

# 嘉实价值成长混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
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	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	41

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 .....	41
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 .....	42
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 .....	42
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 .....	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	42
7.12 投资组合报告附注 .....	42
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	43
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 .....	43
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>43</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>44</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	44
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 .....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	44
10.4 基金投资策略的改变 .....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	44
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 .....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
10.8 其他重大事件 .....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
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 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	52
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实价值成长混合型证券投资基金
基金简称	嘉实价值成长混合
基金主代码	007895
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年9月10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	710,943,354.73份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金采用 GARP 策略（价值成长投资策略）选择股票，即以合理价格买入长期优质潜力成长股，选择的投资标的更看重公司质地的优秀、业绩能够保持长期稳定增长预期以及股票估值合理，选择股票强调成长性与合理估值的动态平衡，在追求成长性的同时避免投资标的估值过高的风险。具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×75% +中债综合财富指数收益率×25%
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。本基金将投资港股通标的股票，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
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	廖林

## 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	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	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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-13,872,195.27
本期利润	-7,967,967.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0127
本期加权平均净值利润率	-1.41%
本期基金份额净值增长率	-0.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-86,207,730.26
期末可供分配基金份额利润	-0.1213
期末基金资产净值	638,113,739.05
期末基金份额净值	0.8976
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-10.24%

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	-3.95%	0.64%	-2.97%	0.42%	-0.98%	0.22%

过去三个月	-0.69%	0.80%	-2.00%	0.62%	1.31%	0.18%
过去六个月	-0.59%	0.99%	-0.29%	0.77%	-0.30%	0.22%
过去一年	-16.60%	0.95%	-7.61%	0.70%	-8.99%	0.25%
过去三年	-51.62%	1.22%	-22.12%	0.78%	-29.50%	0.44%
自基金合同生效起至今	-10.24%	1.32%	-2.42%	0.85%	-7.82%	0.47%

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：

$$\text{Return}(t) = 75\% * (\text{中证800指数}(t) / \text{中证800指数}(t-1) - 1) + 25\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$$

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

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

嘉实价值成长混合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

(2019年09月10日至2024年06月30日)



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

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截止2024年6月30日，基金管理人共管理351只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪流	本基金、嘉实策略混合、嘉实多元债券、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实阿尔法优选混合、嘉实品质优选股票、嘉实兴锐优选一年持有期混合、嘉实欣荣混合（LOF）基金经理	2019年9月10日	-	25年	曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019年2月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海GARP投资策略组投资总监。现任平衡风格投资总监。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。

## 4.2 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、《嘉实价值成长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 9 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾上半年，A 股和港股震荡探底，中证 800 指数下跌 1.76%，恒生指数上涨 3.94%。单季度表现看，中证 800 指数一季度上涨 1.56%，二季度冲高回落，下跌 3.27%，恒生指数一季度下跌 2.97%，二季度上涨 7.12%。两大市场的调整与分化主要受到以下几个因素影响：第一，美国经济在一季度表现强势，二季度后期数据表现逐步走向平淡，美联储降息预期从紧向松演化；第二，国内货币政策在一季度较为宽松，二季度末央行逐步加大对长期国债的干预，货币政策边际走平；第三，A 股市场映射“去地产化”的国内经济基本面，港股市场对“美元降息”、大市值互联网公司持续回购和央企红利资产进行定价。

操作层面，2024 上半年股票仓位稳中有升，持仓结构在行业上相对分散，个股占组合比重适度集中。行业配置上，本基金在食品饮料、港股互联网保持较高的配置比重，维持通信行业龙头的配置，维持有色金属（铜和金）的行业配置，增加了家电行业龙头公司的配置。

#### 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 0.8976 元；本报告期基金份额净值增长率为-0.59%，业绩比较基准收益率为-0.29%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，“去地产化”的宏观经济转型稳步推进，以“出海”为代表的中国先进制造业竞争力稳步提升，以“出行”为代表的中低端消费的韧性仍在。经济稳定在合理区间有利于竞争性行业的“优胜劣汰”，强者恒强。企业盈利逐步向优质龙头企业集中或许是国内产业未来运行的重要特点。

