

# 嘉合磐石混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:平安银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安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，投资者在做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

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
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	50
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	50
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	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	52
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
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.....	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合磐石混合型证券投资基金	
基金简称	嘉合磐石	
基金主代码	001571	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月03日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,809,432.83份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合磐石A	嘉合磐石C
下属分级基金的交易代码	001571	001572
报告期末下属分级基金的份额总额	14,185,627.22份	57,623,805.61份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险、保持组合流动性的前提下，本基金通过大类资产配置，优选投资标的，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、大类资产配置；2、债券投资策略；3、股票投资策略；4、存托凭证投资策略；5、权证投资策略。
业绩比较基准	一年期人民币定期存款利率（税后）+3%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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		嘉合基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔为中	李帅帅
	联系电话	021-60168288	0755-25878287
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn

客户服务电话	400-0603-299	95511-3
传真	021-65015077	0755-82080387
注册地址	上海市虹口区广纪路738号1幢329室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
办公地址	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码	200082	518001
法定代表人	金川	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼

## §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01月01日-2023年06月30日)	
	嘉合磐石A	嘉合磐石C
本期已实现收益	-383,046.46	-1,864,916.95
本期利润	2,789,559.68	11,378,363.42
加权平均基金份额本期利润	0.2521	0.2320
本期加权平均净值利润率	26.64%	25.47%

本期基金份额净值增长率	29.91%	29.64%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-863,440.08	-5,399,082.65
期末可供分配基金份额利润	-0.0609	-0.0937
期末基金资产净值	15,395,072.78	60,280,595.54
期末基金份额净值	1.0853	1.0461
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	36.42%	31.95%

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、所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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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

嘉合磐石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	4.71%	1.87%	0.37%	0.00%	4.34%	1.87%
过去三个月	15.02%	1.83%	1.12%	0.00%	13.90%	1.83%
过去六个月	29.91%	1.47%	2.23%	0.00%	27.68%	1.47%
过去一年	19.99%	1.26%	4.50%	0.00%	15.49%	1.26%
过去三年	2.18%	1.21%	13.49%	0.00%	-11.31%	1.21%
自基金合同生效起至今	36.42%	0.85%	36.09%	0.00%	0.33%	0.85%

嘉合磐石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	4.67%	1.87%	0.37%	0.00%	4.30%	1.87%
过去三个月	14.91%	1.83%	1.12%	0.00%	13.79%	1.83%
过去六个月	29.64%	1.47%	2.23%	0.00%	27.41%	1.47%
过去一年	19.51%	1.26%	4.50%	0.00%	15.01%	1.26%
过去三年	0.96%	1.21%	13.49%	0.00%	-12.53%	1.21%
自基金合同 生效起至今	31.95%	0.80%	36.09%	0.00%	-4.14%	0.80%

### 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

嘉合磐石A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年07月03日-2023年06月30日)



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



嘉合磐石C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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

嘉合基金管理有限公司（以下简称“嘉合基金”或“公司”）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2023年6月30日，公司注册资本为人民币3亿元。

截至2023年6月30日，嘉合基金旗下共管理25只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资

基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合锦鑫混合型证券投资基金、嘉合磐弘一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐恒债券型证券投资基金、嘉合磐益纯债债券型证券投资基金、嘉合胶东经济圈中高等级信用债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、嘉合锦荣混合型证券投资基金及嘉合磐辉纯债债券型证券投资基金。

#### 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		
李超	固定收益研究部总监，嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合磐益纯债债券型证券投资基金、嘉合胶东经济圈中高等级信用债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、嘉合磐辉纯债债券型证券投资基金的基金经理。	2021-06-30	-	16年	上海交通大学理学学士。曾任友邦保险中国区资产管理中心债券交易员、浦银安盛基金管理有限公司债券交易员、国投瑞银基金管理有限公司投资经理助理、交银施罗德基金管理有限公司投资经理、富国基金管理有限公司投资经理、上海弘尚资产管理中心（有限合伙）固定收益总监，2020年加入嘉合基金管理有限公司。

注：1、李超的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律、法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有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

