |
|         | 联系电话       | (010) 65215588      |
|         | 电子邮箱       | service@jsfund.cn   |
|         |            | 郭明                  |
|         |            | (010) 66105799      |
|         |            | custody@icbc.com.cn |

|        |                                       |                   |
|--------|---------------------------------------|-------------------|
| 客户服务电话 | 400-600-8800                          | 95588             |
| 传真     | (010)65215588                         | (010)66105798     |
| 注册地址   | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元    | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址   | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码   | 100020                                | 100140            |
| 法定代表人  | 经雷                                    | 陈四清               |

## 2.4 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         |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                  |
|--------|------------|---------------------------------------|
| 注册登记机构 | 嘉实基金管理有限公司 | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层 |

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日) |                |
|---------------|-------------------------------------|----------------|
|               | 嘉实核心蓝筹混合 A                          | 嘉实核心蓝筹混合 C     |
| 本期已实现收益       | 20,382,651.77                       | 1,112,591.51   |
| 本期利润          | -152,679,513.44                     | -10,469,806.09 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1404                             | -0.1487        |
| 本期加权平均净值利润率   | -15.44%                             | -16.54%        |
| 本期基金份额净值增长率   | -15.26%                             | -15.59%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日)               |                |
|               | 嘉实核心蓝筹混合 A                          | 嘉实核心蓝筹混合 C     |
| 期末可供分配利       | -213,650,810.64                     | -13,157,725.49 |

|              |                  |               |
|--------------|------------------|---------------|
| 润            |                  |               |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2030          | -0.2152       |
| 期末基金资产净值     | 838,803,011.01   | 47,976,397.18 |
| 期末基金份额净值     | 0.7970           | 0.7848        |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) |               |
| 基金份额累计净值增长率  | -20.30%          | -21.52%       |

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

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

(3) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实核心蓝筹混合 A

| 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      | -1.48%   | 1.60%       | 1.55%      | 0.77%         | -3.03%  | 0.83% |
| 过去三个月      | -13.38%  | 1.18%       | -4.19%     | 0.70%         | -9.19%  | 0.48% |
| 过去六个月      | -15.26%  | 1.18%       | -0.66%     | 0.72%         | -14.60% | 0.46% |
| 过去一年       | -16.81%  | 1.50%       | -10.31%    | 0.87%         | -6.50%  | 0.63% |
| 自基金合同生效起至今 | -20.30%  | 1.54%       | -20.27%    | 0.96%         | -0.03%  | 0.58% |

嘉实核心蓝筹混合 C

| 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 | -1.54%   | 1.60%       | 1.55%      | 0.77%         | -3.09% | 0.83% |
| 过去三个月 | -13.55%  | 1.18%       | -4.19%     | 0.70%         | -9.36% | 0.48% |

|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去六个月      | -15.59% | 1.18% | -0.66%  | 0.72% | -14.93% | 0.46% |
| 过去一年       | -17.48% | 1.50% | -10.31% | 0.87% | -7.17%  | 0.63% |
| 自基金合同生效起至今 | -21.52% | 1.54% | -20.27% | 0.96% | -1.25%  | 0.58% |

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：

$$\text{Return}(t) = 60\% * (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$$

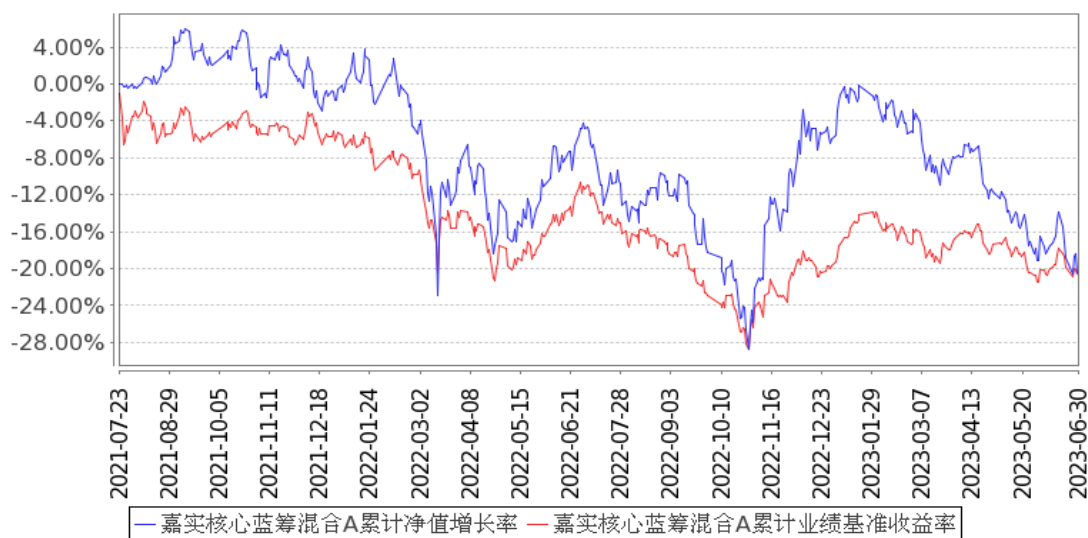
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

嘉实核心蓝筹混合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

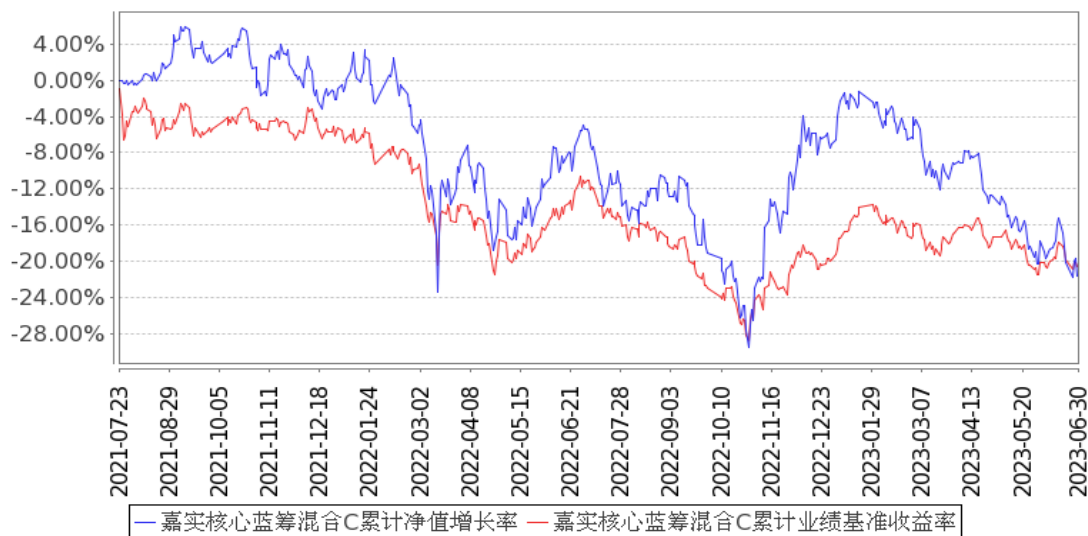
(2021年07月23日至2023年06月30日)





### 嘉实核心蓝筹混合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

(2021年07月23日至2023年06月30日)



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

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务       | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                     |
|----|----------|-----------------|------|--------|--|
|    |          | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 肖觅 | 本基金、嘉实研究 | 2021年7月23日      | -    | 13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 |

|   |  |  |  |   |
|---|--|--|--|---|
| 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、嘉实品质蓝筹一年持有期混合基金经理 |  |  |  | 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。 |
|---|--|--|--|---|

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。

#### 4.1.3 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       | 8,223,625,249.49 | 2016年12月29日 |
|    | 私募资产管理计划 | 1       | 488,492,480.31   | 2022年3月24日  |
|    | 其他组合     | -       | -                | -           |
|    | 合计       | 9       | 8,712,117,729.80 | -           |

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、《嘉实核心蓝筹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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 6 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年以中证 800 为代表的宽基指数收益率基本集中在低个位数水平，但在春节后权益市场跟随经济基本面出现了明显的调整。结构上 AI 相关产业有非常突出的表现，“中特估”相关标的也有所上涨。同期万得偏股混合型指数略跑输主要宽基指数，从结果上看，公募基金重仓的行业和个股在上半年没有获得超额回报。

基本面层面发生了什么？总体观察下来，经济处在一个弱复苏的状态：没有实现强复苏，主要体现在房地产作为总需求最重要的驱动力，实际情况非常疲软，也拖累新开工链条上各个行业的表现，总需求相关的其他大部分行业表现也比较平淡；但经济也确实是在复苏，主要体现在线下服务业明显的恢复，甚至出行链的部分子行业出现了积累需求的阶段性释放带来的明显的景气上行。节奏上，在短短半年内，复苏的强度也出现了一次明显的波动，从春节后到四月份，主要体现的是疫情期间积累的各种需求的释放，包括房地产也出现了阶段性的显著改善，但五六月份以来，随着房地产销售端迅速下滑，总需求相关的行业迅速转冷，到半年末再去看，和总量相关的行业只剩下汽车和出行相对不错。这种复苏节奏的变化对于公募基金是比较不利的：公募基金作为天然多头总体上通常会对各种正面变化比较敏感，会更倾向于去乐观解读这些变化，历史上中国经济的韧性也让这种更乐观的反应成为了占优策略，春节前后公募基金对复苏相关行业有比较明显的风险暴露，但较强程度的复苏持续时间太短，预期的迅速落空就直接体现为公募基金组合的压力。当然在新兴产业里，AI 产业链是非常火爆的，不过在整个宏观经济的总盘子中体量太小，不足以影响总需求的波动。

权益投资理论上是一个长久期的决策，半年维度的总需求波动本身不是太大的问题，现在遇到的问题，焦点实际上又回到了信心这两个字上。最近我们广泛调研下来，各行各业产业链上下游的市场主体，比较普遍的缺乏对一个抽象概念上宏观经济的信心。原因错综复杂：消费者层面

