

嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开  
放式指数证券投资基金  
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：中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投证券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	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
8.4 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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>54</b>
11.1 备查文件目录 .....	54
11.2 存放地点 .....	54
11.3 查阅方式 .....	54

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实上证科创板新一代信息技术 ETF
场内简称	科创信息（扩位场内简称：科创信息技术 ETF）
基金主代码	588100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 18 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	833,748,745.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 5 月 27 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因等）导致无法完全投资于标的指数成分股时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。 具体投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、衍生品投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	上证科创板新一代信息技术指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。 本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	中信建投证券股份有限公司
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
客户服务电话	400-600-8800	95587
传真	(010)65215588	010-85130975

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	北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
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	北京市东城区朝内大街 2 号凯恒中心 B 座 10 层
邮政编码	100020	100010
法定代表人	经雷	王常青

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	47,584,468.63
本期利润	71,498,638.81
加权平均基金份额本期利润	0.1338
本期加权平均净值利润率	11.69%
本期基金份额净值增长率	23.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	111,527,564.73
期末可供分配基金份额利润	0.1338
期末基金资产净值	969,904,432.18
期末基金份额净值	1.1633
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.33%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

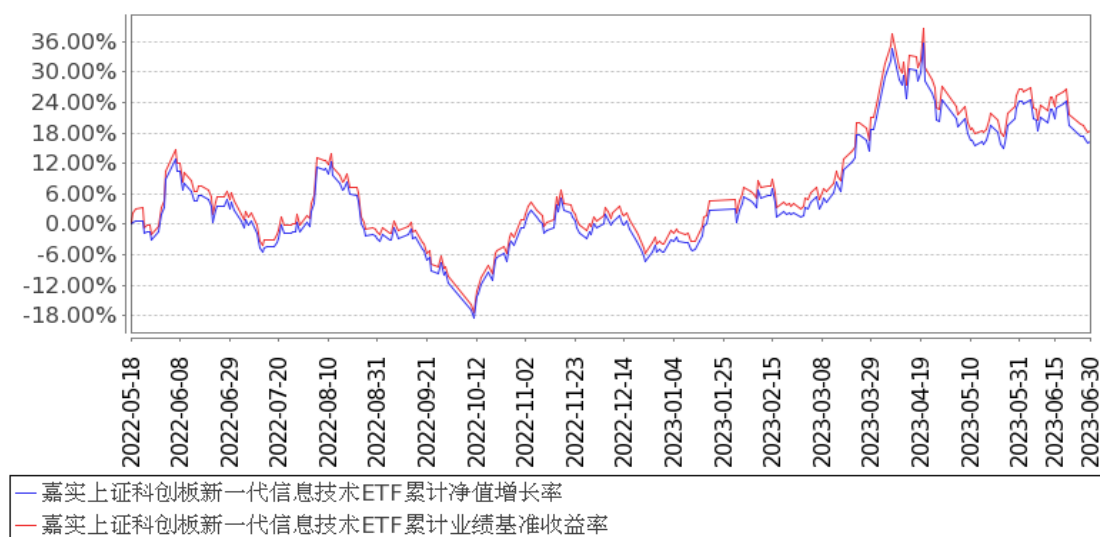
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.37%	1.57%	-6.40%	1.58%	0.03%	-0.01%
过去三个月	-3.89%	2.17%	-4.03%	2.18%	0.14%	-0.01%
过去六个月	23.22%	1.90%	23.35%	1.91%	-0.13%	-0.01%
过去一年	11.45%	1.88%	11.69%	1.89%	-0.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	16.33%	1.89%	18.50%	1.92%	-2.17%	-0.03%

### 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

#### 嘉实上证科创板新一代信息技术ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2022年05月18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		
张钟玉	本基金、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实 H 股 50ETF(QDII)、嘉实上海金 ETF、嘉实纳斯达克 100 指数发起 (QDII)、嘉实中证全指证券公司指数发起式、嘉实创业板增强策略 ETF、嘉实中证内	2022 年 5 月 18 日	-	13 年	曾任大成基金管理有限公司研究员、数量分析师、基金经理。2021 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司指数投资部。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。



	地运输主题 ETF、嘉实上海金 ETF 发起联接、嘉实国证通信 ETF、嘉实纳斯达克 100ETF (QDII) 基金经理				
--	---	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 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、《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数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