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

#### 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

今年以来，随着国内政策的调整优化，经济呈现复苏态势，各项经济指标均出现改善。但二季度以来，复苏的动能有所减弱，房地产市场依然较为低迷，出口增速也出现了一定的下滑。在这样的背景下，A股在上半年先扬后抑，AI和中特估相关股票表现较为亮眼。

组合操作方面，组合在一季度进行了一定的调仓，持仓从新能源个股调整为以TMT为代表的科技股。

债券方面，二季度债券收益率创下20年4月份以来的新低，下半年收益率可能面临一定的回升压力，但是在宽松的流动性支持下，收益率上行的空间可能也较为有限。我们依然看好中高评级中短期限信用债的配置价值，并积极参与利率债的交易性机会。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合磐石A基金份额净值为1.0853元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为29.91%，同期业绩比较基准收益率为2.23%；截至报告期末嘉合磐石C基金份

额净值为1.0461元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为29.64%，同期业绩比较基准收益率为2.23%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为，库存周期大概率将在三季度见底回升，经济内生复苏动能将有所增强；另一方面，我们预计更多的经济支持政策将在下半年陆续发布。因此，我们看好下半年经济将有更强的复苏，企业盈利也将开始改善。此外，央行在6月份和8月份两次降息，我们预计下半年流动性仍将维持宽松。因此，随着经济的复苏和流动性的宽松，我们对A股下半年的表现保持相对乐观的态度。

具体而言，我们仍相对看好几条主线：1) 受益于经济复苏的大消费 2) 以TMT、半导体为代表的硬科技 3) 新能源中的新技术方向等

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总经理批准后实施。

基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用中国证券投资基金业协会核算估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准来估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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

本基金于2022年12月20日至2023年1月19日期间基金资产净值低于人民币五十万元，连续二十个工作日以上但少于六十个工作日。

本基金于2023年2月3日至2023年3月21日期间基金资产净值低于人民币五十万元，连续二十个工作日以上但少于六十个工作日。

### §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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：嘉合磐石混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06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	14,102,920.05	26,466,034.85
结算备付金		1,021,058.08	794,906.85
存出保证金		27,607.82	14,925.10

交易性金融资产	6.4.7.2	32,773,069.87	21,393,677.65
其中：股票投资		28,701,154.25	18,282,038.40
基金投资		-	-
债券投资		4,071,915.62	3,111,639.25
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	24,991,711.50	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		3,078,212.15	-
应收股利		-	-
应收申购款		279,555.57	7,645.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		76,274,135.04	48,677,190.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06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		-	184,558.51
应付赎回款		366,967.23	69,082.13

应付管理人报酬		34,029.61	25,622.08
应付托管费		5,671.60	4,270.35
应付销售服务费		18,063.63	13,914.32
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	173,734.65	142,112.15
负债合计		598,466.72	439,559.54
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	71,809,432.83	59,401,457.99
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	3,866,235.49	-11,163,827.20
净资产合计		75,675,668.32	48,237,630.79
负债和净资产总计		76,274,135.04	48,677,190.33

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.0538元，A类基金份额净值1.0853元，C类基金份额净值1.0461元，基金份额总额71,809,432.83份，其中A类基金份额14,185,627.22份，C类基金份额57,623,805.61份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉合磐石混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		14,534,192.22	-13,205,786.96
1.利息收入		135,716.85	27,983.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,512.14	13,261.66
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		105,204.71	14,721.48
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,057,960.03	-18,524,279.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,993,749.12	-6,026,240.98
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	856,911.00	-12,518,884.63
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	78,878.09	20,846.16
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）	6.4.7.17	16,415,886.51	5,262,104.68
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	40,548.89	28,404.67
<b>减：二、营业总支出</b>		366,269.12	440,397.72
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	164,539.70	193,236.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	27,423.29	32,206.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	88,909.25	103,352.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,330.11	28,454.49
其中：卖出回购金融资产 支出		2,330.11	28,454.49



6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	81.70
8. 其他费用	6.4.7.19	83,066.77	83,066.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,167,923.10	-13,646,184.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,167,923.10	-13,646,184.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,167,923.10	-13,646,184.68