“新国九条”对中国资本市场的影响是中长期的，“退市机制”、“分红制度”的逐步落地有利于股票市场形成坚实的价值底部区域。A 股和港股市场演进为“重回报、轻融资”的治理结构，关注和给与投资者回报的资本市场必将吸引中长期海内外增量资金导入。长期视角看，中国资本市场正站在推动经济转型和可持续发展的关键位置，本基金管理人对资本市场长期保持乐观。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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合规守信、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的真实、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 2024 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：嘉实价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,081,899.88	9,974,651.16
结算备付金		2,216,049.49	4,717,234.91
存出保证金		123,206.78	111,444.56
交易性金融资产	6.4.7.2	633,548,321.36	530,906,418.40
其中：股票投资		599,180,841.31	498,628,067.72
基金投资		-	-
债券投资		34,367,480.05	32,278,350.68
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		3,049,943.68	614,850.52
应收股利		1,638,572.40	-

应收申购款		17,797.35	34,994.60
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		644,675,790.94	546,359,594.15
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,673,212.75	2,533,505.71
应付赎回款		273,753.74	601,542.39
应付管理人报酬		644,065.87	553,449.99
应付托管费		107,344.30	92,241.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	83.84
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	863,675.23	764,649.08
负债合计		6,562,051.89	4,545,472.68
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	710,943,354.73	600,109,463.64
未分配利润	6.4.7.12	-72,829,615.68	-58,295,342.17
净资产合计		638,113,739.05	541,814,121.47
负债和净资产总计		644,675,790.94	546,359,594.15

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8976 元，基金份额总额 710,943,354.73 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-3,947,428.75	-31,236,507.43
1. 利息收入		39,963.59	64,588.53
其中：存款利息收入	6.4.7.13	39,963.59	64,588.53
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-9,894,911.44	-50,402,758.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-16,831,238.22	-55,744,654.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-656,421.01	268,288.91
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	7,592,747.79	5,073,607.33
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	5,904,228.26	18,919,952.93
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	3,290.84	181,709.66
<b>减：二、营业总支出</b>		4,020,538.26	6,250,433.33
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,355,341.65	5,251,875.54
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	559,223.60	875,312.63
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		7.30	23.58
8. 其他费用	6.4.7.23	105,965.71	123,221.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-7,967,967.01	-37,486,940.76
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-7,967,967.01	-37,486,940.76
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-7,967,967.01	-37,486,940.76

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	600,109,463.64	-	-58,295,342.17	541,814,121.47
二、本期期初净资产	600,109,463.64	-	-58,295,342.17	541,814,121.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	110,833,891.09	-	-14,534,273.51	96,299,617.58
(一)、综合收益总额	-	-	-7,967,967.01	-7,967,967.01
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	110,833,891.09	-	-6,566,306.50	104,267,584.59
其中：1. 基金申购款	130,193,866.31	-	-8,684,843.15	121,509,023.16
2. 基金赎回款	-19,359,975.22	-	2,118,536.65	-17,241,438.57
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	710,943,354.73	-	-72,829,615.68	638,113,739.05
项目	上年度可比期间 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	595,131,661.12	-	78,356,626.40	673,488,287.52
二、本期期初净资产	595,131,661.12	-	78,356,626.40	673,488,287.52
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,052,653.31	-	-36,488,409.00	-82,541,062.31
(一)、综合收益总额	-	-	-37,486,940.76	-37,486,940.76

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-46,052,653.31	-	998,531.76	-45,054,121.55
其中：1. 基金申购款	94,858,346.38	-	19,025,404.00	113,883,750.38
2. 基金赎回款	-140,910,999.69	-	-18,026,872.24	-158,937,871.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	549,079,007.81	-	41,868,217.40	590,947,225.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

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

嘉实价值成长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”)证监许可[2019]1507号《关于准予嘉实价值成长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依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》于2019年9月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,714,783,260.20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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 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》、《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关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。

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

(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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	4,081,899.88
等于：本金	4,081,367.99
加：应计利息	531.89
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	4,081,899.88

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	610,677,219.23	-	599,180,841.31	-11,496,377.92	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	33,964,532.00	356,660.05	34,367,480.05	46,288.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	33,964,532.00	356,660.05	34,367,480.05	46,288.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	644,641,751.23	356,660.05	633,548,321.36	-11,450,089.92	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.25

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	774,167.38
其中：交易所市场	774,167.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	863,675.23

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	600,109,463.64	600,109,463.64
本期申购	130,193,866.31	130,193,866.31
本期赎回（以“-”号填列）	-19,359,975.22	-19,359,975.22
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	710,943,354.73	710,943,354.73

