

嘉实量化精选股票型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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。

嘉实量化精选股票型证券投资基金由嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金转型而成。

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 2025 年 01 月 01 日起至 2025 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	5
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	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
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	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	48
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实量化精选股票型证券投资基金
基金简称	嘉实量化精选股票
基金主代码	001637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 26 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	325,721,923.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以各类大数据为基础构建量化投资策略，力争在严格控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过量化投资方法深入分析和挖掘大数据与股票价格波动之间的关系，以大数据策略研究形成对个股投资价值的综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合。具体投资策略包括：大类资产配置、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、融资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+中证综合债券指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型、债券型和货币市场基金。

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	郭松
	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	《中国证券报》
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(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	22,871,804.04
本期利润	37,837,493.97
加权平均基金份额本期利润	0.0720
本期加权平均净值利润率	5.39%
本期基金份额净值增长率	7.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	132,866,512.02
期末可供分配基金份额利润	0.4079
期末基金资产净值	458,588,435.67
期末基金份额净值	1.4079
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-8.89%

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	5.02%	0.69%	4.12%	0.75%	0.90%	-0.06%
过去三个月	3.16%	1.42%	1.06%	1.42%	2.10%	0.00%
过去六个月	7.12%	1.24%	3.26%	1.29%	3.86%	-0.05%
过去一年	16.14%	1.52%	19.11%	1.63%	-2.97%	-0.11%

过去三年	-10.57%	1.22%	-6.96%	1.29%	-3.61%	-0.07%
自基金合同生效起至今	-8.89%	1.27%	-16.34%	1.31%	7.45%	-0.04%

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：

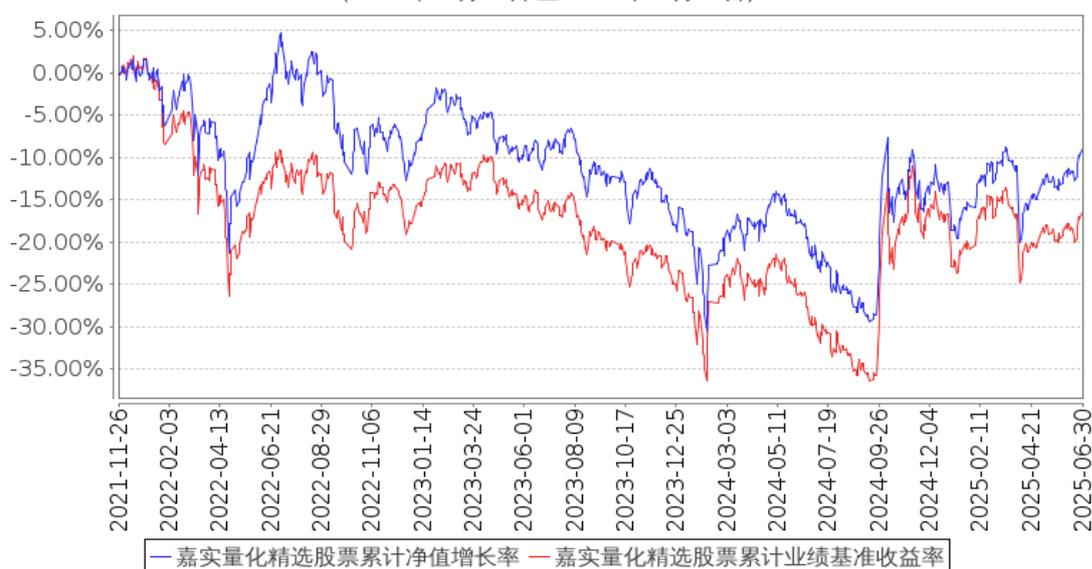
$$\text{Return}(t) = 95\% \times (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