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉合磐石混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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）	59,401,457.99	-	-11,163,827.20	48,237,630.79
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）	59,401,457.99	-	-11,163,827.20	48,237,630.79
三、本期增减变动额（减少以	12,407,974.84	-	15,030,062.69	27,438,037.53

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	14,167,923.10	14,167,923.10
(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)	12,407,974.84	-	862,139.59	13,270,114.43
其中: 1.基金申购款	33,313,838.27	-	454,639.56	33,768,477.83
2.基金赎回款	-20,905,863.43	-	407,500.03	-20,498,363.40
(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)	71,809,432.83	-	3,866,235.49	75,675,668.32
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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)	76,899,344.94	-	3,880,297.59	80,779,642.53
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）	76,899,344.94	-	3,880,297.59	80,779,642.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,386,968.13	-	-11,761,533.81	-22,148,501.94
（一）、综合收益总额	-	-	-13,646,184.68	-13,646,184.68
（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）	-10,386,968.13	-	1,884,650.87	-8,502,317.26
其中：1.基金申购款	13,187,202.07	-	-1,797,187.80	11,390,014.27
2.基金赎回款	-23,574,170.20	-	3,681,838.67	-19,892,331.53
（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）	66,512,376.81	-	-7,881,236.22	58,631,140.59

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:

金川

沈珂

陈若

-----  
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

嘉合磐石混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予嘉合磐石混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2015]1243号文)批准,由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法规和《嘉合磐石混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2015年7月3日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币2,380,564,724.89元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合磐石混合型证券投资基金基金合同》和《嘉合磐石混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、权证等权益类金融工具,以及债券等固定收益类金融工具(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等)以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-40%;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;每个交易日日终保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为一年期人民币定期存款利率(税后)+3%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证

券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况、2023年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

### 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

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推

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》、财税[2017]2号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018年1月1日(含)以后，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，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按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。

(e)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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g)对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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06月30日
活期存款	14,102,920.05
等于：本金	14,101,204.30
加：应计利息	1,715.75
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	14,102,920.05
----	---------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,025,594.89	-	28,701,154.25	11,675,559.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	72,315.62	4,071,915.62	1,470.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	72,315.62	4,071,915.62	1,470.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,023,724.89	72,315.62	32,773,069.87	11,677,029.36

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	24,991,711.50	-
银行间市场	-	-
合计	24,991,711.50	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券



本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	109,253.97
其中：交易所市场	104,865.37
银行间市场	4,388.60
应付利息	-
预提费用	64,466.77
合计	173,734.65

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 嘉合磐石A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合磐石A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,798,986.02	10,798,986.02
本期申购	6,646,835.84	6,646,835.84
本期赎回（以“-”号填列）	-3,260,194.64	-3,260,194.64
本期末	14,185,627.22	14,185,627.22

##### 6.4.7.7.2 嘉合磐石C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合磐石C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	48,602,471.97	48,602,471.97
本期申购	26,667,002.43	26,667,002.43
本期赎回(以“-”号填列)	-17,645,668.79	-17,645,668.79
本期末	57,623,805.61	57,623,805.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

#### 6.4.7.8.1 嘉合磐石A

单位：人民币元

项目 (嘉合磐石A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-227,317.42	-1,550,012.68	-1,777,330.10
本期利润	-383,046.46	3,172,606.14	2,789,559.68
本期基金份额交易产生的变动数	-253,076.20	450,292.18	197,215.98
其中：基金申购款	-469,638.16	736,876.58	267,238.42
基金赎回款	216,561.96	-286,584.40	-70,022.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-863,440.08	2,072,885.64	1,209,445.56

#### 6.4.7.8.2 嘉合磐石C

单位：人民币元

项目 (嘉合磐石C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-2,597,412.28	-6,789,084.82	-9,386,497.10
本期利润	-1,864,916.95	13,243,280.37	11,378,363.42
本期基金份额交易产生的变动数	-936,753.42	1,601,677.03	664,923.61
其中：基金申购款	-2,679,682.57	2,867,083.71	187,401.14

基金赎回款	1,742,929.15	-1,265,406.68	477,522.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,399,082.65	8,055,872.58	2,656,789.93

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	24,140.60	
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	6,233.15	
其他	138.39	
合计	30,512.14	