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	-58,164,683.37	-130,658.80	-58,295,342.17
本期期初	-58,164,683.37	-130,658.80	-58,295,342.17
本期利润	-13,872,195.27	5,904,228.26	-7,967,967.01
本期基金份额交易产生的变动数	-14,170,851.62	7,604,545.12	-6,566,306.50
其中：基金申购款	-16,659,324.08	7,974,480.93	-8,684,843.15
基金赎回款	2,488,472.46	-369,935.81	2,118,536.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-86,207,730.26	13,378,114.58	-72,829,615.68

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

活期存款利息收入	26,207.31
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	12,878.78
其他	877.50
合计	39,963.59

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,831,238.22
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	-16,831,238.22

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	941,557,969.60
减：卖出股票成本总额	955,936,711.95
减：交易费用	2,452,495.87
买卖股票差价收入	-16,831,238.22

##### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	230,239.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-886,660.31
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	-656,421.01

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	32,090,202.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,372,160.06
减：应计利息总额	604,597.95
减：交易费用	104.49
买卖债券差价收入	-886,660.31

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,592,747.79
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	7,592,747.79

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	5,904,228.26
股票投资	5,216,569.20
债券投资	687,659.06
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	5,904,228.26

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	3,049.48
基金转出费收入	241.36
合计	3,290.84

## 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	1,967.83
债券托管账户维护费	9,000.00
深港通证券组合费	5,490.28
合计	105,965.71

## 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,355,341.65	5,251,875.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	853,735.74	1,540,704.51
应支付基金管理人的净管理费	2,501,605.91	3,711,171.03

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 1.20%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×1.20%/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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	559,223.60	875,312.63

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

## 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	4,081,899.88	26,207.31	13,165,537.19	46,144.29

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

本期（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

## 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为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。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。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**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	34,367,480.05	29,431,154.96
合计	34,367,480.05	29,431,154.96

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	2,847,195.72
未评级	-	-
合计	-	2,847,195.72

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。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约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、流通受限制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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	4,081,899.88	-	-	-	4,081,899.88
结算备付金	2,216,049.49	-	-	-	2,216,049.49
存出保证金	123,206.78	-	-	-	123,206.78
交易性金融资产	34,367,480.05	-	-	-599,180,841.31	633,548,321.36
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	3,049,943.68	3,049,943.68
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	1,638,572.40	1,638,572.40
应收申购款	-	-	-	17,797.35	17,797.35
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	40,788,636.20	-	-	-603,887,154.74	644,675,790.94
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	-	-	-	4,673,212.75	4,673,212.75
应付赎回款	-	-	-	273,753.74	273,753.74
应付管理人报酬	-	-	-	644,065.87	644,065.87
应付托管费	-	-	-	107,344.30	107,344.30
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	-	-	-	863,675.23	863,675.23
负债总计	-	-	-	-6,562,051.89	6,562,051.89
利率敏感度缺口	40,788,636.20	-	-	-597,325,102.85	638,113,739.05
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,974,651.16	-	-	-	9,974,651.16
结算备付金	4,717,234.91	-	-	-	4,717,234.91
存出保证金	111,444.56	-	-	-	111,444.56
交易性金融资产	29,431,154.96	2,847,195.72	-	-498,628,067.72	530,906,418.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	614,850.52	614,850.52
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	34,994.60	34,994.60
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-
资产总计	44,234,485.59	2,847,195.72	-499,277,912.84	546,359,594.15
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	-	-	2,533,505.71	2,533,505.71
应付赎回款	-	-	601,542.39	601,542.39
应付管理人报酬	-	-	553,449.99	553,449.99
应付托管费	-	-	92,241.67	92,241.67
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应交税费	-	-	83.84	83.84
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	764,649.08	764,649.08
负债总计	-	-	4,545,472.68	4,545,472.68
利率敏感度缺口	44,234,485.59	2,847,195.72	-494,732,440.16	541,814,121.47

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-31,184.50	-24,422.50
市场利率下降25个基点	31,297.40	24,580.89	

#### 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，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	164,404,967.43	-	164,404,967.43
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	-	164,404,967.43	-	164,404,967.43
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 汇风险敞口净额	-	164,404,967.43	-	164,404,967.43



项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	119,217,454.94	-	119,217,454.94
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	-	119,217,454.94	-	119,217,454.94
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	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	119,217,454.94	-	119,217,454.94

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	8,220,248.37	5,960,872.75
所有外币相对人民币贬值 5%	-8,220,248.37	-5,960,872.75	

## 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	599,180,841.31	93.90	498,628,067.72	92.03
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	599,180,841.31	93.90	498,628,067.72	92.03