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

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

嘉实量化精选股票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26日至2025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。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 2025 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 366 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		
刘斌	本基金、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实优质精选混合、嘉实兴锐优选一年持有期混合、嘉实中证半导体指数增强发起式、嘉实上证科创板 50 指数增强发起式基金经理	2021 年 11 月 26 日	-	19 年	曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作，曾任增强风格投资总监，现任 Smart-Beta 和指数投资首席投资官。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
龙昌伦	本基金、嘉实量化阿尔法混合、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实中证 500 指数增强、嘉实	2021 年 11 月 26 日	-	11 年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于股票投研体系。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

创业板增强策略ETF、嘉实中证1000指数增强发起式、嘉实中证A100指数增强发起式、嘉实上证科创板综合增强策略ETF基金经理				
---	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
刘斌	公募基金	6	5,944,323,836.25	2021年3月27日
	私募资产管理计划	1	278,734,050.45	2025年2月6日
	其他组合	4	15,223,131,808.09	2017年3月13日
	合计	11	21,446,189,694.79	-
龙昌伦	公募基金	9	2,696,848,147.87	2018年9月12日
	私募资产管理计划	1	21,603,261.72	2022年7月19日
	其他组合	3	14,793,610,277.47	2017年3月13日
	合计	13	17,512,061,687.06	-

注：1. “任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间；

2. 报告期内，龙昌伦管理的1个私募资产管理计划已于2025年3月13日离任。

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、《嘉实量化精选股票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 5 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 3 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 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

2025 年上半年，A 股市场在复杂的内外部环境展现出较强的韧性。市场整体呈现震荡上行态势，上证指数累计上涨 2.76%，深证成指与创业板指微弱正收益，而北证 50 指数则以 39.45% 的涨幅创出历史新高，呈现出巨大的分化差异。与此同时，市场的阶段性特征比较显著：年初在政策预期推动下展开春季行情，4 月遭遇关税冲击导致指数大幅下挫，随后在政策托底和中美谈判进展顺利的推动下逐步企稳回升，最终在 6 月底突破年内新高。

从市场结构来看，呈现出鲜明的哑铃型双主线特征。一方面，银行、有色金属等板块表现强势，另一方面，AI 产业链等科技题材反复活跃，特别是互联网巨头对 AI 算力基础设施投资增加。与此同时，煤炭、食品饮料等偏内需的板块持续承压，地产链也仍处于寻底阶段。港股市场表现亮眼，新消费 IP 标的涨幅惊人，展现出强大的市场吸引力。

宏观层面呈现出内需修复偏弱、外需回落以及政策稳预期的总体特征。国内经济正处于新旧动能转换期，二季度末工业增加值、社融等指标的回暖释放出积极信号，但企业盈利仍受通胀缺口压制。海外方面，特朗普关税政策的反复与美欧制造业的边际回暖形成对冲，美债利率高位震荡对全球风险资产估值形成制约。这种复杂的宏观环境使得市场风格经历了从哑铃向多热点扩散的转变，成长风格逐渐显现弹性，表现突出。行业方面，有色金属、银行、国防军工、传媒和通信等涨幅居前，建筑装饰、石油石化、房地产、食品饮料和煤炭等则表现靠后。