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 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01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额	120,478,002.90	
减：卖出股票成本总额	123,160,146.78	
减：交易费用	311,605.24	
买卖股票差价收入	-2,993,749.12	

#### 6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	151,666.00
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	705,245.00
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	856,911.00

#### 6.4.7.12.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	324,678,117.78
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	323,015,335.00
减：应计利息总额	952,037.78
减：交易费用	5,500.00
买卖债券差价收入	705,245.00

#### 6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	78,878.09
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	78,878.09

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	16,415,886.51
——股票投资	16,409,966.51
——债券投资	5,920.00
——资产支持证券投资	-
——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	16,415,886.51

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	40,305.58
转换费收入	243.31
合计	40,548.89

注：1、赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费部分按持有期间的增加而递减计入基金财产。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
中债登	9,000.00
上清所	9,000.00
其他费用	600.00
合计	83,066.77

### 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 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

本基金本报告不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。

### 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
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

**6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**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01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	164,539.70	193,236.24
其中：支付销售机构的客户维护费	57,793.26	72,145.55

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.60%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	27,423.29	32,206.08

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的	本期 2023年01月01日至2023年06月30日



各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合磐石A	嘉合磐石C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	26,780.68	26,780.68
平安银行股份有限公司	0.00	1,433.81	1,433.81
合计	0.00	28,214.49	28,214.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合磐石A	嘉合磐石C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	25,356.17	25,356.17
平安银行股份有限公司	0.00	1,111.87	1,111.87
合计	0.00	26,468.04	26,468.04

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% / \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

#### 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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行股份有限公司	14,102,920.05	24,140.60	2,906,185.12	8,104.90

注：本基金通过“平安银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，2023年06月30日的相关余额为人民币1,021,058.08元(2022年06月30日：人民币267,303.41元)。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持

有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### **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**

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2023年06月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### **6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### **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**

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、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。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项

风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的10%。

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并采用券款对付交割方式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**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

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

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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，以保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、权证等权益类工具，以及债券等固定收益类工具，其中固定收益类投资占有较大比例。保证了组合较高的流动性，不易发生变现困难等情况。同时，本基金亦可以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投资的公允价值。

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的15%(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该比例限制), 本基金与由本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, 不超过该上市公司可流通股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

本基金主要投资于交易所市场及银行间市场交易的固定收益证券, 因此存在一定的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过对所持投资品种平均剩余到期年限等参数的监控进行利率风险管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	14,102,920.05	-	-	-	-	-	14,102,920.05
结算备付金	1,021,058.08	-	-	-	-	-	1,021,058.08
存出保证金	27,607.82	-	-	-	-	-	27,607.82
交易性金融资产	4,071,915.62	-	-	-	-	28,701,154.25	32,773,069.87
买入返售金融资产	24,991,711.50	-	-	-	-	-	24,991,711.50
应收清算款	-	-	-	-	-	3,078,212.15	3,078,212.15
应收申购款	-	-	-	-	-	279,555.57	279,555.57
资产总计	44,215,213.07	-	-	-	-	32,058,921.97	76,274,135.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	366,967.23	366,967.23

回款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,029.61	34,029.61
应付托管费	-	-	-	-	-	5,671.60	5,671.60
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,063.63	18,063.63
其他负债	-	-	-	-	-	173,734.65	173,734.65
负债总计	-	-	-	-	-	598,466.72	598,466.72
利率敏感度缺口	44,215,213.07	-	-	-	-	31,460,455.25	75,675,668.32
上年度末 2022年 12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,466,034.85	-	-	-	-	-	26,466,034.85
结算备付金	794,906.85	-	-	-	-	-	794,906.85
存出保证金	14,925.10	-	-	-	-	-	14,925.10
交易性金融资产	3,111,639.25	-	-	-	-	18,282,038.40	21,393,677.65
应收申购款	-	-	-	-	-	7,645.88	7,645.88
资产总计	30,387,506.05	-	-	-	-	18,289,684.28	48,677,190.33
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	184,558.51	184,558.51
应付赎回款	-	-	-	-	-	69,082.13	69,082.13
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	25,622.08	25,622.08
应付托管费	-	-	-	-	-	4,270.35	4,270.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,914.32	13,914.32
其他负债	-	-	-	-	-	142,112.15	142,112.15
负债总计	-	-	-	-	-	439,559.54	439,559.54
利率敏	30,387,506.05	-	-	-	-	17,850,124.74	48,237,630.79