本基金跟踪上证科创板新一代信息技术指数，上证科创板新一代信息技术指数从科创板市场

中选取 50 只市值较大的下一代信息网络、电子核心、新兴软件和新型信息技术服务、互联网与云计算、大数据服务、人工智能等领域上市公司证券作为指数样本，以反映科创板市场代表性新一代信息技术产业上市公司证券的整体表现。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，在高通胀、美联储持续加息及地缘政治风险的共同作用下，全球经济波动加剧。全球主要经济体步入去库周期，制造业 PMI 进入下行趋势，多个指标表明全球经济依然存在衰退风险。但受益于服务业的持续高景气，全球经济下行势头趋缓。国内方面，上半年，我国经济总体呈现恢复性向好态势，一季度政策前置发力下，国内经济实现良好开局，一季度 GDP 同比增长 4.5%，二季度在海外风险加大、外需减弱和内需增长动力不足等影响下，国内经济增长边际放缓，但在去年低基数效应下，二季度 GDP 同比增长 6.3%，上半年同比增长 5.5%，总体保持持续向好态势。

本报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.02%，年化跟踪误差为 0.33%。符合基金合同约定的日均跟踪误差不超过 0.2%的限制。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1633 元；本报告期基金份额净值增长率为 23.22%，业绩比较基准收益率为 23.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为被动管理的指数基金，本基金在严守基金合同及相关法律法规要求的前提下，继续秉承指数化投资管理策略，积极应对指数成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的上证科创板新一代信息技术指数的投资工具。

#### 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

在本报告期内，本基金托管人在托管基金过程中，严格遵守了基金合同、托管协议（如有）的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

#### 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

在本报告期内，托管人按照基金合同，托管协议（如有）的有关规定，对本基金的资产净值计算、基金费用进行了认真的复核；托管人按照基金合同或托管协议（如有）中约定的托管人应承担的投资监督职责，根据基金管理人向托管人提供的基金投资相关文件及基金托管账户显示的基金投资信息，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有明显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的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现的相关内容，所复核内容真实、准确和完整。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### § 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：嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,211,157.77	3,087,757.98
结算备付金		199,263.48	45,530.38
存出保证金		33,410.16	53,391.41

交易性金融资产	6.4.7.2	965,129,653.39	486,980,080.99
其中：股票投资		965,129,653.39	486,980,080.99
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	77,342.70
应收股利		16,117.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	40,736.91	-
资产总计		970,630,338.71	490,244,103.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 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		10.94	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		409,026.94	218,201.55
应付托管费		81,805.39	43,640.31
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,896.51	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	228,166.75	241,957.62
负债合计		725,906.53	503,799.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	833,748,745.00	518,748,745.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	136,155,687.18	-29,008,441.02
净资产合计		969,904,432.18	489,740,303.98

负债和净资产总计		970,630,338.71	490,244,103.46
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1633 元，基金份额总额 833,748,745.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 5 月 18 日（基金 合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		73,411,273.71	27,894,561.31
1. 利息收入		422,347.68	416,213.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,891.17	416,213.80
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		409,456.51	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		48,939,275.31	24,407,089.31
其中：股票投资收益	6.4.7.14	46,830,016.62	23,049,397.70
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	420,852.67	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,688,406.02	1,357,691.61
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	23,914,170.18	2,997,870.62
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	135,480.54	73,387.58
<b>减：二、营业总支出</b>		1,912,634.90	562,822.43

1. 管理人报酬		1,519,012.46	453,863.71
2. 托管费		303,802.48	90,772.73
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,475.21	-
8. 其他费用	6.4.7.23	88,344.75	18,185.99
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>71,498,638.81</b>	<b>27,331,738.88</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>71,498,638.81</b>	<b>27,331,738.88</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>71,498,638.81</b>	<b>27,331,738.88</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	518,748,745.00	-	-29,008,441.02	489,740,303.98
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）	518,748,745.00	-	-29,008,441.02	489,740,303.98
三、本期增减变	315,000,000.00	-	165,164,128.20	480,164,128.20

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	71,498,638.81	71,498,638.81
(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)	315,000,000.00	-	93,665,489.39	408,665,489.39
其中:1.基金申购款	980,000,000.00	-	175,381,712.68	1,155,381,712.68
2.基金赎回款	-665,000,000.00	-	-81,716,223.29	-746,716,223.29
(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)	833,748,745.00	-	136,155,687.18	969,904,432.18
项目	上年度可比期间			

	2022 年 5 月 18 日（基金合同生效日）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)	-	-	-	-
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	1,397,248,745.00	-	-	1,397,248,745.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-976,500,000.00	-	18,410,248.55	-958,089,751.45
(一)、综合收益总额	-	-	27,331,738.88	27,331,738.88
(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)	-976,500,000.00	-	-8,921,490.33	-985,421,490.33
其中:1.基金申购款	385,000,000.00	-	23,126,761.56	408,126,761.56
2.基金赎回款	-1,361,500,000.00	-	-32,048,251.89	-1,393,548,251.89
(三)、	-	-	-	-