本基金在资产配置框架下，依据科学技术和系统化方法，深入分析上市公司各类型大数据，

包含基本面大数据、交易行为大数据、产业链大数据、互联网大数据，以及嘉实基金研究员基于实地调研、案头研究以及电话访谈等多种对上市公司进行研究所产生的上市公司研究数据，在此基础上构建多种投资策略，以海量、多维度的数据构建对个股全面的评估体系，并运用智能化方法优化策略权重，最终精选具有显著投资价值的上市公司构建股票投资组合。报告期内，组合保持较为分散投资，基本面量化策略和交易类策略均有超额贡献，组合尽可能平衡各类策略，降低不确定环境下的波动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4079 元；本报告期基金份额净值增长率为 7.12%，业绩比较基准收益率为 3.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，A 股市场预计呈现中枢上移以及延续结构轮动的特征。随着外部环境边际改善，包括中美经贸关系短期缓和、美联储降息预期增强以及地缘风险阶段性缓解，市场风险偏好有望持续修复。从宏观角度看，国内政策托底效应逐渐显现，消费刺激政策与基建投资保持较高增速，但盈利弹性受制于地产拖累和经济转型压力。在这种环境下，市场风格有望从上半年的红利和小微盘的哑铃结构向部分成长板块切换，科技和先进制造等高弹性领域可能领涨市场。值得注意的是，增量资金持续进入 A 股，推动市场成交放量，若后续出现财政和货币协同发力、地产企稳等催化剂，市场可能从结构性行情向指数机会扩散，与此同时，部分大市值核心资产在盈利改善与估值修复的驱动下已显现配置价值。综合来看，A 股有望在政策支持与经济转型中震荡上行，重点关注业绩确定性强的成长板块，同时把握可能出现风格扩散带来的指数机会，风险层面，需警惕贸易谈判的反复和国内经济修复不及预期等潜在冲击。

在后续的操作中，将继续严密控制风格和行业上的风险暴露，多元化和均衡化组合策略，面对更加有效且越加复杂的资本市场，降低潜在超额损失。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 2025 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：嘉实量化精选股票型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	45,098,594.15	65,767,024.96
结算备付金		14,302,144.21	12,992,154.47
存出保证金		4,067,509.95	3,314,285.96
交易性金融资产	6.4.7.2	396,347,121.16	738,362,713.24

其中：股票投资		396,347,121.16	738,362,713.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		4,027,477.41	484,544.00
应收股利		-	-
应收申购款		3,247.36	13,750.36
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		463,846,094.24	820,934,472.99
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
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		4,058,048.35	-
应付赎回款		186,297.92	6,989,608.11
应付管理人报酬		438,917.82	979,223.01
应付托管费		73,152.99	163,203.84
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,273.70	22,607.68
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	496,967.79	1,349,209.59
负债合计		5,257,658.57	9,503,852.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	325,721,923.65	617,393,232.79
未分配利润	6.4.7.12	132,866,512.02	194,037,387.97
净资产合计		458,588,435.67	811,430,620.76
负债和净资产总计		463,846,094.24	820,934,472.99

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4079 元，基金份额总额 325,721,923.65 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		42,848,703.00	-88,145,807.53
1. 利息收入		188,086.59	344,916.31
其中：存款利息收入	6.4.7.13	188,086.59	344,916.31
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）		27,423,808.42	-110,944,849.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	22,058,119.19	-134,825,058.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	44,109.20	67,718.50
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	717,928.30	1,996,554.23
股利收益	6.4.7.19	4,603,651.73	21,815,936.08
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	14,965,689.93	22,085,135.75
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	271,118.06	368,990.07
减：二、营业总支出		5,011,209.03	10,768,146.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,211,438.81	9,116,888.19
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	701,906.53	1,519,481.37
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		2,609.62	13,795.25
8. 其他费用	6.4.7.23	95,254.07	117,981.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,837,493.97	-98,913,953.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,837,493.97	-98,913,953.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		37,837,493.97	-98,913,953.98

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	617,393,232.79	-	194,037,387.97	811,430,620.76
二、本期期初净资产	617,393,232.79	-	194,037,387.97	811,430,620.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-291,671,309.14	-	-61,170,875.95	-352,842,185.09
（一）、综合收益总额	-	-	37,837,493.97	37,837,493.97
（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）	-291,671,309.14	-	-99,008,369.92	-390,679,679.06
其中：1. 基金申购款	3,418,317.62	-	1,182,746.37	4,601,063.99
2. 基金赎回款	-295,089,626.76	-	-100,191,116.29	-395,280,743.05
（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	325,721,923.65	-	132,866,512.02	458,588,435.67
项目	上年度可比期间 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	1,213,196,630.11	-	362,103,077.03	1,575,299,707.14
二、本期期初净资产	1,213,196,630.11	-	362,103,077.03	1,575,299,707.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-63,855,361.88	-	-118,191,654.51	-182,047,016.39
(一)、综合收益总额	-	-	-98,913,953.98	-98,913,953.98
(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)	-63,855,361.88	-	-19,277,700.53	-83,133,062.41
其中：1. 基金申购款	187,118,466.61	-	44,280,941.56	231,399,408.17
2. 基金赎回款	-250,973,828.49	-	-63,558,642.09	-314,532,470.58
(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	1,149,341,268.23	-	243,911,422.52	1,393,252,690.75