敏感度缺口							
-------	--	--	--	--	--	--	--

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、若市场利率平行上升或下降25个基点 2、其他市场变量保持不变 3、基金净值已按照影子价格进行调整		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率平行下降25个基点	464.95	271.42
	市场利率平行上升25个基点	-464.95	-271.42

#### 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，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

##### 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 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净



		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	28,701,154.25	37.93	18,282,038.40	37.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,071,915.62	5.38	3,111,639.25	6.45
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	32,773,069.87	43.31	21,393,677.65	44.35

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感度分析基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	敏感度分析基准上升5%	1,967,495.05	1,216,558.68
	敏感度分析基准下降5%	-1,967,495.05	-1,216,558.68

本基金根据持仓类别情况选用“中债全价指数\*60%+沪深300指数\*40%”作为市场价格波动风险的敏感度分析基准。

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	28,701,154.25	18,282,038.40
第二层次	4,071,915.62	3,111,639.25
第三层次	-	-
合计	32,773,069.87	21,393,677.65

##### 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。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022年12月31日：无)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

其他金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	28,701,154.25	37.63
	其中：股票	28,701,154.25	37.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,071,915.62	5.34
	其中：债券	4,071,915.62	5.34
	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	24,991,711.50	32.77
	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	15,123,978.13	19.83
8	其他各项资产	3,385,375.54	4.44
9	合计	76,274,135.04	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	18,220,536.75	24.08
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	8,101,671.50	10.71
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,378,946.00	3.14
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	28,701,154.25	37.93

### 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	300308	中际旭创	36,300	5,352,435.00	7.07
2	300502	新易盛	63,980	4,348,720.60	5.75
3	300394	天孚通信	37,500	4,006,125.00	5.29
4	300624	万兴科技	30,400	3,561,360.00	4.71
5	688662	富信科技	45,065	2,681,818.15	3.54
6	300678	中科信息	49,650	2,482,003.50	3.28
7	300280	紫天科技	49,800	2,378,946.00	3.14
8	300418	昆仑万维	51,100	2,058,308.00	2.72
9	603738	泰晶科技	75,200	1,249,072.00	1.65
10	002902	铭普光磁	18,600	582,366.00	0.77

### 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	688662	富信科技	6,973,751.78	14.46
2	688088	虹软科技	4,415,764.02	9.15
3	301205	联特科技	4,395,112.00	9.11

4	301052	果麦文化	3,495,481.00	7.25
5	300418	昆仑万维	3,350,762.00	6.95
6	301236	软通动力	2,856,766.85	5.92
7	688095	福昕软件	2,570,708.32	5.33
8	603019	中科曙光	2,553,206.00	5.29
9	002292	奥飞娱乐	2,461,053.00	5.10
10	688158	优刻得	2,400,127.42	4.98
11	688498	源杰科技	2,240,040.07	4.64
12	300280	紫天科技	2,181,848.00	4.52
13	300620	光库科技	2,075,278.00	4.30
14	688039	当虹科技	1,982,931.39	4.11
15	601858	中国科传	1,973,812.00	4.09
16	600229	城市传媒	1,910,471.00	3.96
17	300459	汤姆猫	1,888,026.00	3.91
18	301270	汉仪股份	1,831,384.00	3.80
19	688316	青云科技	1,774,707.89	3.68
20	300684	中石科技	1,730,983.00	3.59
21	002153	石基信息	1,709,990.00	3.54
22	300528	幸福蓝海	1,694,858.00	3.51
23	300250	初灵信息	1,690,473.00	3.50
24	603496	恒为科技	1,675,467.00	3.47
25	688515	裕太微	1,667,741.93	3.46
26	688343	云天励飞	1,646,816.44	3.41
27	002291	遥望科技	1,576,652.00	3.27
28	300678	中科信息	1,575,417.00	3.27
29	688416	恒烁股份	1,571,304.97	3.26
30	300502	新易盛	1,532,055.00	3.18
31	300738	奥飞数据	1,508,247.00	3.13
32	300308	中际旭创	1,506,591.00	3.12
33	688619	罗普特	1,505,254.15	3.12
34	000681	视觉中国	1,486,141.00	3.08