本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(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)	420,748,745.00	-	18,410,248.55	439,158,993.55

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

嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]793号《关于准予嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2022年5月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,397,248,745.00份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通

知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
活期存款	5,211,157.77
等于：本金	5,210,341.80
加：应计利息	815.97
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	5,211,157.77

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	965,800,488.93	-	965,129,653.39	-670,835.54
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	965,800,488.93	-	965,129,653.39	-670,835.54

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	40,736.91
待摊费用	-
合计	40,736.91

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	141,386.30
其中：交易所市场	141,386.30
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	228,166.75

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	518,748,745.00	518,748,745.00
本期申购	980,000,000.00	980,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-665,000,000.00	-665,000,000.00
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	833,748,745.00	833,748,745.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,949,292.70	-47,957,733.72	-29,008,441.02
本期利润	47,584,468.63	23,914,170.18	71,498,638.81
本期基金份额交易产生的变动数	44,993,803.40	48,671,685.99	93,665,489.39
其中：基金申购款	94,356,517.86	81,025,194.82	175,381,712.68
基金赎回款	-49,362,714.46	-32,353,508.83	-81,716,223.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111,527,564.73	24,628,122.45	136,155,687.18

#### 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	11,320.09
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	1,310.31	

其他	260.77
合计	12,891.17

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,951,319.11
股票投资收益——赎回差价收入	44,878,697.51
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	46,830,016.62

##### 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	125,615,838.36
减：卖出股票成本总额	123,335,529.74
减：交易费用	328,989.51
买卖股票差价收入	1,951,319.11

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	746,716,223.29
减：现金支付赎回款总额	1,514,472.29
减：赎回股票成本总额	700,323,053.49
减：交易费用	-
赎回差价收入	44,878,697.51

##### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

##### 6.4.7.14.5 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	289.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	420,563.23
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	420,852.67

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,384,916.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	964,000.00
减：应计利息总额	297.92
减：交易费用	55.38
买卖债券差价收入	420,563.23

#### 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	1,688,406.02
其中：证券出借权益补偿收入	224,039.08
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,688,406.02

## 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	23,914,170.18
股票投资	23,914,170.18
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	23,914,170.18

## 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	-
替代损益	135,480.54
合计	135,480.54

## 6.4.7.22 信用减值损失

无。

## 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	1,564.30
合计	88,344.75

## 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
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日）至 2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
中信建投证券股份 有限公司	282,987,220.99	100.00	1,589,581,001.29	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日）至 2022年6月30日	
	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 成交总额的比 例（%）
中信建投证券股份 有限公司	1,384,916.53	100.00	-	-

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券股 份有限公司	178,709.39	100.00	141,386.30	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中信建投证券股 份有限公司	1,003,943.28	100.04	1,003,943.28	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

## 6.4.10.2 关联方报酬

## 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,519,012.46	453,863.71
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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×0.50%/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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	303,802.48	90,772.73

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

## 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

## 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

## 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

中信建投证 券	202302 070000 0649	晶晨股 份	2023年 2月7日	1565200. 00	20,000	14.00	3.20	1947.8 0	-	-
中信建投证 券	202302 210000 4635	晶晨股 份	2023年 2月21 日	1663400. 00	20,000	14.00	3.20	2070.0 1	-	-
中信建投证 券	202303 030000 0931	寒武纪	2023年 3月3日	937100.0 0	10,000	14.00	3.20	1166.1 7	-	-
中信建投证 券	202303 070000 7694	晶晨股 份	2023年 3月7日	1480200. 00	20,000	14.00	3.20	1842.0 3	-	-
中信建投证 券	202303 080000 0628	澜起科 技	2023年 3月8日	2006810. 00	35,900	14.00	3.20	2497.3 6	-	-
中信建投证 券	202303 170001 0471	寒武纪	2023年 3月17 日	1229300. 00	10,000	14.00	3.20	1529.8 0	-	-
中信建投证 券	202303 210000 9288	晶晨股 份	2023年 3月21 日	1606000. 00	20,000	14.00	3.20	1998.5 8	-	-
中信建投证 券	202303 220000 8409	澜起科 技	2023年 3月22 日	2266367. 00	35,900	14.00	3.20	3021.8 2	-	-
中信建投证 券	202303 300000 1781	澜起科 技	2023年 3月30 日	1883000. 00	26,900	14.00	3.20	2343.2 9	-	-
中信建投证 券	202303 310000 9197	寒武纪	2023年 3月31 日	1859500. 00	10,000	14.00	3.20	2314.0 4	-	-
中信建投证 券	202304 040001 0531	晶晨股 份	2023年 4月4日	1706200. 00	20,000	14.00	3.20	2123.2 7	-	-
中信建投证 券	202304 060001 4128	澜起科 技	2023年 4月6日	2700757. 00	35,900	14.00	3.20	3360.9 4	-	-
中信建投证 券	202304 130001 8671	澜起科 技	2023年 4月13 日	1927385. 00	26,900	14.00	3.20	2398.5 2	-	-
中信建投证 券	202304 140000 7885	寒武纪	2023年 4月14 日	1950000. 00	10,000	14.00	3.20	2426.6 7	-	-
中信建投证 券	202304 180000	晶晨股 份	2023年 4月18	1786600. 00	20,000	14.00	3.20	2540.9 4	-	-