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

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实量化精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据原嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金(以下简称“嘉实腾讯自选股大数据策略股票”)基金份额持有人大会决议通过的《关于嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更基金名称、基金的投资及其他相关事项的议案》，经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3249号《关于准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更注册的批复》，由原嘉实腾讯自选股大数据策略股票变更而来。自2021年11月26日起，原嘉实腾讯自选股大数据策略股票正式变更为嘉实量化精选股票型证券投资基金。原《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》失效，《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》生效。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》、《嘉实量化精选股票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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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。

(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。

(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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	45,098,594.15
等于：本金	45,094,695.33
加：应计利息	3,898.82
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	45,098,594.15

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	385,989,271.37	-	396,347,121.16	10,357,849.79
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	385,989,271.37	-	396,347,121.16	10,357,849.79
----	----------------	---	----------------	---------------

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	30,862,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	30,862,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	30,862,960.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2507	IC2507	4.00	4,693,920.00	238,240.00
IC2509	IC2509	24.00	27,723,840.00	1,316,560.00
合计				1,554,800.00
减：可抵销期货暂收款				1,554,800.00
净额				0.00

注：衍生金融资产/负债项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产/负债项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

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 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	103.45
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	413,553.66
其中：交易所市场	413,553.66
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,310.68
合计	496,967.79

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	617,393,232.79	617,393,232.79
本期申购	3,418,317.62	3,418,317.62
本期赎回（以“-”号填列）	-295,089,626.76	-295,089,626.76
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	325,721,923.65	325,721,923.65

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	227,995,457.78	-33,958,069.81	194,037,387.97
本期期初	227,995,457.78	-33,958,069.81	194,037,387.97
本期利润	22,871,804.04	14,965,689.93	37,837,493.97
本期基金份额交易产生的变动数	-114,121,062.53	15,112,692.61	-99,008,369.92
其中：基金申购款	1,316,363.95	-133,617.58	1,182,746.37
基金赎回款	-115,437,426.48	15,246,310.19	-100,191,116.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	136,746,199.29	-3,879,687.27	132,866,512.02

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
	活期存款利息收入
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	86,074.13
其他	446.89
合计	188,086.59

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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	22,058,119.19
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	22,058,119.19

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,089,764,952.91
减：卖出股票成本总额	1,066,261,163.27
减：交易费用	1,445,670.45
买卖股票差价收入	22,058,119.19

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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	44.16
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	44,065.04
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	44,109.20

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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	225,219.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	181,100.00

本总额	
减：应计利息总额	45.21
减：交易费用	9.05
买卖债券差价收入	44,065.04

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	717,928.30

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,603,651.73
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	4,603,651.73

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	12,036,536.99
股票投资	12,036,536.99
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	2,929,152.94
权证投资	-
期货投资	2,929,152.94
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	14,965,689.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	267,717.67
基金转出费收入	3,400.39
合计	271,118.06

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
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,897.08
债券托管账户维护费	9,000.00
存托服务费	46.31
合计	95,254.07

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,211,438.81	9,116,888.19
其中：应支付销售机构的客户维护费	218,635.24	915,860.91
应支付基金管理人的净管理费	3,992,803.57	8,201,027.28

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	701,906.53	1,519,481.37

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	45,098,594.15	101,565.57	117,571,124.78	216,367.82

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(2025年1月1日至2025年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2025年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新发未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301678	新恒	2025年6月	6个月	新股锁定	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-

