

嘉实北交所精选两年定期开放混合型证券
投资基金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 07 月 01 日起至 2024 年 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 嘉实北交所精选两年定期混合 |
| 基金主代码 | 014269 |
| 基金运作方式 | 契约型定期开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 11 月 23 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 358,602,189.16 份 |
| 投资目标 | 本基金力争在严格控制风险的前提下，通过对企业的研究和精选，实现基金资产的持续稳定增值。 |
| 投资策略 | 具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略（包括行业配置策略、个股投资策略、港股通投资策略、存托凭证投资策略、北京证券交易所精选投资策略、战略配售股票投资策略）、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借策略、风险管理策略。 |
| 业绩比较基准 | 中国战略新兴产业综合指数收益率*75%+恒生指数收益率×5%+中债综合财富指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。本基金所投资的北京证券交易所证券资产，会面临北京证券交易所机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括流动性风险、上市公司经营风险、退市风险、股价波动风险、投资集中风险等。 |

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金管理人 | 嘉实基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 嘉实北交所精选两年定期混合 A | 嘉实北交所精选两年定期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 014269 | 014270 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 303,226,816.81 份 | 55,375,372.35 份 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） | |
|-----------------|-------------------------------------|-----------------|
| | 嘉实北交所精选两年定期混合 A | 嘉实北交所精选两年定期混合 C |
| 1. 本期已实现收益 | -98,097.37 | -60,423.31 |
| 2. 本期利润 | 26,902,282.50 | 4,785,061.46 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0887 | 0.0864 |
| 4. 期末基金资产净值 | 191,057,231.66 | 34,298,426.50 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.6301 | 0.6194 |

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实北交所精选两年定期混合 A

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 16.38% | 2.30% | 14.97% | 1.62% | 1.41% | 0.68% |
| 过去六个月 | 4.05% | 1.85% | 9.32% | 1.36% | -5.27% | 0.49% |
| 过去一年 | 4.37% | 1.79% | 1.53% | 1.30% | 2.84% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | -36.99% | 1.49% | -22.70% | 1.14% | -14.29% | 0.35% |

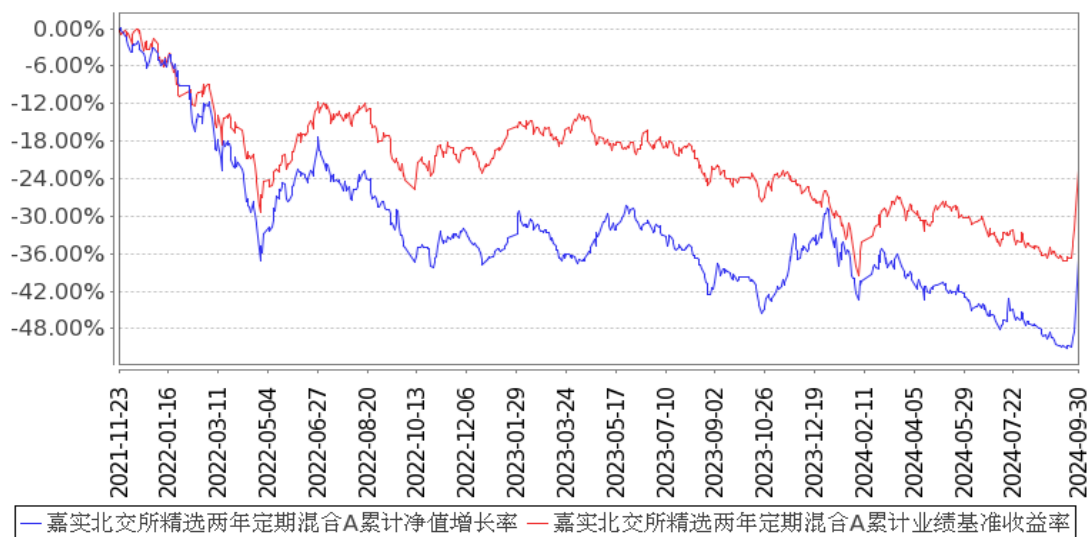
嘉实北交所精选两年定期混合 C

| 阶段 | 净值增长率① | 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 |
|------------|---------|-----------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去三个月 | 16.21% | 2.30% | 14.97% | 1.62% | 1.24% | 0.68% |
| 过去六个月 | 3.73% | 1.85% | 9.32% | 1.36% | -5.59% | 0.49% |
| 过去一年 | 3.75% | 1.79% | 1.53% | 1.30% | 2.22% | 0.49% |
| 自基金合同生效起至今 | -38.06% | 1.49% | -22.70% | 1.14% | -15.36% | 0.35% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

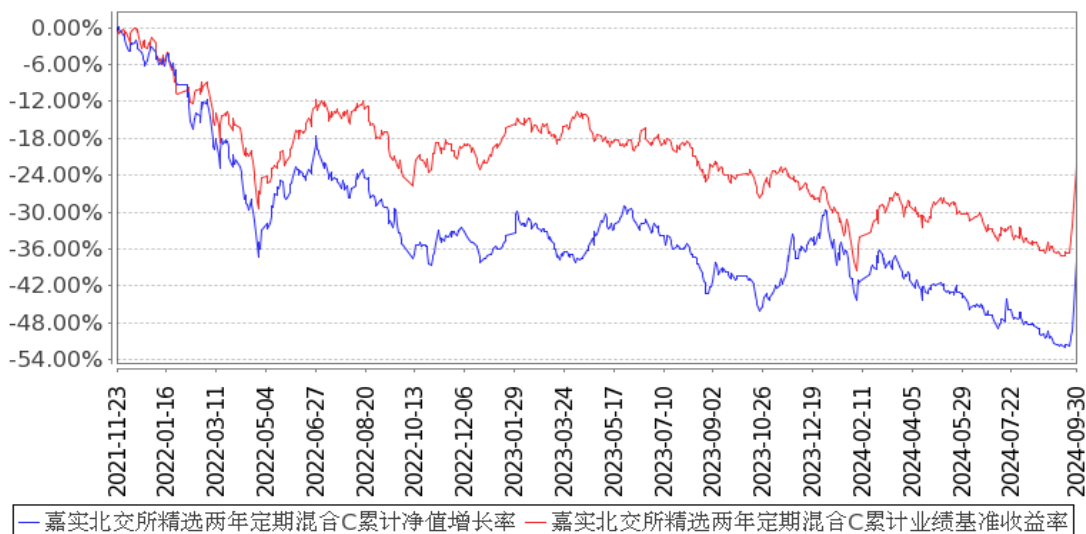
嘉实北交所精选两年定期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年11月23日至2024年09月30日)