上，收入预期不行；企业主层面上，行业政策预期不稳定、国际关系不确定；地产行业的相关主体，又会关注到长期人口趋势的问题等。当然在各行各业，对自己行业景气的预期差异还是比较大的，这里的信心不足更多是一个抽象的总量概念，体现的是对中长期的担忧。从行为上看，有一些宏观数据可以直接体现市场主体的信心，比如最典型的，房地产投资和新开工已经出现了明显下滑，再比如前几年比较大的亮点，制造业的固定资产投资，现在也非常平淡。市场层面也有一个很容易观察的，从外部视角看中国经济信心的一个代表性指标，就是港股市场的表现，不管是因为基本面变化、汇率波动还是因为国际关系的变化带来的港股市场的波动，实际上都可以看作是海外投资者视角下对中国经济信心的变化，从这个角度去观察，显然在现在这个时间点，海外投资者的信心也不是太强。

回到市场层面，复苏强度明显减弱后，市场预期也迅速进行了调整，从我们观察来看，目前预期和基本面实际情况的匹配程度是明显好于春节期间的。从大部分上市公司盈利预测调整以及当前估值情况观察，总需求相关的这些行业基本算是定在了合理的价格上，至少反映了基本面当前的平淡，甚至也包含了一定程度的走弱预期，至少已经没有了不切实际的强预期。这是一个相对比较有利的状态：隐含回报率已经有明显提升，而且这种回报的实现也不再强烈依赖于基本面需要有非线性的上行。在这个状态下，可以有一个模糊的结论：继续全面悲观没有意义，但大的机会因为总需求的压制，因为没有信心，可能也会相对有限。落实到投资层面，问题就被降维到寻找结构性积极因素上：经济的内生循环，居民收入（对应需求来源）、资产价格（对应资产负债表）、生产活动（对应供给能力），是否能够从一个方向上被推动起来？内生循环中有没有一些结构性亮点？如果后续有经济政策或者产业政策，直接影响的行业会在哪里？有没有可能中长期预期或者说信心变得正面？

我们基于上面的思考去调整组合，寻找内生循环中我们观察到的结构性亮点进行配置。其中航空板块我们选择做了一些波段操作，在市场预期过高时有所减仓，但近期观察到需求确实比较好，甚至有希望去启动经济内生循环后我们重新增加了配置。我们关注保险板块的机会并增加了配置，结构性亮点主要来自于保险负债端的确定性改善，确实看到了当前的大类资产表现下，保险作为资产配置选择的性价比提升。我们增加了互联网板块的配置，看到了基本面的实质性改善，结合已经明显降低的预期，当前位置性价比已经非常高。

在总体组合构建的层面，我们仍然坚持低波动权益的框架，希望能尽可能降低组合波动率，提升基金持有人的持有体验。从报告期结果来看，在港股和部分行业的风险暴露让这个目标没有完全实现，我们会基于对未来基本面的判断去做出相应的调整，把握结构上有亮点的行业中出现的机会。同时评估现在的风险收益比，我们仍然坚持认为港股有非常丰富的机会，非常、非常、

非常看好港股市场的未来表现。感谢基金持有人对我们一直以来的信任！

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实核心蓝筹混合 A 基金份额净值为 0.7970 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.26%；截至本报告期末嘉实核心蓝筹混合 C 基金份额净值为 0.7848 元，本报告期基金份额净值增长率为-15.59%；业绩比较基准收益率为-0.66%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在上文我们提到，我们得到的一个结论是继续全面悲观没有意义，但大的市场机会因为总需求的压制，因为缺少信心，可能也会相对有限。要看到大的市场机会，可能需要看到经济循环起来，或者有力度的、能够支撑经济循环起来的政策出台。落实到投资层面，问题就被降维到寻找积极因素上。积极的变化在哪里？比较容易看到的一个积极变化显然是火遍全球的 AI 产业，ChatGPT 的横空出世，显著的效率提升前景，让世界看到了新一轮产业革命的可能性，相关行业也一定会有丰富的机会，但在当前的时间点来看，要成为推动经济内生循环转起来的发动机，体量上还有所欠缺。这里我们分享一下我们观察到的，有可能去从居民收入这个点上推动循环转起来的一个点：出行链的变化。今年以来以航空为代表的出行链，复苏程度是超预期的，一是体现在国内旅客量已经超过了 2019 年同期的水平，第二更重要的是票价水平也明显高于 2019 年，这就意味着实际上出行的意愿实际上是比 2019 年强很多的，第三我们还看到在各个假期，有明显的脉冲式的需求释放，这则意味着因私出行的需求也很强劲。为什么在经济弱复苏的情景下，出行链表现会这么好？我们推测背后原因可能来自于以下几点：商务需求方面，订单偏弱可能进一步催生了销售端加强客户沟通的需求，公务需求方面则因为强调调研带来了一些新增需求，因私需求方面，近期有疫情期间积累的国内游需求的释放，远期则还有供给释放后境外游恢复的支撑。看原因，似乎可以得到比较模糊的结论是出行的需求是有一定持续性的，相关的线下服务业又是一个吸纳了相当规模就业的板块，那么如果出行需求能够持续，就有可能在持续一段时间后，居民收入的改善率先在线下服务相关部门出现，有希望去启动居民收入——资产价格——生产活动的经济内生循环。

还有可能出现的积极变化可能来自于政策端，市场尤其关心房地产政策，但在房住不炒和因城施策的大框架下，现有政策工具并不一定能够重新建立居民对房地产作为一项重要资产配置的信心。先看政策目标，假定政策目标是地产销售见顶回落的速度相对平缓，地方财政相关的土地出让能够勉强维持，地产产业链也维持一定规模和就业，同时房价不出现暴跌，这样中国的资产负债表是安全的。但从我们的理解来看，现有政策工具更多是实现这个目标的必要条件而不是充分条件：必须出，出了以后对潜在相关风险会有一些边际上的缓解，但不足以完全达到预想的理

想目标。那么接下来的问题就是，什么样的政策是有可能真正有意义的？回到房地产的需求属性：居住属性方面，行业需要向居民提供明显更有吸引力的产品，尤其是在三四线城市，可能需要地方政府改变思维方式，去主动降低土地出让的容积率，让开发商提供和此前完全不一样的产品，真正满足“住得好”的需求，这一点是住建体系和房地产行业完全有能力自己去解决的。投资属性方面，行业需要向居民提供更乐观的中长期预期，而要真正改变当前的中长期预期，需要看到人口趋势的改善，这个问题上，大规模大体量的财政性质的生育补贴，可能是扭转人口趋势的唯一可行手段。当然，这里所讨论的有效政策，更多是一个“应然”的思考，并不等于这些政策就会在这些方向上出来，但如果真的有这些政策出来，有可能会成为实现目标的充分条件，相关行业的中长期展望就会完全逆转。

当然，如果能看到一些能显著改变市场主体预期的变化，不管是政策端的变化还是需求端的变化，这个时间点可能就是孕育新一轮大机会的起点。7 月份我们观察到了政策端明显的边际变化，尤其是在房地产和民营经济两个最重要的关于经济内生循环能否启动的方向上都给出了相当有力度的政策态度，是有可能给市场主体带来明显更强的信心的。

另外分享一下我们对快递板块的观察。虽然市场在担心价格战，担心竞争格局无法出清，但从我们的分析框架出发，我们观察了行业内各个玩家所处的状态，了解了为什么会有这一轮的价格竞争，测算了主要玩家在价格竞争状态下的财务状况，推演未来可能会有变化的变化，我们认为有相当大的可能性，近期表现上变得更激烈的竞争，会在最近一两左右，比较快的带来竞争格局的显著变化。如果这种变化出现，对快递行业而言就是非常正面的结构性变化，变化幅度也会远超大多数总需求相关的行业有可能出现的改善幅度，赔率已经非常高。同时因为担心价格战，相关标的的股价出现了明显的回调，到现在这个位置继续下行会看到非常强的业绩支撑，风险收益比已经非常有吸引力，我们也因此在报告期集中增加了快递板块的配置。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利

益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 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：嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 附注号     | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                        |                          |
| 银行存款       | 6.4.7.1 | 49,627,821.64          | 48,837,816.07            |
| 结算备付金      |         | 1,188,549.69           | 789,654.84               |
| 存出保证金      |         | 121,411.66             | 44,813.55                |
| 交易性金融资产    | 6.4.7.2 | 841,463,608.01         | 1,085,869,782.91         |

|               |            |                           |                             |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 其中：股票投资       |            | 832,795,126.24            | 1,050,842,856.69            |
| 基金投资          |            | -                         | -                           |
| 债券投资          |            | 8,668,481.77              | 35,026,926.22               |
| 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         |            | 3,110,048.95              | -                           |
| 应收股利          |            | 1,703,578.56              | 46,992.00                   |
| 应收申购款         |            | 69,262.89                 | 544,165.68                  |
| 递延所得税资产       |            | -                         | -                           |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                         | -                           |
| 资产总计          |            | 897,284,281.40            | 1,136,133,225.05            |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2022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         |            | 1,301,510.93              | 8,965,919.73                |
| 应付赎回款         |            | 7,330,626.26              | 2,135,055.07                |
| 应付管理人报酬       |            | 1,145,202.33              | 1,416,272.17                |
| 应付托管费         |            | 190,867.03                | 236,045.38                  |
| 应付销售服务费       |            | 33,363.87                 | 38,429.70                   |
| 应付投资顾问费       |            | -                         | -                           |
| 应交税费          |            | 16.46                     | -                           |
| 应付利润          |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债       |            | -                         | -                           |
| 其他负债          | 6.4.7.9    | 503,286.33                | 583,727.84                  |
| 负债合计          |            | 10,504,873.21             | 13,375,449.89               |
| <b>净资产：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金          | 6.4.7.10   | 1,113,587,944.32          | 1,194,501,606.44            |
| 其他综合收益        | 6.4.7.11   | -                         | -                           |
| 未分配利润         | 6.4.7.12   | -226,808,536.13           | -71,743,831.28              |
| 净资产合计         |            | 886,779,408.19            | 1,122,757,775.16            |
| 负债和净资产总计      |            | 897,284,281.40            | 1,136,133,225.05            |