	汇	13 日								
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股锁定	47.27	124.16	384	18,151.68	47,677.44	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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以各类大数据为基础构建量化投资策略，力争在严格控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。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

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025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	45,098,594.15	-	-	-	45,098,594.15
结算备付金	14,302,144.21	-	-	-	14,302,144.21
存出保证金	177,378.75	-	-	3,890,131.20	4,067,509.95
交易性金融资产	-	-	-	396,347,121.16	396,347,121.16
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,027,477.41	4,027,477.41
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,247.36	3,247.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	59,578,117.11	-	-	404,267,977.13	463,846,094.24
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	-	-	-	4,058,048.35	4,058,048.35
应付赎回款	-	-	-	186,297.92	186,297.92
应付管理人报酬	-	-	-	438,917.82	438,917.82
应付托管费	-	-	-	73,152.99	73,152.99
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,273.70	4,273.70

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	496,967.79	496,967.79
负债总计	-	-	-	5,257,658.57	5,257,658.57
利率敏感度缺口	59,578,117.11	-	-	-399,010,318.56	458,588,435.67
上年度末 2024 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	65,767,024.96	-	-	-	65,767,024.96
结算备付金	12,992,154.47	-	-	-	12,992,154.47
存出保证金	294,337.16	-	-	3,019,948.80	3,314,285.96
交易性金融资产	-	-	-	738,362,713.24	738,362,713.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	484,544.00	484,544.00
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,750.36	13,750.36
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	79,053,516.59	-	-	-741,880,956.40	820,934,472.99
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,989,608.11	6,989,608.11
应付管理人报酬	-	-	-	979,223.01	979,223.01
应付托管费	-	-	-	163,203.84	163,203.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	22,607.68	22,607.68
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,349,209.59	1,349,209.59
负债总计	-	-	-	9,503,852.23	9,503,852.23
利率敏感度缺口	79,053,516.59	-	-	-732,377,104.17	811,430,620.76

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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-
市场利率下降 25 个基点	-	-	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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	396,347,121.16	86.43	738,362,713.24	91.00
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	396,347,121.16	86.43	738,362,713.24	91.00

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（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	21,921,122.47	36,275,644.71
	业绩比较基准下降5%	-21,921,122.47	-36,275,644.71

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	396,178,229.75	738,362,713.24
第二层次	15,385.54	-
第三层次	153,505.87	-
合计	396,347,121.16	738,362,713.24

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	396,347,121.16	85.45
	其中：股票	396,347,121.16	85.45

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	59,400,738.36	12.81
8	其他各项资产	8,098,234.72	1.75
9	合计	463,846,094.24	100.00