	9843		日									
中信建投证 券	202304 200000 7321	澜起科 技	2023年 4月20 日	2744914. 00	35,900	14.00	3.20	3415.8 9	-	-		
中信建投证 券	202304 270001 8402	澜起科 技	2023年 4月27 日	1695776. 00	26,900	14.00	3.20	2110.3 0	-	-		
中信建投证 券	202304 280001 1386	寒武纪	2023年 4月28 日	2495000. 00	10,000	14.00	3.20	3104.8 9	-	-		
中信建投证 券	202305 040002 2919	澜起科 技	2023年 5月4日	2130665. 00	35,900	14.00	3.20	2651.4 9	-	-		
中信建投证 券	202305 040002 9235	晶晨股 份	2023年 5月4日	1572000. 00	20,000	14.00	3.20	1956.2 7	-	-		
中信建投证 券	202305 110002 3191	澜起科 技	2023年 5月11 日	1500751. 00	26,900	14.00	3.20	1867.6 0	-	-		
中信建投证 券	202305 120000 9724	寒武纪	2023年 5月12 日	1960000. 00	10,000	14.00	3.20	2439.1 1	-	-		
中信建投证 券	202305 180002 1666	澜起科 技	2023年 5月18 日	1490600. 00	25,700	14.00	3.20	1854.9 7	-	-		
中信建投证 券	202305 250002 1666	澜起科 技	2023年 5月25 日	1616690. 00	26,900	12.00	3.20	1724.4 7	-	-		
中信建投证 券	202305 260001 0950	寒武纪	2023年 5月26 日	2240000. 00	10,000	11.00	3.20	2190.2 2	-	-		
中信建投证 券	202306 010003 4220	澜起科 技	2023年 6月1日	1595970. 00	25,700	14.00	3.20	1986.1 0	-	-		
中信建投证 券	202306 060001 3922	澜起科 技	2023年 6月6日	1589521. 00	26,900	14.00	3.20	1978.0 7	-	-		
中信建投证 券	202306 060001 4883	寒武纪	2023年 6月6日	2232500. 00	10,000	14.00	3.20	2778.2 2	-	-		
中信建投证 券	202306 150003 8498	澜起科 技	2023年 6月15 日	1580293. 00	25,700	14.00	3.20	1966.5 9	-	-		
中信建投证	202306	寒武纪	2023年	2670000.	10,000	14.00	3.20	3322.6	267000	2373.30		

券	200003 1278		6月20 日	00				7	0.00	
中信建投证 券	202306 200003 4435	澜起科 技	2023年 6月20 日	1624760. 00	26,900	14.00	3.20	2021.9 2	162476 0.00	1444.20
中信建投证 券	202306 290003 2225	澜起科 技	2023年 6月29 日	1430719. 00	25,700	14.00	3.20	1780.4 5	143071 9.00	127.18
上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日）至2022年6月30日										
关联方 名称	合约 编号	证券 名称	成交时 间	交易金 额	交易 数量（单 位：股）	出借 期限（单 位：天）	费率 （%）	利息 收入	期末证 券出借 业务余 额	期末应收 利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
中信建投证 券	5,614,629.00	0.67	9,883,541.00	1.91

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年5月18日（基金合同生效日） 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
中信建投证券股份有限 公司_活期	5,211,157.77	11,320.09	1,963,862.68	401,139.48