注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，嘉实核心蓝筹混合 A 基金份额净值 0.7970 元，基金份额总额 1,052,453,821.65 份，嘉实核心蓝筹混合 C 基金份额净值 0.7848 元，基金份额总额 61,134,122.67 份，基金份额总额合计为 1,113,587,944.32 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至 2022<br>年 6 月 30 日 |
|------------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>         |          | -153,609,204.72                          | -37,171,760.62                                |
| 1. 利息收入                |          | 94,719.05                                | 118,086.39                                    |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.13 | 94,719.05                                | 118,086.39                                    |
| 债券利息收入                 |          | -  | -   |
| 资产支持证券利息收入             |          | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入             |          | -  | -   |
| 证券出借利息收入               |          | -  | -   |
| 其他利息收入                 |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |          | 30,878,122.91                            | 33,937,685.66                                 |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.14 | 24,752,618.14                            | 18,086,834.13                                 |
| 基金投资收益                 |          | -  | -   |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.15 | 192,541.86                               | 2,485,744.84                                  |
| 资产支持证券投资               | 6.4.7.16 | -  | -   |
| 收益                     |          |  |   |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.17 | -  | -   |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.18 | -  | 22,656.31                                     |
| 股利收益                   | 6.4.7.19 | 5,932,962.91                             | 13,342,450.38                                 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益  |          | -  | -   |
| 其他投资收益                 |          | -  | -   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | -184,644,562.81                          | -71,521,397.12                                |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -  | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.21 | 62,516.13                                | 293,864.45                                    |
| <b>减：二、营业总支出</b>       |          | 9,540,114.81                             | 10,300,434.25                                 |

|                            |          |                        |                       |
|----------------------------|----------|------------------------|-----------------------|
| 1. 管理人报酬                   |          | 7,855,010.49           | 8,554,564.48          |
| 2. 托管费                     |          | 1,309,168.37           | 1,425,760.75          |
| 3. 销售服务费                   |          | 251,509.28             | 203,275.91            |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                      | -                     |
| 5. 利息支出                    |          | -                      | -                     |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                      | -                     |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.22 | -                      | -                     |
| 7. 税金及附加                   |          | 4.76                   | 83.65                 |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23 | 124,421.91             | 116,749.46            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>-163,149,319.53</b> | <b>-47,472,194.87</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                      | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>-163,149,319.53</b> | <b>-47,472,194.87</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | <b>-</b>               | <b>-</b>              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>-163,149,319.53</b> | <b>-47,472,194.87</b> |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<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(基金净值) | 1,194,501,606.44                      | -      | -71,743,831.28  | 1,122,757,775.16 |
| 加：会计政策变更        | -                                     | -      | -               | -                |
| 前期差错更正          | -                                     | -      | -               | -                |
| 其他              | -                                     | -      | -               | -                |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 1,194,501,606.44                      | -      | -71,743,831.28  | 1,122,757,775.16 |
| 三、本期增减变         | -80,913,662.12                        | -      | -155,064,704.85 | -235,978,366.97  |

|  |                  |   |                 |                 |
|--|------------------|---|-----------------|-----------------|
| 动额(减少以“-”号填列)                            |                  |   |                 |                 |
| (一)、综合收益总额                               | -                | - | -163,149,319.53 | -163,149,319.53 |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | -80,913,662.12   | - | 8,084,614.68    | -72,829,047.44  |
| 其中:1.基金申购款                               | 36,999,959.39    | - | -1,838,343.63   | 35,161,615.76   |
| 2.基金赎回款                                  | -117,913,621.51  | - | 9,922,958.31    | -107,990,663.20 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -                | - | -               | -               |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                         | -                | - | -               | -               |
| 四、本期末净资产(基金净值)                           | 1,113,587,944.32 | - | -226,808,536.13 | 886,779,408.19  |
| 项目                                       | 上年度可比期间          |   |                 |                 |

|                                     | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |        |                |                  |
|-------------------------------------|---------------------------------|--------|----------------|------------------|
|                                     | 实收基金                            | 其他综合收益 | 未分配利润          | 净资产合计            |
| 一、上期期末净资产(基金净值)                     | 1,288,857,993.73                | -      | -8,391,087.98  | 1,280,466,905.75 |
| 加:会计政策变更                            | -                               | -      | -              | -                |
| 前期差错更正                              | -                               | -      | -              | -                |
| 其他                                  | -                               | -      | -              | -                |
| 二、本年期初净资产(基金净值)                     | 1,288,857,993.73                | -      | -8,391,087.98  | 1,280,466,905.75 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                | -60,703,814.05                  | -      | -43,431,499.42 | -104,135,313.47  |
| (一)、综合收益总额                          | -                               | -      | -47,472,194.87 | -47,472,194.87   |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -60,703,814.05                  | -      | 4,040,695.45   | -56,663,118.60   |
| 其中:1.基金申购款                          | 119,623,951.21                  | -      | -3,981,259.83  | 115,642,691.38   |
| 2.基金赎回款                             | -180,327,765.26                 | -      | 8,021,955.28   | -172,305,809.98  |
| (三)、                                | -                               | -      | -              | -                |

|                                      |                  |   |                |                  |
|--------------------------------------|------------------|---|----------------|------------------|
| 本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) |                  |   |                |                  |
| (四)、其他综合收益结转留存收益                     | -                | - | -              | -                |
| 四、本期期末净资产(基金净值)                      | 1,228,154,179.68 | - | -51,822,587.40 | 1,176,331,592.28 |

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：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>经雷</u> | <u>梁凯</u> | <u>李袁</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2021]1834 号《关于准予嘉实核心蓝筹混合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于 2021 年 7 月 8 日至 2021 年 7 月 21 日向社会公开募集，基金合同于 2021 年 7 月 23 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 2,014,137,047.03 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企

业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

##### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的 3‰调整为 1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征

收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号文《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[2016]127号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2023年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款         | 49,627,821.64     |
| 等于：本金        | 49,624,968.42     |
| 加：应计利息       | 2,853.22          |
| 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           | 49,627,821.64     |



## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023年6月30日 |              |                |                 |            |
|---------------|-------------------|--------------|----------------|-----------------|------------|
|               | 成本                | 应计利息         | 公允价值           | 公允价值变动          |            |
| 股票            | 1,086,717,323.92  | -            | 832,795,126.24 | -253,922,197.68 |            |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                 | -            | -              | -               |            |
| 债券            | 交易所市场             | 7,943,732.71 | 19,507.47      | 8,668,481.77    | 705,241.59 |
|               | 银行间市场             | -            | -              | -               | -          |
|               | 合计                | 7,943,732.71 | 19,507.47      | 8,668,481.77    | 705,241.59 |
| 资产支持证券        | -                 | -            | -              | -               |            |
| 基金            | -                 | -            | -              | -               |            |
| 其他            | -                 | -            | -              | -               |            |
| 合计            | 1,094,661,056.63  | 19,507.47    | 841,463,608.01 | -253,216,956.09 |            |

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 0.57              |
| 应付证券出借违约金   | -                 |
| 应付交易费用      | 309,147.41        |
| 其中：交易所市场    | 309,147.41        |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 194,138.35        |
| 合计          | 503,286.33        |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实核心蓝筹混合 A

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                  |
|---------------|----------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额             |
| 上年度末          | 1,127,577,081.34           | 1,127,577,081.34 |
| 本期申购          | 13,963,444.17              | 13,963,444.17    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -89,086,703.86             | -89,086,703.86   |
| 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           | 1,052,453,821.65 | 1,052,453,821.65 |

## 嘉实核心蓝筹混合 C

| 项目            | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额           |
| 上年度末          | 66,924,525.10                         | 66,924,525.10  |
| 本期申购          | 23,036,515.22                         | 23,036,515.22  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -28,826,917.65                        | -28,826,917.65 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -              |
| 本期申购          | -                                     | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -              |
| 本期末           | 61,134,122.67                         | 61,134,122.67  |

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

## 嘉实核心蓝筹混合 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|---------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | 20,967,021.54 | -88,012,793.45  | -67,045,771.91  |
| 本期利润           | 20,382,651.77 | -173,062,165.21 | -152,679,513.44 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,960,540.48 | 8,035,015.19    | 6,074,474.71    |
| 其中：基金申购款       | 313,308.82    | -1,144,828.95   | -831,520.13     |
| 基金赎回款          | -2,273,849.30 | 9,179,844.14    | 6,905,994.84    |
| 本期已分配利润        | -             | -               | -               |
| 本期末            | 39,389,132.83 | -253,039,943.47 | -213,650,810.64 |

## 嘉实核心蓝筹混合 C

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|--------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | 531,746.67   | -5,229,806.04  | -4,698,059.37  |
| 本期利润           | 1,112,591.51 | -11,582,397.60 | -10,469,806.09 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -241,264.03  | 2,251,404.00   | 2,010,139.97   |
| 其中：基金申购款       | 166,318.42   | -1,173,141.92  | -1,006,823.50  |
| 基金赎回款          | -407,582.45  | 3,424,545.92   | 3,016,963.47   |
| 本期已分配利润        | -            | -              | -              |
| 本期末            | 1,403,074.15 | -14,560,799.64 | -13,157,725.49 |

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                   |
|-----------|----------------------|
|           | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 活期存款利息收入  | 78,510.77            |
| 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 | 15,409.08            |
| 其他        | 799.20               |
| 合计        | 94,719.05            |

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 24,752,618.14        |
| 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               | 24,752,618.14        |

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 556,062,603.43       |
| 减：卖出股票成本总额 | 529,709,058.06       |
| 减：交易费用     | 1,600,927.23         |
| 买卖股票差价收入   | 24,752,618.14        |

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期                   |
|------------------------------|----------------------|
|                              | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 债券投资收益——利息收入                 | 245,437.15           |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -52,895.29           |
| 债券投资收益——赎回差价收入               | -                    |

|                |            |
|----------------|------------|
| 债券投资收益——申购差价收入 | -          |
| 合计             | 192,541.86 |

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 44,338,889.27              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 43,677,340.29              |
| 减：应计利息总额               | 714,444.27                 |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | -52,895.29                 |

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

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

无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

## 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 5,932,962.91                    |
| 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            | 5,932,962.91                    |

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产             | -184,644,562.81                 |
| 股票投资                   | -185,399,446.40                 |
| 债券投资                   | 754,883.59                      |
| 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                     | -184,644,562.81                 |

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
| 基金赎回费收入 | 49,830.08                       |
| 基金转出费收入 | 12,686.05                       |
| 合计      | 62,516.13                       |

**6.4.7.22 信用减值损失**

无。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 44,630.98                  |
| 信息披露费    | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行划款手续费  | 2,934.42                   |
| 深港通证券组合费 | 17,349.14                  |
| 合计       | 124,421.91                 |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

无。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

无。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                  | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------|
| 嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）     | 基金管理人   |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人   |

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 债券交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