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	15,982,424.90	3.49
C	制造业	275,732,454.59	60.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,063,402.40	2.41
E	建筑业	258,944.00	0.06
F	批发和零售业	4,835,111.00	1.05
G	交通运输、仓储和邮政业	2,447,998.00	0.53
H	住宿和餐饮业	659,871.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,586,932.92	7.11
J	金融业	36,974,208.55	8.06
K	房地产业	2,434,316.00	0.53
L	租赁和商务服务业	3,126,045.20	0.68
M	科学研究和技术服务业	1,449,942.60	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	891,922.00	0.19
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	6,226,502.00	1.36
S	综合	1,677,046.00	0.37
	合计	396,347,121.16	86.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000988	华工科技	101,000	4,748,010.00	1.04
2	601555	东吴证券	490,540	4,292,225.00	0.94
3	300207	欣旺达	213,600	4,284,816.00	0.93
4	300017	网宿科技	336,100	3,602,992.00	0.79
5	002138	顺络电子	127,200	3,576,864.00	0.78
6	601665	齐鲁银行	560,900	3,544,888.00	0.77
7	002532	天山铝业	375,800	3,122,898.00	0.68
8	600352	浙江龙盛	292,700	2,973,832.00	0.65
9	601128	常熟银行	400,165	2,949,216.05	0.64
10	300496	中科创达	50,100	2,866,722.00	0.63
11	002625	光启技术	71,100	2,842,578.00	0.62
12	600862	中航高科	105,200	2,743,616.00	0.60
13	002202	金风科技	267,600	2,742,900.00	0.60
14	002273	水晶光电	137,300	2,741,881.00	0.60
15	000783	长江证券	393,900	2,729,727.00	0.60
16	000960	锡业股份	174,800	2,674,440.00	0.58
17	002517	恺英网络	137,800	2,660,918.00	0.58
18	600909	华安证券	448,700	2,615,921.00	0.57
19	000001	平安银行	208,700	2,519,009.00	0.55
20	002078	太阳纸业	186,400	2,508,944.00	0.55
21	688608	恒玄科技	7,160	2,491,536.80	0.54
22	002414	高德红外	242,300	2,483,575.00	0.54
23	000423	东阿阿胶	46,500	2,431,950.00	0.53
24	688099	晶晨股份	34,000	2,414,340.00	0.53
25	000750	国海证券	576,700	2,376,004.00	0.52
26	002085	万丰奥威	148,100	2,353,309.00	0.51
27	002001	新和成	110,400	2,348,208.00	0.51
28	000598	兴蓉环境	324,200	2,337,482.00	0.51
29	002340	格林美	367,800	2,335,530.00	0.51
30	600298	安琪酵母	65,900	2,317,703.00	0.51
31	600316	洪都航空	60,500	2,280,850.00	0.50
32	688041	海光信息	16,100	2,274,769.00	0.50
33	600143	金发科技	216,400	2,231,084.00	0.49
34	600685	中船防务	82,000	2,229,580.00	0.49
35	688026	洁特生物	132,892	2,179,428.80	0.48
36	601166	兴业银行	91,300	2,130,942.00	0.46
37	002516	旷达科技	413,700	2,130,555.00	0.46
38	300002	神州泰岳	180,300	2,127,540.00	0.46
39	601615	明阳智能	185,078	2,126,546.22	0.46
40	600062	华润双鹤	113,755	2,122,668.30	0.46

41	603979	金诚信	45,300	2,103,732.00	0.46
42	300677	英科医疗	88,800	2,102,784.00	0.46
43	600968	海油发展	508,000	2,072,640.00	0.45
44	000709	河钢股份	951,200	2,054,592.00	0.45
45	300037	新宙邦	58,200	2,048,640.00	0.45
46	002156	通富微电	79,200	2,029,104.00	0.44
47	603160	汇顶科技	28,300	2,010,149.00	0.44
48	002606	大连电瓷	223,500	1,993,620.00	0.43
49	600757	长江传媒	213,000	1,976,640.00	0.43
50	688578	艾力斯	21,200	1,972,448.00	0.43
51	600219	南山铝业	514,900	1,972,067.00	0.43
52	600060	海信视像	85,600	1,970,512.00	0.43
53	603596	伯特利	36,800	1,938,992.00	0.42
54	688213	思特威	18,860	1,927,869.20	0.42
55	688122	西部超导	37,125	1,926,045.00	0.42
56	600487	亨通光电	125,000	1,912,500.00	0.42
57	600563	法拉电子	17,300	1,887,257.00	0.41
58	002926	华西证券	209,000	1,868,460.00	0.41
59	300604	长川科技	41,400	1,859,274.00	0.41
60	600380	健康元	166,400	1,835,392.00	0.40
61	300395	菲利华	35,900	1,834,490.00	0.40
62	000728	国元证券	232,400	1,833,636.00	0.40
63	300623	捷捷微电	61,500	1,832,700.00	0.40
64	600642	申能股份	213,034	1,832,092.40	0.40
65	000959	首钢股份	534,400	1,816,960.00	0.40
66	603993	洛阳钼业	215,700	1,816,194.00	0.40
67	603380	易德龙	68,100	1,811,460.00	0.40
68	300735	光弘科技	72,000	1,807,200.00	0.39
69	300369	绿盟科技	232,500	1,806,525.00	0.39
70	600988	赤峰黄金	71,700	1,783,896.00	0.39
71	002595	豪迈科技	30,100	1,782,522.00	0.39
72	000553	安道麦 A	246,800	1,781,896.00	0.39
73	601991	大唐发电	546,800	1,733,356.00	0.38
74	002461	珠江啤酒	151,400	1,709,306.00	0.37
75	000538	云南白药	30,600	1,707,174.00	0.37
76	688617	惠泰医疗	5,701	1,693,197.00	0.37
77	600707	彩虹股份	261,300	1,687,998.00	0.37
78	600066	宇通客车	67,900	1,687,994.00	0.37
79	601099	太平洋	427,000	1,678,110.00	0.37
80	600673	东阳光	144,200	1,677,046.00	0.37
81	000050	深天马 A	195,900	1,669,068.00	0.36
82	601568	北元集团	401,800	1,667,470.00	0.36
83	000027	深圳能源	261,300	1,667,094.00	0.36