35	002354	天娱数科	1,473,737.00	3.06
36	300369	绿盟科技	1,472,224.00	3.05
37	688376	美埃科技	1,461,237.64	3.03
38	688313	仕佳光子	1,446,174.00	3.00
39	300578	会畅通讯	1,441,157.00	2.99
40	000032	深桑达 A	1,441,079.00	2.99
41	301069	凯盛新材	1,438,419.00	2.98
42	603533	掌阅科技	1,436,819.00	2.98
43	300624	万兴科技	1,435,370.00	2.98
44	300394	天孚通信	1,425,230.00	2.95
45	002792	通宇通讯	1,418,252.00	2.94
46	002281	光迅科技	1,386,811.00	2.87
47	300634	彩讯股份	1,385,811.00	2.87
48	688207	格灵深瞳	1,375,654.09	2.85
49	002045	国光电器	1,341,198.00	2.78
50	301313	凡拓数创	1,336,791.00	2.77
51	688686	奥普特	1,327,258.87	2.75
52	688322	奥比中光	1,287,492.55	2.67
53	603738	泰晶科技	1,249,850.44	2.59
54	600105	永鼎股份	1,225,703.00	2.54
55	300231	银信科技	1,196,496.90	2.48
56	301169	零点有数	1,196,458.00	2.48
57	688292	浩瀚深度	1,167,613.62	2.42

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	301205	联特科技	5,535,695.00	11.48
2	688662	富信科技	4,719,547.06	9.78
3	688088	虹软科技	4,209,383.40	8.73
4	301052	果麦文化	3,449,516.00	7.15
5	002466	天齐锂业	2,956,103.00	6.13
6	603019	中科曙光	2,735,355.00	5.67
7	301236	软通动力	2,703,667.84	5.60
8	688158	优刻得	2,558,844.41	5.30
9	002460	赣锋锂业	2,454,080.00	5.09
10	688095	福昕软件	2,356,011.16	4.88
11	300620	光库科技	2,353,680.00	4.88
12	002292	奥飞娱乐	2,318,229.00	4.81
13	688416	恒烁股份	2,226,632.16	4.62
14	688498	源杰科技	2,199,765.90	4.56
15	002738	中矿资源	2,145,501.60	4.45
16	600229	城市传媒	1,871,169.00	3.88
17	300684	中石科技	1,799,369.00	3.73
18	301270	汉仪股份	1,794,872.00	3.72
19	688039	当虹科技	1,791,250.72	3.71
20	600338	西藏珠峰	1,739,948.00	3.61
21	300738	奥飞数据	1,709,630.00	3.54
22	601858	中国科传	1,678,740.00	3.48
23	002756	永兴材料	1,672,518.00	3.47
24	603496	恒为科技	1,637,709.00	3.40
25	002153	石基信息	1,631,850.00	3.38
26	002354	天娱数科	1,618,810.00	3.36
27	688316	青云科技	1,608,142.23	3.33
28	002192	融捷股份	1,577,526.00	3.27
29	000032	深桑达 A	1,565,952.00	3.25
30	002240	盛新锂能	1,554,035.00	3.22
31	300528	幸福蓝海	1,547,734.00	3.21