无。

## 6.4.10.1.4 权证交易

无。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,855,010.49                    | 8,554,564.48                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,725,588.10                    | 3,828,567.91                    |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              | 上年度可比期间                         |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,309,168.37                    | 1,425,760.75                    |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |            |            |
|----------------|---------------------------------|------------|------------|
|                | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |            |            |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |            |
|                | 嘉实核心蓝筹混合 A                      | 嘉实核心蓝筹混合 C | 合计         |
| 嘉实基金管理有限公司     | -                               | 43,487.56  | 43,487.56  |
| 中国工商银行         | -                               | 76,760.96  | 76,760.96  |
| 嘉实财富           | -                               | -          | -          |
| 合计             | -                               | 120,248.52 | 120,248.52 |
| 获得销售服务费的各关联方   | 上年度可比期间                         |            |            |



| 名称         | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |            |           |
|------------|---------------------------------|------------|-----------|
|            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|            | 嘉实核心蓝筹混合 A                      | 嘉实核心蓝筹混合 C | 合计        |
| 嘉实基金管理有限公司 | -                               | 14,734.65  | 14,734.65 |
| 中国工商银行     | -                               | 84,250.14  | 84,250.14 |
| 嘉实财富       | -                               | -          | -         |
| 合计         | -                               | 98,984.79  | 98,984.79 |

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 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                              |           | 上年度可比期间                         |            |
|-----------------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
|                 | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |           | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |            |
|                 | 期末余额                            | 当期利息收入    | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 中国工商银行股份有限公司_活期 | 49,627,821.64                   | 78,510.77 | 32,583,008.89                   | 104,969.26 |

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本期(2023年1月1日至2023年6月30日),本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末(2023年6月30日)本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票 |      |            |     |        |       |        |          |           |           |    |
|-----------------------|------|------------|-----|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码                  | 证券名称 | 成功认购日      | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
| 001282                | 三联锻造 | 2023年5月15日 | 6个月 | 新股锁定   | 27.93 | 33.03  | 105      | 2,932.65  | 3,468.15  | -  |
| 001286                | 陕西能源 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股锁定   | 9.60  | 9.41   | 3,767    | 36,163.20 | 35,447.47 | -  |
| 001287                | 中电港  | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股锁定   | 11.88 | 21.02  | 1,386    | 16,465.68 | 29,133.72 | -  |
| 001324                | 长青科技 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股锁定   | 18.88 | 19.60  | 114      | 2,152.32  | 2,234.40  | -  |
| 001328                | 登康口腔 | 2023年3月29日 | 6个月 | 新股锁定   | 20.68 | 25.49  | 145      | 2,998.60  | 3,696.05  | -  |
| 001360                | 南矿集团 | 2023年3月31日 | 6个月 | 新股锁定   | 15.38 | 14.87  | 177      | 2,722.26  | 2,631.99  | -  |
| 001367                | 海森药业 | 2023年3月30日 | 6个月 | 新股锁定   | 44.48 | 39.48  | 55       | 2,446.40  | 2,171.40  | -  |
| 001380                | 华纬科技 | 2023年5月9日  | 6个月 | 新股锁定   | 28.84 | 30.78  | 170      | 4,902.80  | 5,232.60  | -  |
| 300804                | 广康生化 | 2023年6月15日 | 6个月 | 新股锁定   | 42.45 | 32.97  | 226      | 9,593.70  | 7,451.22  | -  |
| 301141                | 中科   | 2023年      | 6个月 | 新股锁    | 41.20 | 42.69  | 262      | 10,794.40 | 11,184.78 | -  |

|        |      |             |         |       |       |       |       |           |           |  |   |
|--------|------|-------------|---------|-------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
|        | 磁业   | 3月27日       |         | 定     |       |       |       |           |           |  |   |
| 301157 | 华塑科技 | 2023年3月1日   | 6个月     | 新股锁定  | 56.50 | 52.93 | 150   | 8,475.00  | 7,939.50  |  | - |
| 301170 | 锡南科技 | 2023年6月16日  | 6个月     | 新股锁定  | 34.00 | 34.93 | 250   | 8,500.00  | 8,732.50  |  | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年6月28日  | 1个月内(含) | 新发未上市 | 25.82 | 25.82 | 2,754 | 71,108.28 | 71,108.28 |  | - |
| 301202 | 朗威股份 | 2023年6月28日  | 6个月     | 新股锁定  | 25.82 | 25.82 | 306   | 7,900.92  | 7,900.92  |  | - |
| 301203 | 国泰环保 | 2023年3月28日  | 6个月     | 新股锁定  | 46.13 | 34.40 | 225   | 10,379.25 | 7,740.00  |  | - |
| 301225 | 恒勃股份 | 2023年6月8日   | 6个月     | 新股锁定  | 35.66 | 33.26 | 333   | 11,874.78 | 11,075.58 |  | - |
| 301246 | 宏源药业 | 2023年3月10日  | 6个月     | 新股锁定  | 50.00 | 30.71 | 931   | 46,550.00 | 28,591.01 |  | - |
| 301260 | 格力博  | 2023年1月20日  | 6个月     | 新股锁定  | 30.85 | 23.63 | 2,185 | 67,407.25 | 51,631.55 |  | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日  | 1个月内(含) | 新发未上市 | 36.90 | 36.90 | 1,775 | 65,497.50 | 65,497.50 |  | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023年6月29日  | 6个月     | 新股锁定  | 36.90 | 36.90 | 198   | 7,306.20  | 7,306.20  |  | - |
| 301262 | 海看股份 | 2023年6月13日  | 6个月     | 新股锁定  | 30.22 | 25.50 | 692   | 20,912.24 | 17,646.00 |  | - |
| 301293 | 三博脑科 | 2023年4月25日  | 6个月     | 新股锁定  | 29.60 | 71.42 | 333   | 9,856.80  | 23,782.86 |  | - |
| 301295 | 美硕科技 | 2023年6月19日  | 6个月     | 新股锁定  | 37.40 | 36.07 | 215   | 8,041.00  | 7,755.05  |  | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022年12月20日 | 6个月     | 新股锁定  | 5.00  | 8.96  | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 |  | - |

|        |      |                |     |      |        |       |       |           |           |   |
|--------|------|----------------|-----|------|--------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 301303 | 真兰仪表 | 2023年<br>2月13日 | 6个月 | 新股锁定 | 26.80  | 22.32 | 1,058 | 28,354.40 | 23,614.56 | - |
| 301310 | 鑫宏业  | 2023年<br>5月26日 | 6个月 | 新股锁定 | 67.28  | 65.43 | 409   | 27,517.52 | 26,760.87 | - |
| 301315 | 威士顿  | 2023年<br>6月13日 | 6个月 | 新股锁定 | 32.29  | 51.12 | 226   | 7,297.54  | 11,553.12 | - |
| 301317 | 鑫磊股份 | 2023年<br>1月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 20.67  | 26.17 | 694   | 14,344.98 | 18,161.98 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023年<br>6月1日  | 6个月 | 新股锁定 | 13.06  | 20.62 | 642   | 8,384.52  | 13,238.04 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023年<br>2月27日 | 6个月 | 新股锁定 | 131.11 | 53.24 | 391   | 34,219.71 | 20,816.84 | - |
| 301323 | 新莱福  | 2023年<br>5月29日 | 6个月 | 新股锁定 | 39.06  | 39.36 | 228   | 8,905.68  | 8,974.08  | - |
| 301332 | 德尔玛  | 2023年<br>5月9日  | 6个月 | 新股锁定 | 14.81  | 13.73 | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | - |
| 301337 | 亚华电子 | 2023年<br>5月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 32.60  | 30.37 | 232   | 7,563.20  | 7,045.84  | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023年<br>6月2日  | 6个月 | 新股锁定 | 17.55  | 16.75 | 563   | 9,880.65  | 9,430.25  | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023年<br>4月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 50.00  | 48.39 | 190   | 9,500.00  | 9,194.10  | - |
| 301358 | 湖南裕能 | 2023年<br>2月1日  | 6个月 | 新股锁定 | 23.77  | 42.89 | 1,535 | 36,486.95 | 65,836.15 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023年<br>4月17日 | 6个月 | 新股锁定 | 71.88  | 92.60 | 134   | 9,631.92  | 12,408.40 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023年<br>1月20日 | 6个月 | 新股锁定 | 33.73  | 31.85 | 277   | 9,343.21  | 8,822.45  | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023年<br>6月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 24.66  | 22.51 | 420   | 10,357.20 | 9,454.20  | - |

|        |      |                |         |       |       |       |       |            |            |  |   |
|--------|------|----------------|---------|-------|-------|-------|-------|------------|------------|--|---|
|        |      | 日              |         |       |       |       |       |            |            |  |   |
| 301382 | 蜂助手  | 2023年<br>5月9日  | 6个月     | 新股锁定  | 23.80 | 32.84 | 408   | 9,710.40   | 13,398.72  |  | - |
| 301383 | 天键股份 | 2023年<br>5月31日 | 6个月     | 新股锁定  | 46.16 | 35.72 | 493   | 22,756.88  | 17,609.96  |  | - |
| 301386 | 未来电器 | 2023年<br>3月21日 | 6个月     | 新股锁定  | 29.99 | 23.79 | 378   | 11,336.22  | 8,992.62   |  | - |
| 301395 | 仁信新材 | 2023年<br>6月21日 | 1个月内(含) | 新发未上市 | 26.68 | 26.68 | 4,676 | 124,755.68 | 124,755.68 |  | - |
| 301395 | 仁信新材 | 2023年<br>6月21日 | 6个月     | 新股锁定  | 26.68 | 26.68 | 520   | 13,873.60  | 13,873.60  |  | - |
| 301408 | 华人健康 | 2023年<br>2月22日 | 6个月     | 新股锁定  | 16.24 | 16.95 | 879   | 14,274.96  | 14,899.05  |  | - |
| 301419 | 阿莱德  | 2023年<br>2月2日  | 6个月     | 新股锁定  | 24.80 | 43.85 | 330   | 8,184.00   | 14,470.50  |  | - |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023年<br>5月10日 | 6个月     | 新股锁定  | 26.35 | 30.60 | 229   | 6,034.15   | 7,007.40   |  | - |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023年<br>3月10日 | 6个月     | 新股锁定  | 19.99 | 16.90 | 949   | 18,970.51  | 16,038.10  |  | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023年<br>3月30日 | 6个月     | 新股锁定  | 6.58  | 7.58  | 3,454 | 22,727.32  | 26,181.32  |  | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023年<br>3月31日 | 6个月     | 新股锁定  | 10.36 | 11.84 | 875   | 9,065.00   | 10,360.00  |  | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023年<br>3月31日 | 6个月     | 新股锁定  | 11.66 | 12.26 | 664   | 7,742.24   | 8,140.64   |  | - |
| 603125 | 常青科技 | 2023年<br>3月30日 | 6个月     | 新股锁定  | 25.98 | 24.53 | 160   | 4,156.80   | 3,924.80   |  | - |
| 603172 | 万丰股份 | 2023年<br>4月28日 | 6个月     | 新股锁定  | 14.58 | 16.13 | 122   | 1,778.76   | 1,967.86   |  | - |
| 688146 | 中船   | 2023年          | 6个月     | 新股锁   | 36.15 | 38.13 | 1,011 | 36,547.65  | 38,549.43  |  | - |