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
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	1,278	8,409.24	9,687.24	-
601065	江盐集团	2023年3月31日	6个月	新股锁定	10.36	11.84	480	4,972.80	5,683.20	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	6个月	新股锁定	11.66	12.26	360	4,197.60	4,413.60	-
603125	常青科技	2023年3月30日	6个月	新股锁定	25.98	24.53	136	3,533.28	3,336.08	-
603172	万丰股份	2023年4月28日	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	2,876	57,117.36	51,940.56	-
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	-
688361	中科飞测	2023年5月12日	6个月	新股锁定	23.60	64.67	509	12,012.40	32,917.03	-
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	388	10,344.08	12,222.00	-
688469	中芯集成	2023年4月28日	6个月	新股锁定	5.69	5.41	6,038	34,356.22	32,665.58	-



		日									
688472	阿特斯	2023年 6月2日	6个月	新股锁 定	11.10	17.04	2,915	32,356.50	49,671.60		-
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		-
688507	索辰科 技	2023年 4月10 日	6个月	新股锁 定	245.56	122.11	93	15,470.28	11,356.23		-
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		-
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		-
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		-
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		-
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		-
688603	天承科 技	2023年 6月30 日	1个月 内(含)	新发未 上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00		-
688603	天承科 技	2023年 6月30 日	6个月	新股锁 定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00		-
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	二元科 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		-

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

无。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	688111	金山办公	2023年7月4日-2023年7月13日	472.22	43,900	20,730,458.00
2	688981	中芯国际	2023年7月4日-2023年7月13日	50.52	317,400	16,035,048.00
3	688012	中微公司	2023年7月4日-2023年7月13日	156.45	83,000	12,985,350.00
4	688036	传音控股	2023年7月4日-2023年7月13日	147.00	71,800	10,554,600.00
5	688008	澜起科技	2023年7月4日-2023年7月13日	57.42	159,700	9,169,974.00
6	688256	寒武纪	2023年7月4日-2023年7月13日	188.00	38,200	7,181,600.00
7	688396	华润微	2023年7月4日-2023年7月13日	52.41	101,400	5,314,374.00
8	688126	沪硅产业	2023年7月4日-2023年7月13日	20.90	234,600	4,903,140.00
9	688777	中控技术	2023年7月7日-2023年7月14日	62.78	69,200	4,344,376.00
10	688169	石头科技	2023年7月4日-2023年7月13日	320.68	10,800	3,463,344.00
11	688521	芯原股份	2023年7月4日-2023年7月13日	71.92	48,000	3,452,160.00
12	688002	睿创微纳	2023年7月4日-2023年7月13日	44.80	68,800	3,082,240.00
13	688072	拓荆科	2023年7月4日-2023年	425.97	7,200	3,066,984.00

		技	7月13日			.00
14	689009	九号公司	2023年7月4日-2023年7月13日	36.85	82,400	3,036,440.00
15	688041	海光信息	2023年7月4日-2023年7月13日	68.27	42,200	2,880,994.00
16	688561	奇安信	2023年7月4日-2023年7月13日	51.81	52,600	2,725,206.00
17	688385	复旦微电子	2023年7月4日-2023年7月13日	50.10	51,200	2,565,120.00
18	688099	晶晨股份	2023年7月7日	84.32	26,200	2,209,184.00
19	688536	思瑞浦	2023年7月7日-2023年7月10日	218.00	9,500	2,071,000.00
20	688120	华海清科	2023年7月4日-2023年7月13日	252.05	8,156	2,055,719.80
21	688538	和辉光电	2023年7月4日-2023年7月13日	2.54	801,200	2,035,048.00
22	688037	芯源微	2023年7月4日-2023年7月13日	170.95	11,400	1,948,830.00
23	688188	柏楚电子	2023年7月4日-2023年7月13日	188.56	9,600	1,810,176.00
24	688200	华峰测控	2023年7月4日-2023年7月13日	153.00	11,800	1,805,400.00
25	688220	翱捷科技	2023年7月4日-2023年7月13日	75.39	22,600	1,703,814.00
26	688608	恒玄科技	2023年7月4日-2023年7月13日	121.03	13,800	1,670,214.00
27	688208	道通科技	2023年7月3日-2023年7月7日	30.31	51,400	1,557,934.00
28	688772	珠海冠宇	2023年7月4日-2023年7月13日	20.15	71,800	1,446,770.00
29	688568	中科星图	2023年7月4日-2023年7月13日	80.58	16,400	1,321,512.00
30	688083	中望软件	2023年7月4日-2023年7月13日	144.89	9,000	1,304,010.00
31	688082	盛美上海	2023年7月4日-2023年7月13日	110.40	11,800	1,302,720.00
32	688019	安集科技	2023年7月4日-2023年7月13日	164.83	7,400	1,219,742.00
33	688728	格科微	2023年7月4日-2023年7月13日	15.82	75,600	1,195,992.00
34	688696	极米科技	2023年7月4日-2023年7月13日	139.39	8,200	1,142,998.00
35	688052	纳芯微	2023年7月4日-2023年	158.37	7,000	1,108,590.00