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	35,768,480.82	35,472,701.77
业绩比较基准下降5%	-35,768,480.82	-35,472,701.77	

## 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	599,180,841.31	488,709,916.50
第二层次	34,367,480.05	29,431,154.96
第三层次	-	12,765,346.94
合计	633,548,321.36	530,906,418.40

## 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	599,180,841.31	92.94
	其中：股票	599,180,841.31	92.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,367,480.05	5.33
	其中：债券	34,367,480.05	5.33
	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	6,297,949.37	0.98
8	其他各项资产	4,829,520.21	0.75
9	合计	644,675,790.94	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 164,404,967.43 元，占基金资产净值的比例为 25.76%。

### 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	73,666,961.23	11.54
C	制造业	293,906,203.65	46.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,173,964.00	4.57
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	19,992,640.00	3.13
J	金融业	11,709,942.00	1.84
K	房地产业	6,326,163.00	0.99
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	434,775,873.88	68.13

### 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	45,953,584.03	7.20
非必需消费品	23,118,914.54	3.62
必需消费品	-	-
能源	20,875,254.13	3.27
金融	6,427,558.02	1.01
医疗保健	13,365,149.02	2.09
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	54,664,507.69	8.57
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	164,404,967.43	25.76

### 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	600519	贵州茅台	30,800	45,195,612.00	7.08

2	601899	紫金矿业	2,428,756	42,673,242.92	6.69
3	941 HK	中国移动	311,000	21,855,947.96	3.43
3	600941	中国移动	108,700	11,685,250.00	1.83
4	1818 HK	招金矿业	2,195,500	26,249,635.11	4.11
5	000333	美的集团	385,250	24,848,625.00	3.89
6	700 HK	腾讯控股	70,900	24,097,636.07	3.78
7	3690 HK	美团-W	228,000	23,118,914.54	3.62
8	600690	海尔智家	775,700	22,014,366.00	3.45
9	600989	宝丰能源	1,254,200	21,735,286.00	3.41
10	600809	山西汾酒	101,500	21,404,320.00	3.35
11	300750	宁德时代	100,780	18,143,423.40	2.84
12	002422	科伦药业	522,500	15,847,425.00	2.48
13	1787 HK	山东黄金	1,008,250	14,300,057.34	2.24
14	3993 HK	洛阳钼业	2,166,000	14,114,815.24	2.21
15	600021	上海电力	1,398,500	13,831,165.00	2.17
16	000858	五粮液	101,800	13,034,472.00	2.04
17	601918	新集能源	1,301,900	12,693,525.00	1.99
18	603979	金诚信	249,327	12,598,493.31	1.97
19	000425	徐工机械	1,737,000	12,419,550.00	1.95
20	1171 HK	兖矿能源	1,093,400	11,136,835.32	1.75
21	688122	西部超导	283,255	10,854,331.60	1.70
22	600160	巨化股份	439,200	10,597,896.00	1.66
23	002444	巨星科技	400,202	9,884,989.40	1.55
24	000883	湖北能源	1,410,100	8,474,701.00	1.33
25	601166	兴业银行	477,500	8,413,550.00	1.32
26	688111	金山办公	36,516	8,307,390.00	1.30
27	300274	阳光电源	117,800	7,307,134.00	1.15
28	883 HK	中国海洋石油	337,000	6,889,638.78	1.08
29	603393	新天然气	197,700	6,868,098.00	1.08
30	1801 HK	信达生物	202,000	6,784,498.05	1.06
31	600388	龙净环保	573,405	6,657,232.05	1.04
32	300855	图南股份	251,400	6,647,016.00	1.04
33	9926 HK	康方生物	191,000	6,580,650.97	1.03
34	600420	国药现代	599,940	6,407,359.20	1.00
35	001979	招商蛇口	719,700	6,326,163.00	0.99
36	000403	派林生物	236,000	6,291,760.00	0.99
37	600256	广汇能源	851,000	5,701,700.00	0.89
38	300054	鼎龙股份	248,900	5,645,052.00	0.88
39	601689	拓普集团	96,300	5,162,643.00	0.81
40	300395	菲利华	146,300	4,498,725.00	0.71
41	002463	沪电股份	122,380	4,466,870.00	0.70
42	002353	杰瑞股份	102,600	3,599,208.00	0.56
43	603379	三美股份	90,600	3,546,084.00	0.56