|        |      |            |     |      |        |        |        |            |            |  |   |
|--------|------|------------|-----|------|--------|--------|--------|------------|------------|--|---|
|        | 特气   | 4月13日      |     | 定    |        |        |        |            |            |  |   |
| 688249 | 晶合集成 | 2023年4月24日 | 6个月 | 新股锁定 | 19.86  | 18.06  | 5,677  | 112,745.22 | 102,526.62 |  | - |
| 688334 | 西高院  | 2023年6月9日  | 6个月 | 新股锁定 | 14.16  | 16.21  | 888    | 12,574.08  | 14,394.48  |  | - |
| 688352 | 颀中科技 | 2023年4月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 12.10  | 12.07  | 2,361  | 28,568.10  | 28,497.27  |  | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 23.60  | 64.67  | 831    | 19,611.60  | 53,740.77  |  | - |
| 688429 | 时创能源 | 2023年6月20日 | 6个月 | 新股锁定 | 19.20  | 25.53  | 346    | 6,643.20   | 8,833.38   |  | - |
| 688433 | 华曙高科 | 2023年4月7日  | 6个月 | 新股锁定 | 26.66  | 31.50  | 418    | 11,143.88  | 13,167.00  |  | - |
| 688458 | 美芯晟  | 2023年5月15日 | 6个月 | 新股锁定 | 75.00  | 90.76  | 221    | 16,575.00  | 20,057.96  |  | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023年4月28日 | 6个月 | 新股锁定 | 5.69   | 5.41   | 11,647 | 66,271.43  | 63,010.27  |  | - |
| 688472 | 阿特斯  | 2023年6月2日  | 6个月 | 新股锁定 | 11.10  | 17.04  | 4,132  | 45,865.20  | 70,409.28  |  | - |
| 688478 | 晶升股份 | 2023年4月13日 | 6个月 | 新股锁定 | 32.52  | 42.37  | 402    | 13,073.04  | 17,032.74  |  | - |
| 688479 | 友车科技 | 2023年5月4日  | 6个月 | 新股锁定 | 33.99  | 29.49  | 332    | 11,284.68  | 9,790.68   |  | - |
| 688484 | 南芯科技 | 2023年3月28日 | 6个月 | 新股锁定 | 39.99  | 36.71  | 1,008  | 40,309.92  | 37,003.68  |  | - |
| 688507 | 索辰科技 | 2023年4月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 245.56 | 122.11 | 222    | 36,834.00  | 27,108.42  |  | - |
| 688512 | 慧智微  | 2023年5月8日  | 6个月 | 新股锁定 | 20.92  | 19.16  | 721    | 15,083.32  | 13,814.36  |  | - |

|        |      |            |     |      |        |        |       |           |           |   |
|--------|------|------------|-----|------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 688523 | 航天环宇 | 2023年5月26日 | 6个月 | 新股锁定 | 21.86  | 23.85  | 472   | 10,317.92 | 11,257.20 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023年3月28日 | 6个月 | 新股锁定 | 35.00  | 51.23  | 161   | 5,635.00  | 8,248.03  | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023年6月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 43.67  | 53.05  | 410   | 17,904.70 | 21,750.50 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023年5月8日  | 6个月 | 新股锁定 | 21.17  | 23.50  | 956   | 20,238.52 | 22,466.00 | - |
| 688562 | 航天软件 | 2023年5月15日 | 6个月 | 新股锁定 | 12.68  | 22.31  | 726   | 9,205.68  | 16,197.06 | - |
| 688570 | 天玛智控 | 2023年5月29日 | 6个月 | 新股锁定 | 30.26  | 25.33  | 884   | 26,749.84 | 22,391.72 | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023年5月30日 | 6个月 | 新股锁定 | 135.80 | 120.41 | 240   | 32,592.00 | 28,898.40 | - |
| 688581 | 安杰思  | 2023年5月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 125.80 | 118.03 | 163   | 20,505.40 | 19,238.89 | - |
| 688582 | 芯动联科 | 2023年6月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 26.74  | 40.68  | 648   | 17,327.52 | 26,360.64 | - |
| 688593 | 新相微  | 2023年5月25日 | 6个月 | 新股锁定 | 11.18  | 14.59  | 959   | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 688620 | 安凯微  | 2023年6月15日 | 6个月 | 新股锁定 | 10.68  | 12.34  | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |
| 688623 | 双元科技 | 2023年5月31日 | 6个月 | 新股锁定 | 125.88 | 86.79  | 178   | 22,406.64 | 15,448.62 | - |
| 688629 | 华丰科技 | 2023年6月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 9.26   | 18.59  | 708   | 6,556.08  | 13,161.72 | - |
| 688631 | 莱斯信息 | 2023年6月19日 | 6个月 | 新股锁定 | 25.28  | 29.87  | 336   | 8,494.08  | 10,036.32 | - |

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票

的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

| 股票代码  | 股票名称   | 停牌日期        | 停牌原因   | 期末估值单价    | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股)      | 期末成本总额        | 期末估值总额       | 备注 |
|-------|--------|-------------|--------|-----------|------|--------|------------|---------------|--------------|----|
| 00884 | 旭辉控股集团 | 2023年03月31日 | 重大事项停牌 | 0.76 (港币) | -    | -      | 10,000,000 | 22,079,059.58 | 7,007,048.00 | -  |

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 505,548.22        | 24,308,179.73       |
| 合计     | 505,548.22        | 24,308,179.73       |

注：评级取自第三方评级机构。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | -                   |
| AAA 以下 | 4,543,986.70      | -                   |
| 未评级    | 3,618,946.85      | 10,718,746.49       |
| 合计     | 8,162,933.55      | 10,718,746.49       |

注：评级取自第三方评级机构。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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>2023 年 6 月 30 日   | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上        | 不计息            | 合计             |
|--------------------------|---------------|-------|--------------|----------------|----------------|
| 资产                       |               |       |              |                |                |
| 银行存款                     | 49,627,821.64 | -     | -            | -              | 49,627,821.64  |
| 结算备付金                    | 1,188,549.69  | -     | -            | -              | 1,188,549.69   |
| 存出保证金                    | 121,411.66    | -     | -            | -              | 121,411.66     |
| 交易性金融资产                  | 4,124,495.07  | -     | 4,543,986.70 | 832,795,126.24 | 841,463,608.01 |
| 衍生金融资产                   | -             | -     | -            | -              | -              |
| 买入返售金融资产                 | -             | -     | -            | -              | -              |
| 应收清算款                    | -             | -     | -            | 3,110,048.95   | 3,110,048.95   |
| 债权投资                     | -             | -     | -            | -              | -              |
| 应收股利                     | -             | -     | -            | 1,703,578.56   | 1,703,578.56   |
| 应收申购款                    | -             | -     | -            | 69,262.89      | 69,262.89      |
| 递延所得税资产                  | -             | -     | -            | -              | -              |
| 其他资产                     | -             | -     | -            | -              | -              |
| 资产总计                     | 55,062,278.06 | -     | 4,543,986.70 | 837,678,016.64 | 897,284,281.40 |
| 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                    | -             | -     | -            | 1,301,510.93   | 1,301,510.93   |
| 应付赎回款                    | -             | -     | -            | 7,330,626.26   | 7,330,626.26   |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -            | 1,145,202.33   | 1,145,202.33   |
| 应付托管费                    | -             | -     | -            | 190,867.03     | 190,867.03     |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -            | 33,363.87      | 33,363.87      |
| 应付投资顾问费                  | -             | -     | -            | -              | -              |
| 应交税费                     | -             | -     | -            | 16.46          | 16.46          |
| 应付利润                     | -             | -     | -            | -              | -              |
| 递延所得税负债                  | -             | -     | -            | -              | -              |
| 其他负债                     | -             | -     | -            | 503,286.33     | 503,286.33     |
| 负债总计                     | -             | -     | -            | 10,504,873.21  | 10,504,873.21  |
| 利率敏感度缺口                  | 55,062,278.06 | -     | 4,543,986.70 | 827,173,143.43 | 886,779,408.19 |
| 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |               |       |              |                |                |
| 资产                       |               |       |              |                |                |
| 银行存款                     | 48,837,816.07 | -     | -            | -              | 48,837,816.07  |
| 结算备付金                    | 789,654.84    | -     | -            | -              | 789,654.84     |

|           |               |   |   |                   |                  |
|-----------|---------------|---|---|-------------------|------------------|
| 存出保证金     | 44,813.55     | - | - | -                 | 44,813.55        |
| 交易性金融资产   | 35,026,926.22 | - | - | -1,050,842,856.69 | 1,085,869,782.91 |
| 衍生金融资产    | -             | - | - | -                 | -                |
| 买入返售金融资产  | -             | - | - | -                 | -                |
| 应收清算款     | -             | - | - | -                 | -                |
| 债权投资      | -             | - | - | -                 | -                |
| 应收股利      | -             | - | - | 46,992.00         | 46,992.00        |
| 应收申购款     | -             | - | - | 544,165.68        | 544,165.68       |
| 递延所得税资产   | -             | - | - | -                 | -                |
| 其他资产      | -             | - | - | -                 | -                |
| 资产总计      | 84,699,210.68 | - | - | -1,051,434,014.37 | 1,136,133,225.05 |
| 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     | -             | - | - | 8,965,919.73      | 8,965,919.73     |
| 应付赎回款     | -             | - | - | 2,135,055.07      | 2,135,055.07     |
| 应付管理人报酬   | -             | - | - | 1,416,272.17      | 1,416,272.17     |
| 应付托管费     | -             | - | - | 236,045.38        | 236,045.38       |
| 应付销售服务费   | -             | - | - | 38,429.70         | 38,429.70        |
| 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      | -             | - | - | 583,727.84        | 583,727.84       |
| 负债总计      | -             | - | - | 13,375,449.89     | 13,375,449.89    |
| 利率敏感度缺口   | 84,699,210.68 | - | - | -1,038,058,564.48 | 1,122,757,775.16 |