			7月13日			.00
36	688232	新点软件	2023年7月4日-2023年7月13日	53.81	19,000	1,022,390.00
37	688107	安路科技	2023年7月4日-2023年7月13日	55.39	15,800	875,162.00
38	688234	天岳先进	2023年7月4日-2023年7月13日	73.94	11,800	872,492.00
39	688326	经纬恒润	2023年7月4日-2023年7月13日	144.39	5,600	808,584.00
40	688047	龙芯中科	2023年7月4日-2023年7月13日	114.79	6,400	734,656.00
41	688798	艾为电子	2023年7月4日-2023年7月13日	59.15	11,200	662,480.00
42	688261	东微半导	2023年7月4日-2023年7月13日	139.87	4,400	615,428.00
43	688409	富创精密	2023年7月7日	109.00	5,600	610,400.00
44	688439	振华风光	2023年7月7日	109.82	5,400	593,028.00
45	688375	国博电子	2023年7月4日-2023年7月13日	79.20	6,400	506,880.00
46	688153	唯捷创芯	2023年7月4日-2023年7月13日	73.16	6,400	468,224.00
47	688387	信科移动	2023年7月7日	8.35	46,000	384,100.00
48	688213	思特威	2023年7月4日-2023年7月13日	51.14	6,400	327,296.00
49	688055	龙腾光电	2023年7月4日-2023年7月13日	4.06	70,600	286,636.00
50	688327	云从科技	2023年7月7日	17.30	7,400	128,020.00
合计	-	-	-	-	2,883,656	153,296,837.80

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

## 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

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误

差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。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风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

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

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

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,211,157.77	-	-	-	5,211,157.77
结算备付金	199,263.48	-	-	-	199,263.48
存出保证金	33,410.16	-	-	-	33,410.16
交易性金融资产	-	-	-	965,129,653.39	965,129,653.39
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	-	-	-	16,117.00	16,117.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	40,736.91	40,736.91
资产总计	5,443,831.41	-	-	965,186,507.30	970,630,338.71
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	-	-	-	10.94	10.94
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	409,026.94	409,026.94
应付托管费	-	-	-	81,805.39	81,805.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	6,896.51	6,896.51

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	228,166.75	228,166.75
负债总计	-	-	-	725,906.53	725,906.53
利率敏感度缺口	5,443,831.41	-	-	-964,460,600.77	969,904,432.18
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,087,757.98	-	-	-	3,087,757.98
结算备付金	45,530.38	-	-	-	45,530.38
存出保证金	53,391.41	-	-	-	53,391.41
交易性金融资产	-	-	-	-486,980,080.99	486,980,080.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	77,342.70	77,342.70
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,186,679.77	-	-	-487,057,423.69	490,244,103.46
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	218,201.55	218,201.55
应付托管费	-	-	-	43,640.31	43,640.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	241,957.62	241,957.62
负债总计	-	-	-	503,799.48	503,799.48
利率敏感度缺口	3,186,679.77	-	-	-486,553,624.21	489,740,303.98

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	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	965,129,653.39	99.51	486,980,080.99	99.44
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	965,129,653.39	99.51	486,980,080.99	99.44

## 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%	48,241,461.44	23,732,953.86
	业绩比较基准下降5%	-48,241,461.44	-23,732,953.86

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	964,643,188.19	485,678,373.54
第二层次	76,505.00	-
第三层次	409,960.20	1,301,707.45
合计	965,129,653.39	486,980,080.99

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	965,129,653.39	99.43
	其中：股票	965,129,653.39	99.43

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,410,421.25	0.56
8	其他各项资产	90,264.07	0.01
9	合计	970,630,338.71	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 153,296,837.80 元，占基金资产净值的比例为 15.81%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	660,246,644.20	68.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	304,396,543.99	31.38
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	964,643,188.19	99.46

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	420,625.91	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,413.60	0.00
F	批发和零售业	9,687.24	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,343.97	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	486,465.20	0.05

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资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	688111	金山办公	206,533	97,529,013.26	10.06
2	688981	中芯国际	1,873,391	94,643,713.32	9.76