44	601058	赛轮轮胎	246,700	3,453,800.00	0.54
45	601318	中国平安	79,700	3,296,392.00	0.52
46	1288 HK	农业银行	1,079,000	3,289,170.94	0.52
47	3968 HK	招商银行	97,000	3,138,387.08	0.49
48	603338	浙江鼎力	42,400	2,561,808.00	0.40
49	1088 HK	中国神华	64,500	2,116,299.57	0.33
50	603195	公牛集团	21,800	1,681,216.00	0.26
51	1898 HK	中煤能源	88,000	732,480.46	0.11

## 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	3690 HK	美团-W	32,789,359.89	6.05
2	600809	山西汾酒	31,324,752.44	5.78
3	700 HK	腾讯控股	30,680,429.80	5.66
4	1818 HK	招金矿业	28,076,824.31	5.18
5	1801 HK	信达生物	28,031,755.09	5.17
6	1171 HK	兖矿能源	14,155,597.19	2.61
6	600188	兖矿能源	12,064,494.00	2.23
7	1787 HK	山东黄金	16,780,907.92	3.10
7	600547	山东黄金	9,262,877.00	1.71
8	000333	美的集团	25,710,862.00	4.75
9	600519	贵州茅台	23,124,612.00	4.27
10	600690	海尔智家	22,071,405.00	4.07
11	300750	宁德时代	22,062,351.10	4.07
12	3993 HK	洛阳钼业	17,019,485.71	3.14
12	603993	洛阳钼业	4,178,603.00	0.77
13	600941	中国移动	12,615,433.14	2.33
13	941 HK	中国移动	8,574,860.99	1.58
14	600989	宝丰能源	20,818,573.00	3.84
15	601899	紫金矿业	20,215,903.00	3.73
16	600160	巨化股份	17,461,899.00	3.22
17	600489	中金黄金	17,316,051.06	3.20
18	603979	金诚信	16,638,492.17	3.07
19	002422	科伦药业	16,457,548.00	3.04
20	688008	澜起科技	15,927,876.51	2.94
21	000596	古井贡酒	15,741,692.64	2.91
22	000425	徐工机械	14,967,238.00	2.76
23	600985	淮北矿业	14,586,417.61	2.69
24	600021	上海电力	14,446,517.00	2.67
25	300274	阳光电源	14,416,540.02	2.66
26	688111	金山办公	14,383,726.53	2.65

27	1898 HK	中煤能源	11,842,666.74	2.19
27	601898	中煤能源	2,531,213.81	0.47
28	600276	恒瑞医药	14,039,243.40	2.59
29	688122	西部超导	13,908,937.21	2.57
30	300395	菲利华	13,321,359.00	2.46
31	600988	赤峰黄金	13,169,934.00	2.43
32	601058	赛轮轮胎	13,038,447.00	2.41
33	601918	新集能源	12,800,795.00	2.36
34	603379	三美股份	12,608,503.40	2.33
35	000858	五粮液	12,192,215.00	2.25
36	002156	通富微电	12,026,743.00	2.22
37	1088 HK	中国神华	10,954,924.77	2.02
37	601088	中国神华	829,998.00	0.15
38	001979	招商蛇口	11,771,380.00	2.17
39	600256	广汇能源	11,726,313.00	2.16
40	300855	图南股份	11,699,379.80	2.16

#### 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	601088	中国神华	28,467,742.92	5.25
1	1088 HK	中国神华	20,593,610.48	3.80
2	700 HK	腾讯控股	31,874,243.08	5.88
3	1171 HK	兖矿能源	19,146,859.35	3.53
3	600188	兖矿能源	11,682,212.00	2.16
4	1801 HK	信达生物	29,075,248.22	5.37
5	600276	恒瑞医药	27,920,565.00	5.15
6	600388	龙净环保	24,271,995.60	4.48
7	168 HK	青岛啤酒股份	21,167,365.48	3.91
8	600489	中金黄金	20,173,853.50	3.72
9	857 HK	中国石油股份	18,549,249.81	3.42
9	601857	中国石油	1,475,904.00	0.27
10	300316	晶盛机电	19,642,790.84	3.63
11	600519	贵州茅台	19,145,330.00	3.53
12	688111	金山办公	18,817,446.99	3.47
13	600426	华鲁恒升	17,217,448.85	3.18
14	300750	宁德时代	16,762,374.00	3.09
15	601899	紫金矿业	15,480,047.20	2.86
16	000596	古井贡酒	15,454,484.00	2.85
17	002236	大华股份	15,366,300.37	2.84
18	688008	澜起科技	15,292,424.70	2.82
19	1898 HK	中煤能源	12,509,860.97	2.31
19	601898	中煤能源	2,600,430.00	0.48