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上升25个基点        | -72,821.69                  | -37,125.71        |
|    | 市场利率下降25个基点        | 73,965.56                   | 37,221.23         |

|  |    |  |  |
|--|----|--|--|
|  | 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汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2023年6月30日 |                |                |                |
|----------|-------------------|----------------|----------------|----------------|
|          | 美元<br>折合人民币<br>元  | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的资产 |                   |                |                |                |
| 银行存款     | -                 | -              | -              | -              |
| 结算备付金    | -                 | -              | -              | -              |
| 存出保证金    | -                 | -              | -              | -              |
| 交易性金融资产  | -                 | 390,369,214.10 | -              | 390,369,214.10 |
| 衍生金融资产   | -                 | -              | -              | -              |
| 债权投资     | -                 | -              | -              | -              |
| 应收股利     | -                 | -              | -              | -              |
| 应收申购款    | -                 | -              | -              | -              |
| 应收清算款    | -                 | -              | -              | -              |
| 其他资产     | -                 | -              | -              | -              |
| 资产合计     | -                 | 390,369,214.10 | -              | 390,369,214.10 |
| 以外币计价的负债 |                   |                |                |                |
| 应付清算款    | -                 | -              | -              | -              |
| 衍生金融负债   | -                 | -              | -              | -              |
| 应付赎回款    | -                 | -              | -              | -              |
| 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              | -                        | -              | -              | -              |
| 负债合计              | -                        | -              | -              | -              |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净额 | -                        | 390,369,214.10 | -              | 390,369,214.10 |
| 项目                | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                |                |                |
|                   | 美元<br>折合人民币<br>元         | 港币<br>折合人民币元   | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计             |
| 以外币计价的<br>资产      |                          |                |                |                |
| 银行存款              | -                        | -              | -              | -              |
| 结算备付金             | -                        | -              | -              | -              |
| 存出保证金             | -                        | -              | -              | -              |
| 交易性金融资产           | -                        | 503,196,610.75 | -              | 503,196,610.75 |
| 衍生金融资产            | -                        | -              | -              | -              |
| 债权投资              | -                        | -              | -              | -              |
| 应收股利              | -                        | -              | -              | -              |
| 应收申购款             | -                        | -              | -              | -              |
| 应收清算款             | -                        | -              | -              | -              |
| 其他资产              | -                        | -              | -              | -              |
| 资产合计              | -                        | 503,196,610.75 | -              | 503,196,610.75 |
| 以外币计价的<br>负债      |                          |                |                |                |
| 应付清算款             | -                        | -              | -              | -              |
| 衍生金融负债            | -                        | -              | -              | -              |
| 应付赎回款             | -                        | -              | -              | -              |
| 应付管理人报<br>酬       | -                        | -              | -              | -              |

|               |   |                |   |                |
|---------------|---|----------------|---|----------------|
| 应付托管费         | - | -              | - | -              |
| 应付销售服务费       | - | -              | - | -              |
| 应付投资顾问费       | - | -              | - | -              |
| 其他负债          | - | -              | - | -              |
| 负债合计          | - | -              | - | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 503,196,610.75 | - | 503,196,610.75 |

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 相关风险变量的变动        | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                  | 本期末（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 所有外币相对人民币升值 5%   | 19,518,460.71               | 25,159,830.54     |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -19,518,460.71              | -25,159,830.54    |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

##### 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>2023年6月30日 |              | 上年度末<br>2022年12月31日 |              |
|----|-------------------|--------------|---------------------|--------------|
|    | 公允价值              | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值比例（%） |
|    |                   |              |                     |              |

|               |                |       |                  |       |
|---------------|----------------|-------|------------------|-------|
| 交易性金融资产—股票投资  | 832,795,126.24 | 93.91 | 1,050,842,856.69 | 93.59 |
| 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            | 832,795,126.24 | 93.91 | 1,050,842,856.69 | 93.59 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                   |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                    | 本期末（2023年6月30日）             | 上年度末（2022年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升5%         | 59,205,946.01               | 86,381,677.47     |
|    | 业绩比较基准下降5%         | -59,205,946.01              | -86,381,677.47    |

#### 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>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 828,610,449.33    | 1,007,007,810.30    |



|      |                |                  |
|------|----------------|------------------|
| 第二层次 | 11,421,985.25  | 35,026,926.22    |
| 第三层次 | 1,431,173.43   | 43,835,046.39    |
| 合计   | 841,463,608.01 | 1,085,869,782.91 |

#### 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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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              | 832,795,126.24 | 92.81         |
|    | 其中：股票             | 832,795,126.24 | 92.81         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 8,668,481.77   | 0.97          |
|    | 其中：债券             | 8,668,481.77   | 0.97          |
|    | 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      | 50,816,371.33  | 5.66          |
| 8  | 其他各项资产            | 5,004,302.06   | 0.56          |

|   |    |                |        |
|---|----|----------------|--------|
| 9 | 合计 | 897,284,281.40 | 100.00 |
|---|----|----------------|--------|

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 390,369,214.10 元，占基金资产净值的比例为 44.02%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -              | -            |
| B  | 采矿业              | 29,994,450.10  | 3.38         |
| C  | 制造业              | 66,351,738.54  | 7.48         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 46,341,674.71  | 5.23         |
| E  | 建筑业              | 8,140.64       | 0.00         |
| F  | 批发和零售业           | 4,680,415.29   | 0.53         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 229,619,824.96 | 25.89        |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 119,783.56     | 0.01         |
| J  | 金融业              | 17,528,280.00  | 1.98         |
| K  | 房地产业             | 42,614,693.00  | 4.81         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 5,120,994.00   | 0.58         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 14,394.48      | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 7,740.00       | 0.00         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 23,782.86      | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 442,425,912.14 | 49.89        |

### 7.2.2 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   | 161,058,317.64 | 18.16        |
| 非必需消费品 | 48,380,398.02  | 5.46         |
| 必需消费品  | -              | -            |
| 能源     | -              | -            |
| 金融     | -              | -            |
| 医疗保健   | 67,736,289.39  | 7.64         |
| 工业     | 37,924,135.25  | 4.28         |
| 信息技术   | -              | -            |
| 原材料    | -              | -            |

|      |                |       |
|------|----------------|-------|
| 房地产  | 69,744,979.57  | 7.86  |
| 公用事业 | 5,525,094.23   | 0.62  |
| 合计   | 390,369,214.10 | 44.02 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码    | 股票名称     | 数量（股）      | 公允价值（元）       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|----------|------------|---------------|--------------|
| 1  | 700 HK  | 腾讯控股     | 289,400    | 88,477,847.58 | 9.98         |
| 2  | 600233  | 圆通速递     | 5,492,551  | 79,971,542.56 | 9.02         |
| 3  | 002352  | 顺丰控股     | 1,187,800  | 53,557,902.00 | 6.04         |
| 4  | 600803  | 新奥股份     | 2,439,738  | 46,306,227.24 | 5.22         |
| 5  | 002120  | 韵达股份     | 4,805,183  | 45,937,549.48 | 5.18         |
| 6  | 1030 HK | 新城发展     | 31,080,000 | 43,842,361.75 | 4.94         |
| 7  | 601155  | 新城控股     | 2,957,300  | 42,614,693.00 | 4.81         |
| 8  | 1024 HK | 快手-W     | 752,700    | 37,162,326.23 | 4.19         |
| 9  | 1801 HK | 信达生物     | 1,310,500  | 35,764,341.78 | 4.03         |
| 10 | 9626 HK | 哔哩哔哩-W   | 329,180    | 35,418,143.83 | 3.99         |
| 11 | 603369  | 今世缘      | 557,940    | 29,459,232.00 | 3.32         |
| 12 | 1055 HK | 中国南方航空股份 | 6,908,000  | 28,151,147.25 | 3.17         |
| 13 | 667 HK  | 中国东方教育   | 8,795,500  | 24,408,918.02 | 2.75         |
| 14 | 601899  | 紫金矿业     | 2,126,630  | 24,179,783.10 | 2.73         |
| 15 | 1765 HK | 希望教育     | 50,000,000 | 23,971,480.00 | 2.70         |
| 16 | 603885  | 吉祥航空     | 1,431,901  | 22,094,232.43 | 2.49         |
| 17 | 000858  | 五粮液      | 134,800    | 22,049,236.00 | 2.49         |
| 18 | 6855 HK | 亚盛医药-B   | 1,116,600  | 21,722,088.51 | 2.45         |
| 19 | 600919  | 江苏银行     | 2,384,800  | 17,528,280.00 | 1.98         |
| 20 | 601021  | 春秋航空     | 205,554    | 11,813,188.38 | 1.33         |
| 21 | 670 HK  | 中国东方航空股份 | 4,000,000  | 9,772,988.00  | 1.10         |
| 22 | 600702  | 舍得酒业     | 78,200     | 9,692,890.00  | 1.09         |
| 23 | 688 HK  | 中国海外发展   | 600,000    | 9,448,451.04  | 1.07         |
| 24 | 002928  | 华夏航空     | 1,086,957  | 9,184,786.65  | 1.04         |
| 25 | 002468  | 申通快递     | 652,553    | 7,060,623.46  | 0.80         |
| 26 | 884 HK  | 旭辉控股集团   | 10,000,000 | 7,007,048.00  | 0.79         |
| 27 | 2688 HK | 新奥能源     | 61,400     | 5,525,094.23  | 0.62         |
| 28 | 600057  | 厦门象屿     | 588,620    | 5,120,994.00  | 0.58         |
| 29 | 600153  | 建发股份     | 421,700    | 4,600,747.00  | 0.52         |
| 30 | 603993  | 洛阳钼业     | 812,900    | 4,332,757.00  | 0.49         |
| 31 | 9926 HK | 康方生物     | 120,000    | 3,911,039.16  | 0.44         |
| 32 | 2162 HK | 康诺亚-B    | 96,500     | 3,638,916.76  | 0.41         |
| 33 | 000737  | 北方铜业     | 674,200    | 3,633,938.00  | 0.41         |
| 34 | 1908 HK | 建发国际集团   | 206,000    | 3,373,119.15  | 0.38         |