3	688012	中微公司	484,984	75,875,746.80	7.82
4	688036	传音控股	360,325	52,967,775.00	5.46
5	688008	澜起科技	890,345	51,123,609.90	5.27
6	688256	寒武纪	233,257	43,852,316.00	4.52
7	688777	中控技术	528,516	33,180,234.48	3.42
8	688126	沪硅产业	1,529,355	31,963,519.50	3.30
9	688396	华润微	591,360	30,993,177.60	3.20
10	688099	晶晨股份	326,094	27,496,246.08	2.83
11	688037	芯源微	123,808	21,164,977.60	2.18
12	688169	石头科技	62,883	20,165,320.44	2.08
13	688521	芯原股份	278,958	20,062,659.36	2.07
14	688072	拓荆科技	42,205	17,978,063.85	1.85
15	688002	睿创微纳	400,707	17,951,673.60	1.85
16	688041	海光信息	260,326	17,772,456.02	1.83
17	689009	九号公司	481,702	17,750,718.70	1.83
18	688536	思瑞浦	81,097	17,679,146.00	1.82
19	688220	翱捷科技	234,154	17,652,870.06	1.82
20	688561	奇安信	306,917	15,901,369.77	1.64
21	688772	珠海冠宇	753,730	15,187,659.50	1.57
22	688385	复旦微电	297,759	14,917,725.90	1.54
23	688120	华海清科	55,205	13,914,420.25	1.43
24	688200	华峰测控	90,526	13,850,478.00	1.43
25	688188	柏楚电子	65,204	12,294,866.24	1.27
26	688083	中望软件	82,016	11,883,298.24	1.23
27	688538	和辉光电	4,666,820	11,853,722.80	1.22
28	688019	安集科技	66,091	10,893,779.53	1.12
29	688082	盛美上海	97,083	10,717,963.20	1.11
30	688608	恒玄科技	80,962	9,798,830.86	1.01
31	688208	道通科技	303,506	9,199,266.86	0.95
32	688728	格科微	559,442	8,850,372.44	0.91
33	688568	中科星图	109,585	8,830,359.30	0.91
34	688409	富创精密	70,003	7,630,327.00	0.79
35	688052	纳芯微	47,532	7,527,642.84	0.78
36	688107	安路科技	134,171	7,431,731.69	0.77
37	688439	振华风光	66,823	7,338,501.86	0.76
38	688234	天岳先进	96,251	7,116,798.94	0.73
39	688696	极米科技	47,061	6,559,832.79	0.68
40	688798	艾为电子	104,369	6,173,426.35	0.64
41	688261	东微半导	43,684	6,110,081.08	0.63
42	688232	新点软件	110,622	5,952,569.82	0.61
43	688326	经纬恒润	40,081	5,787,295.59	0.60
44	688387	信科移动	572,028	4,776,433.80	0.49
45	688047	龙芯中科	40,185	4,612,836.15	0.48

46	688375	国博电子	40,099	3,175,840.80	0.33
47	688153	唯捷创芯	36,305	2,656,073.80	0.27
48	688327	云从科技	127,562	2,206,822.60	0.23
49	688213	思特威	39,929	2,041,969.06	0.21
50	688055	龙腾光电	405,826	1,647,653.56	0.17

### 7.3.2 期末积极投资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	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
2	688249	晶合集成	2,876	51,940.56	0.01
3	688472	阿特斯	2,915	49,671.60	0.01
4	688361	中科飞测	509	32,917.03	0.00
5	688469	中芯集成	6,038	32,665.58	0.00
6	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
7	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
8	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
9	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
10	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
11	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
12	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
13	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
14	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
15	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
16	688433	华曙高科	388	12,222.00	0.00
17	688507	索辰科技	93	11,356.23	0.00
18	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
19	601061	中信金属	1,278	9,687.24	0.00
20	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
21	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
22	601065	江盐集团	480	5,683.20	0.00
23	601133	柏诚股份	360	4,413.60	0.00
24	603125	常青科技	136	3,336.08	0.00
25	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 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688220	翱捷科技	14,871,109.47	3.04
2	688772	珠海冠宇	11,334,278.05	2.31
3	688037	芯源微	9,170,526.65	1.87
4	688409	富创精密	7,356,476.95	1.50

5	688041	海光信息	6,704,510.85	1.37
6	688439	振华风光	6,550,494.91	1.34
7	688120	华海清科	6,458,046.49	1.32
8	688082	盛美上海	5,863,313.04	1.20
9	688981	中芯国际	5,776,799.94	1.18
10	688261	东微半导	5,418,811.98	1.11
11	688536	思瑞浦	5,203,206.45	1.06
12	688012	中微公司	4,754,198.00	0.97
13	688126	沪硅产业	4,344,224.99	0.89
14	688387	信科移动	4,238,358.54	0.87
15	688107	安路科技	4,129,408.73	0.84
16	688111	金山办公	3,930,290.61	0.80
17	688234	天岳先进	3,731,777.14	0.76
18	688008	澜起科技	3,508,070.66	0.72
19	688256	寒武纪	3,495,752.28	0.71
20	688188	柏楚电子	3,096,428.50	0.63