32	000408	藏格矿业	1,540,655.00	3.19
33	002176	江特电机	1,536,965.00	3.19
34	300578	会畅通讯	1,530,964.00	3.17
35	301313	凡拓数创	1,486,375.39	3.08
36	000762	西藏矿业	1,485,617.83	3.08
37	688313	仕佳光子	1,475,329.84	3.06
38	002045	国光电器	1,465,200.00	3.04
39	300459	汤姆猫	1,465,100.00	3.04
40	688515	裕太微	1,463,516.80	3.03
41	002281	光迅科技	1,460,836.00	3.03
42	300250	初灵信息	1,457,767.00	3.02
43	300369	绿盟科技	1,451,187.00	3.01
44	688376	美埃科技	1,445,235.31	3.00
45	002497	雅化集团	1,432,655.00	2.97
46	688619	罗普特	1,417,220.63	2.94
47	000681	视觉中国	1,409,812.00	2.92
48	688207	格灵深瞳	1,375,493.22	2.85
49	002792	通宇通讯	1,363,589.00	2.83
50	301069	凯盛新材	1,338,038.00	2.77
51	300634	彩讯股份	1,321,318.00	2.74
52	603533	掌阅科技	1,314,578.00	2.73
53	688686	奥普特	1,299,347.18	2.69
54	002291	遥望科技	1,283,700.00	2.66
55	688322	奥比中光	1,257,165.28	2.61
56	600105	永鼎股份	1,248,197.00	2.59
57	301169	零点有数	1,244,770.00	2.58
58	688343	云天励飞	1,190,834.54	2.47
59	300231	银信科技	1,179,580.00	2.45
60	688292	浩瀚深度	1,085,862.19	2.25
61	688195	腾景科技	1,054,888.14	2.19



注：1、卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	117,169,296.12
卖出股票收入（成交）总额	120,478,002.90

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票，卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、"买入股票成本（成交）总额"、"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（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	4,071,915.62	5.38
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,071,915.62	5.38

### 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	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净
---	------	------	-------	------	--------

号					值比例(%)
1	019679	22国债14	40,000	4,071,915.62	5.38

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

股指期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 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	27,607.82
2	应收清算款	3,078,212.15
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	279,555.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,385,375.54

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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
嘉合磐石A	862	16,456.64	882.41	0.01%	14,184,744.81	99.99%
嘉合磐石C	3,167	18,195.08	4,841,078.89	8.40%	52,782,726.72	91.60%
合计	4,029	17,823.14	4,841,961.30	6.74%	66,967,471.53	93.26%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

**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	嘉合磐石A	19,552.44	0.14%
	嘉合磐石C	582,237.03	1.01%
	合计	601,789.47	0.84%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	嘉合磐石A	0~10
	嘉合磐石C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基 金	嘉合磐石A	-
	嘉合磐石C	50~100
	合计	50~100

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间,持有本基金C份额总量在 50~100 万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金A份额，持有本基金C份额总量在50~100 万份(含)之间。

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

	嘉合磐石A	嘉合磐石C
基金合同生效日(2015年07月03日)基金份额总额	2,376,035,633.97	4,529,090.92
本报告期期初基金份额总额	10,798,986.02	48,602,471.97
本报告期基金总申购份额	6,646,835.84	26,667,002.43
减：本报告期基金总赎回份额	3,260,194.64	17,645,668.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,185,627.22	57,623,805.61

注：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

本报告期内本基金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

本报告期内，基金管理人发生以下重大人事变动：

自2023年3月6日起，金川先生代任公司董事长职务，周健男先生不再担任公司董事长职务。

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

本报告期内，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

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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到稽查或处罚等情况。

### 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	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	佣金	占当期佣金总	

	元数量		交总额的 的比例		量的比 例	
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	136,679,943.41	57.51%	98,586.82	57.18%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	100,967,355.61	42.49%	73,836.93	42.82%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

2、本基金本报告期内无租用交易单元变更情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	4,041,035.20	100.00%	1,008,500,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-	-	-

投								
中信证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2022年第四季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2023-01-20
2	嘉合磐石混合型证券投资基金2022年第四季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（董事长）变更的公告	《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-07
4	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2023-03-31
5	嘉合磐石混合型证券投资基金2022年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	嘉合基金管理有限公司旗下基金2023年第一季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2023-04-24
7	嘉合磐石混合型证券投资基金2023年第一季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
8	嘉合基金管理有限公司关于终止旗下基金在江西正融基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额

类别		超过 20%的时间区间					
个人	1	20230101 - 20230630	14,775,173.17	-	-	14,775,173.17	20.58%
产品特有风险							
<p>报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请,可能带来流动性风险;如个别投资者大额赎回引发巨额赎回,基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请,可能影响投资者赎回业务办理;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形;持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予嘉合磐石混合型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合磐石混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合磐石混合型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后,可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站(www.haoamc.com)进行查阅。

嘉合基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日