|    |         |      |         |              |      |
|----|---------|------|---------|--------------|------|
| 35 | 960 HK  | 龙湖集团 | 178,000 | 3,124,700.86 | 0.35 |
| 36 | 3900 HK | 绿城中国 | 407,500 | 2,949,298.77 | 0.33 |
| 37 | 9995 HK | 荣昌生物 | 85,500  | 2,699,903.18 | 0.30 |
| 38 | 601168  | 西部矿业 | 141,000 | 1,481,910.00 | 0.17 |
| 39 | 301395  | 仁信新材 | 5,196   | 138,629.28   | 0.02 |
| 40 | 688249  | 晶合集成 | 5,677   | 102,526.62   | 0.01 |
| 41 | 301202  | 朗威股份 | 3,060   | 79,009.20    | 0.01 |
| 42 | 301261  | 恒工精密 | 1,973   | 72,803.70    | 0.01 |
| 43 | 688472  | 阿特斯  | 4,132   | 70,409.28    | 0.01 |
| 44 | 301358  | 湖南裕能 | 1,535   | 65,836.15    | 0.01 |
| 45 | 688469  | 中芯集成 | 11,647  | 63,010.27    | 0.01 |
| 46 | 688361  | 中科飞测 | 831     | 53,740.77    | 0.01 |
| 47 | 301260  | 格力博  | 2,185   | 51,631.55    | 0.01 |
| 48 | 688146  | 中船特气 | 1,011   | 38,549.43    | 0.00 |
| 49 | 688484  | 南芯科技 | 1,008   | 37,003.68    | 0.00 |
| 50 | 001286  | 陕西能源 | 3,767   | 35,447.47    | 0.00 |
| 51 | 301301  | 川宁生物 | 3,574   | 32,023.04    | 0.00 |
| 52 | 001287  | 中电港  | 1,386   | 29,133.72    | 0.00 |
| 53 | 688576  | 西山科技 | 240     | 28,898.40    | 0.00 |
| 54 | 301246  | 宏源药业 | 931     | 28,591.01    | 0.00 |
| 55 | 688352  | 颀中科技 | 2,361   | 28,497.27    | 0.00 |
| 56 | 688507  | 索辰科技 | 222     | 27,108.42    | 0.00 |
| 57 | 301310  | 鑫宏业  | 409     | 26,760.87    | 0.00 |
| 58 | 688582  | 芯动联科 | 648     | 26,360.64    | 0.00 |
| 59 | 601061  | 中信金属 | 3,454   | 26,181.32    | 0.00 |
| 60 | 301293  | 三博脑科 | 333     | 23,782.86    | 0.00 |
| 61 | 301303  | 真兰仪表 | 1,058   | 23,614.56    | 0.00 |
| 62 | 688552  | 航天南湖 | 956     | 22,466.00    | 0.00 |
| 63 | 688570  | 天玛智控 | 884     | 22,391.72    | 0.00 |
| 64 | 688543  | 国科军工 | 410     | 21,750.50    | 0.00 |
| 65 | 301322  | 绿通科技 | 391     | 20,816.84    | 0.00 |
| 66 | 688458  | 美芯晟  | 221     | 20,057.96    | 0.00 |
| 67 | 300750  | 宁德时代 | 87      | 19,904.73    | 0.00 |
| 68 | 688581  | 安杰思  | 163     | 19,238.89    | 0.00 |
| 69 | 301317  | 鑫磊股份 | 694     | 18,161.98    | 0.00 |
| 70 | 301262  | 海看股份 | 692     | 17,646.00    | 0.00 |
| 71 | 301383  | 天键股份 | 493     | 17,609.96    | 0.00 |
| 72 | 688478  | 晶升股份 | 402     | 17,032.74    | 0.00 |
| 73 | 688562  | 航天软件 | 726     | 16,197.06    | 0.00 |
| 74 | 301439  | 泓淋电力 | 949     | 16,038.10    | 0.00 |
| 75 | 688623  | 双元科技 | 178     | 15,448.62    | 0.00 |
| 76 | 301332  | 德尔玛  | 1,122   | 15,405.06    | 0.00 |
| 77 | 301408  | 华人健康 | 879     | 14,899.05    | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 78  | 301419 | 阿莱德  | 330   | 14,470.50 | 0.00 |
| 79  | 688334 | 西高院  | 888   | 14,394.48 | 0.00 |
| 80  | 688593 | 新相微  | 959   | 13,991.81 | 0.00 |
| 81  | 688512 | 慧智微  | 721   | 13,814.36 | 0.00 |
| 82  | 301382 | 蜂助手  | 408   | 13,398.72 | 0.00 |
| 83  | 301320 | 豪江智能 | 642   | 13,238.04 | 0.00 |
| 84  | 688433 | 华曙高科 | 418   | 13,167.00 | 0.00 |
| 85  | 688629 | 华丰科技 | 708   | 13,161.72 | 0.00 |
| 86  | 688620 | 安凯微  | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 87  | 301360 | 荣旗科技 | 134   | 12,408.40 | 0.00 |
| 88  | 301315 | 威士顿  | 226   | 11,553.12 | 0.00 |
| 89  | 688523 | 航天环宇 | 472   | 11,257.20 | 0.00 |
| 90  | 301141 | 中科磁业 | 262   | 11,184.78 | 0.00 |
| 91  | 301225 | 恒勃股份 | 333   | 11,075.58 | 0.00 |
| 92  | 301290 | 东星医疗 | 330   | 10,576.50 | 0.00 |
| 93  | 688535 | 华海诚科 | 197   | 10,448.71 | 0.00 |
| 94  | 601065 | 江盐集团 | 875   | 10,360.00 | 0.00 |
| 95  | 688631 | 莱斯信息 | 336   | 10,036.32 | 0.00 |
| 96  | 688479 | 友车科技 | 332   | 9,790.68  | 0.00 |
| 97  | 301398 | 星源卓镁 | 255   | 9,562.50  | 0.00 |
| 98  | 301265 | 华新环保 | 819   | 9,516.78  | 0.00 |
| 99  | 301376 | 致欧科技 | 420   | 9,454.20  | 0.00 |
| 100 | 301355 | 南王科技 | 563   | 9,430.25  | 0.00 |
| 101 | 301357 | 北方长龙 | 190   | 9,194.10  | 0.00 |
| 102 | 301386 | 未来电器 | 378   | 8,992.62  | 0.00 |
| 103 | 301323 | 新莱福  | 228   | 8,974.08  | 0.00 |
| 104 | 688429 | 时创能源 | 346   | 8,833.38  | 0.00 |
| 105 | 301373 | 凌玮科技 | 277   | 8,822.45  | 0.00 |
| 106 | 301170 | 锡南科技 | 250   | 8,732.50  | 0.00 |
| 107 | 601133 | 柏诚股份 | 664   | 8,140.64  | 0.00 |
| 108 | 301157 | 华塑科技 | 150   | 7,939.50  | 0.00 |
| 109 | 301295 | 美硕科技 | 215   | 7,755.05  | 0.00 |
| 110 | 301203 | 国泰环保 | 225   | 7,740.00  | 0.00 |
| 111 | 300804 | 广康生化 | 226   | 7,451.22  | 0.00 |
| 112 | 301337 | 亚华电子 | 232   | 7,045.84  | 0.00 |
| 113 | 301428 | 世纪恒通 | 229   | 7,007.40  | 0.00 |
| 114 | 001380 | 华纬科技 | 170   | 5,232.60  | 0.00 |
| 115 | 603125 | 常青科技 | 160   | 3,924.80  | 0.00 |
| 116 | 001328 | 登康口腔 | 145   | 3,696.05  | 0.00 |
| 117 | 001282 | 三联锻造 | 105   | 3,468.15  | 0.00 |
| 118 | 001360 | 南矿集团 | 177   | 2,631.99  | 0.00 |
| 119 | 001324 | 长青科技 | 114   | 2,234.40  | 0.00 |
| 120 | 001367 | 海森药业 | 55    | 2,171.40  | 0.00 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 121 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |
|-----|--------|------|-----|----------|------|

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码    | 股票名称     | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------|---------------|----------------|
| 1  | 9626 HK | 哔哩哔哩-W   | 48,121,047.10 | 4.29           |
| 2  | 002120  | 韵达股份     | 40,059,213.88 | 3.57           |
| 3  | 600233  | 圆通速递     | 34,931,553.75 | 3.11           |
| 4  | 601899  | 紫金矿业     | 25,154,044.62 | 2.24           |
| 5  | 1024 HK | 快手-W     | 22,625,584.60 | 2.02           |
| 6  | 300750  | 宁德时代     | 22,451,137.08 | 2.00           |
| 7  | 603993  | 洛阳钼业     | 20,459,745.00 | 1.82           |
| 8  | 1801 HK | 信达生物     | 17,118,471.45 | 1.52           |
| 9  | 300170  | 汉得信息     | 16,903,628.37 | 1.51           |
| 10 | 1055 HK | 中国南方航空股份 | 16,648,428.45 | 1.48           |
| 11 | 600702  | 舍得酒业     | 15,209,137.00 | 1.35           |
| 12 | 603885  | 吉祥航空     | 12,076,550.42 | 1.08           |
| 13 | 002304  | 洋河股份     | 11,417,137.00 | 1.02           |
| 14 | 601155  | 新城控股     | 11,212,554.00 | 1.00           |
| 15 | 1030 HK | 新城发展     | 11,080,609.27 | 0.99           |
| 16 | 300002  | 神州泰岳     | 11,069,816.00 | 0.99           |
| 17 | 603198  | 迎驾贡酒     | 9,417,131.00  | 0.84           |
| 18 | 600256  | 广汇能源     | 8,969,444.00  | 0.80           |
| 19 | 600057  | 厦门象屿     | 8,912,141.40  | 0.79           |
| 20 | 688099  | 晶晨股份     | 8,585,794.44  | 0.76           |

##### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码    | 股票名称     | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|---------|----------|---------------|----------------|
| 1  | 1055 HK | 中国南方航空股份 | 43,714,204.43 | 3.89           |
| 2  | 667 HK  | 中国东方教育   | 36,680,458.00 | 3.27           |
| 3  | 300750  | 宁德时代     | 26,769,495.18 | 2.38           |
| 4  | 600886  | 国投电力     | 22,970,383.61 | 2.05           |
| 5  | 300002  | 神州泰岳     | 22,683,775.74 | 2.02           |
| 6  | 700 HK  | 腾讯控股     | 20,051,661.66 | 1.79           |
| 7  | 1093 HK | 石药集团     | 19,543,144.07 | 1.74           |
| 8  | 603885  | 吉祥航空     | 17,929,984.25 | 1.60           |
| 9  | 603866  | 桃李面包     | 17,894,198.80 | 1.59           |
| 10 | 002120  | 韵达股份     | 17,793,482.05 | 1.58           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 11 | 600803 | 新奥股份 | 16,646,450.98 | 1.48 |
| 12 | 603993 | 洛阳钼业 | 14,631,543.00 | 1.30 |
| 13 | 603517 | 绝味食品 | 14,249,669.49 | 1.27 |
| 14 | 600919 | 江苏银行 | 14,024,275.00 | 1.25 |
| 15 | 300170 | 汉得信息 | 13,039,425.84 | 1.16 |
| 16 | 753 HK | 中国国航 | 12,475,000.85 | 1.11 |
| 17 | 000543 | 皖能电力 | 11,702,119.00 | 1.04 |
| 18 | 002812 | 恩捷股份 | 11,476,542.30 | 1.02 |
| 19 | 601009 | 南京银行 | 11,150,162.00 | 0.99 |
| 20 | 000858 | 五粮液  | 10,139,029.63 | 0.90 |

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 497,060,774.01 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 556,062,603.43 |

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | 4,124,495.07 | 0.47         |
| 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） | 4,543,986.70 | 0.51         |
| 8  | 同业存单      | -            | -            |
| 9  | 其他        | -            | -            |
| 10 | 合计        | 8,668,481.77 | 0.98         |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量（张）  | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 127085 | 韵达转债     | 38,370 | 4,543,986.70 | 0.51         |
| 2  | 019703 | 23 国债 10 | 36,000 | 3,618,946.85 | 0.41         |
| 3  | 019694 | 23 国债 01 | 5,000  | 505,548.22   | 0.06         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 只债券。

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

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细  
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细  
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策  
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策  
无。

7.11.2 本期国债期货投资评价  
无。

7.12 投资组合报告附注

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

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 121,411.66   |
| 2  | 应收清算款 | 3,110,048.95 |
| 3  | 应收股利  | 1,703,578.56 |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 69,262.89    |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 5,004,302.06 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
无。



## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别       | 持有人户数 (户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构         |            |                  |            |
|------------|-----------|-----------|---------------|------------|------------------|------------|
|            |           |           | 机构投资者         |            | 个人投资者            |            |
|            |           |           | 持有份额          | 占总份额比例 (%) | 持有份额             | 占总份额比例 (%) |
| 嘉实核心蓝筹混合 A | 11,179    | 94,145.61 | 24,081,556.45 | 2.29       | 1,028,372,265.20 | 97.71      |
| 嘉实核心蓝筹混合 C | 5,493     | 11,129.46 | 8,795,107.54  | 14.39      | 52,339,015.13    | 85.61      |
| 合计         | 16,438    | 67,744.73 | 32,876,663.99 | 2.95       | 1,080,711,280.33 | 97.05      |

注：(1) 嘉实核心蓝筹混合 A: 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核心蓝筹混合 A 份额占嘉实核心蓝筹混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实核心蓝筹混合 A 份额占嘉实核心蓝筹混合 A 总份额比例；

(2) 嘉实核心蓝筹混合 C: 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核心蓝筹混合 C 份额占嘉实核心蓝筹混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实核心蓝筹混合 C 份额占嘉实核心蓝筹混合 C 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 | 嘉实核心蓝筹混合 A | 4,051,384.29 | 0.38         |
|                  | 嘉实核心蓝筹混合 C | 800.95       | 0.00         |
|                  | 合计         | 4,052,185.24 | 0.36         |

## 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、基金投资和研究人员持有本开放式基金 | 嘉实核心蓝筹混合 A | >=100              |
|                             | 嘉实核心蓝筹混合 C | 0                  |

|                     |            |       |
|---------------------|------------|-------|
|                     | 合计         | >=100 |
| 本基金基金经理持有本<br>开放式基金 | 嘉实核心蓝筹混合 A | >=100 |
|                     | 嘉实核心蓝筹混合 C | 0     |
|                     | 合计         | >=100 |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 嘉实核心蓝筹混合 A       | 嘉实核心蓝筹混合 C    |
|--|------------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2021 年 7 月 23 日)<br>基金份额总额 | 1,948,356,749.56 | 65,780,297.47 |
| 本报告期期初基金份<br>额总额                       | 1,127,577,081.34 | 66,924,525.10 |
| 本报告期基金总申购<br>份额                        | 13,963,444.17    | 23,036,515.22 |
| 减：本报告期基金总<br>赎回份额                      | 89,086,703.86    | 28,826,917.65 |
| 本报告期基金拆分变<br>动份额                       | -                | -             |
| 本报告期期末基金份<br>额总额                       | 1,052,453,821.65 | 61,134,122.67 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，

姚志鹏先生任公司副总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 交易单元数量 | 股票交易           |                  | 应支付该券商的佣金  |                | 备注 |
|------------|--------|----------------|------------------|------------|----------------|----|
|            |        | 成交金额           | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金         | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 长江证券股份有限公司 | 2      | 288,075,999.35 | 27.77            | 201,653.28 | 28.47          | -  |
| 中信证券股份有限公司 | 4      | 232,847,768.90 | 22.44            | 162,993.46 | 23.01          | -  |
| 国金证券股份有限公司 | 1      | 147,476,085.35 | 14.21            | 103,234.21 | 14.57          | -  |
| 浙商证券股份有限公司 | 2      | 135,772,056.42 | 13.09            | 85,710.57  | 12.10          | -  |
| 开源证券       | 2      | 69,388,358.1   | 6.69             | 43,804.99  | 6.18           | -  |

|                            |   |                   |      |           |      |   |
|----------------------------|---|-------------------|------|-----------|------|---|
| 股份有限<br>公司                 |   | 3                 |      |           |      |   |
| 中国国际<br>金融股份<br>有限公司       | 2 | 62,179,249.6<br>2 | 5.99 | 43,525.66 | 6.14 | - |
| 国盛证券<br>有限责任<br>公司         | 4 | 43,160,835.3<br>3 | 4.16 | 27,246.53 | 3.85 | - |
| 东方证券<br>股份有限<br>公司         | 2 | 28,494,136.7<br>1 | 2.75 | 19,348.11 | 2.73 | - |
| 国泰君安<br>证券股份<br>有限公司       | 3 | 18,324,276.8<br>8 | 1.77 | 12,827.00 | 1.81 | - |
| 广发证券<br>股份有限<br>公司         | 5 | 7,469,898.56      | 0.72 | 5,228.99  | 0.74 | - |
| 国联证券<br>股份有限<br>公司         | 2 | 4,341,674.26      | 0.42 | 2,740.97  | 0.39 | - |
| 安信证券<br>股份有限<br>公司         | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 财通证券<br>股份有限<br>公司         | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东方财富<br>证券股份<br>有限公司       | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东吴证券<br>股份有限<br>公司         | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 东兴证券<br>股份有限<br>公司         | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 高盛(中<br>国)证券有<br>限责任公<br>司 | 2 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 光大证券<br>股份有限<br>公司         | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |
| 国都证券<br>股份有限               | 1 | -                 | -    | -         | -    | - |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 公司           |   |   |   |   |   |   |
| 国信证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司   | 3 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司   | 3 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投         | 3 | - | - | - | - | - |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 证券股份<br>有限公司         |   |   |   |   |   |   |
| 中银国际<br>证券股份<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |

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

## 2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

3. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：长江证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：财通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国盛证券有限责任公司新增交易单元 2 个，华泰证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称       | 债券交易         |                 | 债券回购交易 |                   | 权证交易 |                 |
|------------|--------------|-----------------|--------|-------------------|------|-----------------|
|            | 成交金额         | 占当期债券成交总额的比例(%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例(%) |
| 长江证券股份有限公司 | -            | -               | -      | -                 | -    | -               |
| 中信证券股份有限公司 | 1,995,260.00 | 4.46            | -      | -                 | -    | -               |
| 国金证券股份有限公司 | -            | -               | -      | -                 | -    | -               |

|              |               |       |   |   |   |   |
|--------------|---------------|-------|---|---|---|---|
| 浙商证券股份有限公司   | 20,710,601.00 | 46.29 | - | - | - | - |
| 开源证券股份有限公司   | -             | -     | - | - | - | - |
| 中国国际金融股份有限公司 | -             | -     | - | - | - | - |
| 国盛证券有限责任公司   | -             | -     | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司   | 8,013,600.00  | 17.91 | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 14,022,045.00 | 31.34 | - | - | - | - |
| 广发证券股份有限公司   | -             | -     | - | - | - | - |
| 国联证券股份有限公司   | -             | -     | - | - | - | - |
| 安信证券股份有限公司   | -             | -     | - | - | - | - |
| 财通证券股份有限公司   | -             | -     | - | - | - | - |
| 东方财富证券股份有限公司 | -             | -     | - | - | - | - |

|                |   |   |   |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 东吴证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 高盛(中国)证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司     | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司     | - | - | - | - | - | - |



|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 民生证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                | 法定披露方式               | 法定披露日期          |
|----|-------------------------------------|----------------------|-----------------|
| 1  | 嘉实基金管理有限公司关于调整旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基 | 2023 年 3 月 16 日 |

|   |                              |                             |                 |
|---|------------------------------|-----------------------------|-----------------|
|   | 停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告          | 金电子披露网站                     |                 |
| 2 | 嘉实基金管理有限公司关于防范不法分子诈骗活动的提示性公告 | 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 | 2023 年 3 月 21 日 |
| 3 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告         | 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 | 2023 年 4 月 29 日 |
| 4 | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告         | 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 | 2023 年 6 月 20 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核心蓝筹混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实核心蓝筹混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实核心蓝筹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) 报告期内嘉实核心蓝筹混合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。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日