嘉实北交所精选两年定期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年11月23日至2024年09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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|---|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 刘杰 | 本基金、嘉实先进制造股票、嘉实资源精选股票、嘉实全球产业升级股票发起式(QDII)、嘉实碳中和主题混合基金经理 | 2021年11月23日 | - | 18年 | 2006年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任研究部分析师、机构投资部投资经理。现任大制造研究总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
| 李涛 | 本基金、嘉实清洁能源股票发 | 2021年11月23日 | - | 16年 | 曾任广发基金管理有限公司行业研究员、建信基金管理有限公司行业研究员。2012年1月加入嘉实基金管理有限公司，历任 |

| | | | | |
|----------------------------------|--|--|--|---------------------------------|
| 起式、嘉实积极配置一年持有期混合、嘉实信息产业股票发起式基金经理 | | | | 行业研究员、投资经理。博士研究生，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、《嘉实北交所精选两年定期开放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 公平交易专项说明

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 1 次，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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年三季度市场在经历持续的震荡下跌过后，在季度末迎来快速反弹。7 月至 9 月中旬，由于三季度以来的高频数据显示当前经济仍然承压，供需两端相对疲弱，叠加非金融上市公司二

季度业绩延续下行趋势，市场情绪整体偏弱，出现了持续的震荡下跌行情。9月下旬，增量政策密集出台：9/24 国新办发布会宣布批量宽松政策后，9/26 政治局会议超预期讨论经济，从财政、货币、房地产、资本市场、民企、消费等多个维度加力部署，市场风险偏好得到明显改善，A 股迎来大幅反弹。

三季度本基金在保持中等偏高仓位的基础上，提高了权益资产的配置比例。同时对股票持仓结构进行了优化，更加聚焦于信创和数据要素等受益于国内政策的科技行业。展望后市，近期宽松政策批量出台，货币财政同时发力，加大逆周期调节力度，资本市场要求大力引导中长期资金入市，年内有望迎来政策的持续落地，A 股风险偏好或得到提升；叠加当前 A 股仍处于整体偏低的估值水平、美联储降息周期已正式开启，多重有利因素影响下，A 股流动性环境有望得到改善，市场有望走出此前的颓势，迎来估值修复的机会。中长期来看，A 股仍具备较高的配置价值。我们将始终坚持挖掘能够创造超额收益的优质上市公司，持续优化我们的持仓组合，坚持长期投资理念，为投资者带来长期可观的投资回报。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实北交所精选两年定期混合 A 基金份额净值为 0.6301 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.38%；截至本报告期末嘉实北交所精选两年定期混合 C 基金份额净值为 0.6194 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.21%；业绩比较基准收益率为 14.97%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 164,434,167.22 | 72.84 |
| | 其中：股票 | 164,434,167.22 | 72.84 |
| 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 | 61,304,367.59 | 27.16 |
| 8 | 其他资产 | 14,652.34 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 225,753,187.15 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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 | 1,837,839.98 | 0.82 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 151,201,342.89 | 67.09 |
| 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 | 2,394,684.00 | 1.06 |
| 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 | 4,179,202.22 | 1.85 |
| 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 | 4,821,098.13 | 2.14 |
| 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 | 164,434,167.22 | 72.97 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 839167 | 同享科技 | 689,554 | 13,218,750.18 | 5.87 |
| 2 | 832982 | 锦波生物 | 54,775 | 12,543,475.00 | 5.57 |
| 3 | 872808 | 曙光数创 | 250,353 | 12,362,431.14 | 5.49 |
| 4 | 835185 | 贝特瑞 | 461,804 | 9,979,584.44 | 4.43 |
| 5 | 835179 | 凯德石英 | 514,138 | 9,542,401.28 | 4.23 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 6 | 832491 | 奥迪威 | 532,639 | 8,682,015.70 | 3.85 |
| 7 | 833394 | 民士达 | 380,685 | 5,938,686.00 | 2.64 |
| 8 | 430718 | 合肥高科 | 542,302 | 5,797,208.38 | 2.57 |
| 9 | 430047 | 诺思兰德 | 374,437 | 5,283,306.07 | 2.34 |
| 10 | 836077 | 吉林碳谷 | 430,997 | 5,068,524.72 | 2.25 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 14,652.34 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 14,652.34 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 嘉实北交所精选两年定期混合 A | 嘉实北交所精选两年定期混合 C |
|---------------------------|-----------------|-----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 303,226,816.81 | 55,375,372.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | - | - |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | - | - |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |

| | | |
|-------------|----------------|---------------|
| 报告期期末基金份额总额 | 303,226,816.81 | 55,375,372.35 |
|-------------|----------------|---------------|

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实北交所精选两年定期开放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) 报告期内嘉实北交所精选两年定期开放混合型证券投资基金公告的各项原稿。

8.2 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

8.3 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

2024 年 10 月 25 日