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688111	金山办公	11,707,500.09	2.39
2	688981	中芯国际	7,465,687.39	1.52
3	688012	中微公司	7,348,760.70	1.50
4	688023	安恒信息	5,546,188.84	1.13
5	688110	东芯股份	5,458,671.11	1.11
6	688777	中控技术	5,311,816.74	1.08
7	688008	澜起科技	5,256,381.11	1.07
8	688036	传音控股	5,141,336.29	1.05
9	688048	长光华芯	4,895,444.02	1.00
10	688776	国光电气	4,747,337.75	0.97
11	688396	华润微	3,532,948.22	0.72
12	688256	寒武纪	3,158,147.94	0.64
13	688800	瑞可达	3,109,336.10	0.63
14	688099	晶晨股份	3,022,802.44	0.62
15	688088	虹软科技	2,995,566.47	0.61
16	688120	华海清科	2,612,224.49	0.53
17	688169	石头科技	2,555,995.27	0.52
18	688167	炬光科技	2,532,512.87	0.52
19	688326	经纬恒润	2,527,459.46	0.52
20	688521	芯原股份	2,438,630.46	0.50

#### 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	161,687,735.42
--------------	----------------



卖出股票收入（成交）总额	125,615,838.36
--------------	----------------

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

无。

#### 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

无。

#### 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	33,410.16
2	应收清算款	-

3	应收股利	16,117.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	40,736.91
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,264.07

#### 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

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688111	金山办公	20,730,458.00	2.14	转融通出借证券
2	688981	中芯国际	16,035,048.00	1.65	转融通出借证券
3	688012	中微公司	12,985,350.00	1.34	转融通出借证券
4	688036	传音控股	10,554,600.00	1.09	转融通出借证券
5	688008	澜起科技	9,169,974.00	0.95	转融通出借证券
6	688256	寒武纪	7,181,600.00	0.74	转融通出借证券
7	688396	华润微	5,314,374.00	0.55	转融通出借证券
8	688126	沪硅产业	4,903,140.00	0.51	转融通出借证券
9	688777	中控技术	4,344,376.00	0.45	转融通出借证券
10	688099	晶晨股份	2,209,184.00	0.23	转融通出借证券

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688603	天承科技	68,805.00	0.01	新发未上市
1	688603	天承科技	7,700.00	0.00	新股锁定
2	688249	晶合集成	51,940.56	0.01	新股锁定
3	688472	阿特斯	49,671.60	0.01	新股锁定
4	688361	中科飞测	32,917.03	0.00	新股锁定
5	688469	中芯集成	32,665.58	0.00	新股锁定

#### 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

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 (%)
7,260	114,841.42	549,065,018.00	65.85	284,683,727.00	34.15

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	87,922,700.00	10.55
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	63,473,700.00	7.61
3	泰康资产丰选 FOF4 号股票型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	35,612,000.00	4.27
4	新华人寿保险股份有限公司	35,100,000.00	4.21
5	新华人寿保险股份有限公司—新华人寿保险稳得盈两全保险 (分红型)	27,350,000.00	3.28
6	中信期货有限公司—中信期货工银量化宏观配置 2 号资产管理计划	25,011,500.00	3.00
7	新华人寿保险股份有限公司—万能—得意理财债券、基金账户	19,600,000.00	2.35
8	中信证券股份有限公司	16,661,987.00	2.00
9	兴业证券股份有限公司	14,000,000.00	1.68
10	姜春梅	13,408,700.00	1.61

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	18,100.00	0.00

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2022年5月18日） 基金份额总额	1,397,248,745.00
本报告期期初基金份额总额	518,748,745.00
本报告期基金总申购份额	980,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	665,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	833,748,745.00

**§ 10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动****（1）基金管理人的重大人事变动情况**

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

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

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

2023年6月20日，本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，姚志鹏先生任公司副总经理。

**（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况**

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关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 (%)	
中信建投证券股份有限公司	3	282,987,220.99	100.00	178,709.39	100.00	-

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

#### 2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
中信建投证券股份有限公司	1,384,916.53	100.00	-	-	-	-

## 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防范不法分子诈骗活动的提示性公告	证券日报、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
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、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
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、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上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金注册的批复文件。

(2) 《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

(3) 《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

(4) 《嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数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) 报告期内嘉实上证科创板新一代信息技术交易型开放式指数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**