20	600985	淮北矿业	15,076,409.00	2.78
21	002465	海格通信	15,033,756.00	2.77
22	600547	山东黄金	12,379,948.32	2.28
22	1787 HK	山东黄金	2,113,632.56	0.39
23	600988	赤峰黄金	14,266,052.00	2.63
24	002156	通富微电	13,396,657.00	2.47
25	000858	五粮液	12,962,394.00	2.39
26	3690 HK	美团-W	12,913,052.55	2.38
27	941 HK	中国移动	10,650,049.28	1.97
27	600941	中国移动	1,909,941.00	0.35
28	300054	鼎龙股份	12,547,334.00	2.32
29	600079	人福医药	12,451,899.85	2.30
30	600160	巨化股份	12,302,180.00	2.27
31	000426	兴业银锡	11,952,854.82	2.21
32	002472	双环传动	11,063,235.00	2.04

#### 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	1,051,272,916.34
卖出股票收入（成交）总额	941,557,969.60

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	34,367,480.05	5.39
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	34,367,480.05	5.39

#### 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	019709	23 国债 16	206,000	20,921,670.41	3.28
2	019740	24 国债 09	134,000	13,445,809.64	2.11

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 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	123,206.78
2	应收清算款	3,049,943.68
3	应收股利	1,638,572.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	17,797.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,829,520.21

## 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

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 (%)
17,351	40,974.20	284,247,438.10	39.98	426,695,916.63	60.02

## 8.2 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	4,302,320.32	0.61

## 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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2019 年 9 月 10 日) 基金份额总额	2,714,783,260.20
本报告期期初基金份额总额	600,109,463.64
本报告期基金总申购份额	130,193,866.31
减：本报告期基金总赎回份额	19,359,975.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	710,943,354.73

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内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 (%)	
开源证券股份有限公司	3	305,280,453.88	15.32	209,138.71	15.30	-
华泰证券	3	280,335,512.	14.07	191,117.64	13.98	-

股份有限 公司		18				
海通证券 股份有限 公司	3	261,981,231. 68	13.15	183,387.19	13.42	-
广发证券 股份有限 公司	5	213,837,944. 01	10.73	141,329.09	10.34	-
国泰君安 证券股份 有限公司	3	164,308,018. 21	8.24	115,016.11	8.41	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	137,632,373. 27	6.91	96,342.69	7.05	-
招商证券 股份有限 公司	2	130,035,041. 18	6.53	91,024.85	6.66	-
浙商证券 股份有限 公司	2	103,490,849. 03	5.19	66,843.58	4.89	-
民生证券 股份有限 公司	1	100,565,413. 61	5.05	70,395.77	5.15	-
国盛证券 有限责任 公司	4	77,165,681.9 5	3.87	51,054.61	3.73	-
国信证券 股份有限 公司	2	66,509,649.7 1	3.34	46,557.50	3.41	-
中信证券 股份有限 公司	5	62,417,143.2 7	3.13	43,692.04	3.20	-
中国国际 金融股份 有限公司	2	37,806,425.6 6	1.90	26,464.92	1.94	-
华源证券 股份有限 公司	2	20,858,341.8 9	1.05	13,472.24	0.99	-
长江证券 股份有限 公司	2	19,819,376.4 4	0.99	13,873.18	1.01	-
天风证券 股份有限 公司	4	4,762,702.15	0.24	3,076.42	0.23	-

国联证券股份有限公司	2	3,510,599.82	0.18	2,457.48	0.18	-
中国银河证券股份有限公司	1	2,514,128.00	0.13	1,759.89	0.13	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

公司						
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	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. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中国中金财富证券有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：天风证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 1 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(%)
开源证	1,715,946.3	4.69	-	-	-	-

券股份 有限公司	8						
华泰证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
广发证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	164,557.88	0.45	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	168,172.09	0.46	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公司	13,395,532.00	36.63	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份	21,127,315.84	57.77	-	-	-	-	-



有限公司						
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
东兴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
高盛高 华证券 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	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国投证 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	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

司						
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 19 日

## § 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

投资者类别	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超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2024-01-01 至 2024-06-30	160,598,985.81	123,492,834.26	-	284,091,820.07	39.96

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实价值成长混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实价值成长混合型证券投资基金基金合同》；

- (3) 《嘉实价值成长混合型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实价值成长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) 报告期内嘉实价值成长混合型证券投资基金公告的各项原稿。

## 12.2 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

## 12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日