84	600498	烽火通信	79,200	1,665,576.00	0.36
85	000651	格力电器	36,900	1,657,548.00	0.36
86	600299	安迪苏	171,600	1,655,940.00	0.36
87	601717	郑煤机	99,100	1,647,042.00	0.36
88	603816	顾家家居	63,800	1,628,176.00	0.36
89	000563	陕国投 A	456,000	1,627,920.00	0.35
90	300134	大富科技	133,100	1,627,813.00	0.35
91	600873	梅花生物	151,000	1,614,190.00	0.35
92	688188	柏楚电子	12,242	1,611,781.72	0.35
93	600109	国金证券	181,000	1,587,370.00	0.35
94	600998	九州通	306,300	1,574,382.00	0.34
95	688668	鼎通科技	25,200	1,573,992.00	0.34
96	601216	君正集团	282,500	1,559,400.00	0.34
97	002409	雅克科技	28,499	1,558,610.31	0.34
98	601696	中银证券	145,600	1,556,464.00	0.34
99	300054	鼎龙股份	54,200	1,554,456.00	0.34
100	000902	新洋丰	112,300	1,553,109.00	0.34
101	000729	燕京啤酒	118,400	1,530,912.00	0.33
102	603379	三美股份	31,800	1,530,216.00	0.33
103	300058	蓝色光标	232,520	1,525,331.20	0.33
104	002128	电投能源	76,800	1,519,104.00	0.33
105	600183	生益科技	49,700	1,498,455.00	0.33
106	300133	华策影视	199,000	1,494,490.00	0.33
107	300339	润和软件	29,200	1,484,236.00	0.32
108	600096	云天化	67,300	1,478,581.00	0.32
109	603236	移远通信	17,100	1,467,180.00	0.32
110	002353	杰瑞股份	41,500	1,452,500.00	0.32
111	002223	鱼跃医疗	40,300	1,434,680.00	0.31
112	002850	科达利	12,600	1,425,942.00	0.31
113	300024	机器人	82,500	1,417,350.00	0.31
114	600637	东方明珠	185,500	1,385,685.00	0.30
115	000831	中国稀土	38,300	1,383,396.00	0.30
116	688777	中控技术	30,600	1,374,246.00	0.30
117	603858	步长制药	84,600	1,373,904.00	0.30
118	300098	高新兴	262,600	1,365,520.00	0.30
119	300763	锦浪科技	23,600	1,354,404.00	0.30
120	300373	扬杰科技	25,600	1,328,640.00	0.29
121	301236	软通动力	24,300	1,327,752.00	0.29
122	688278	特宝生物	18,400	1,326,824.00	0.29
123	000738	航发控制	63,900	1,325,925.00	0.29
124	601231	环旭电子	90,400	1,322,552.00	0.29
125	002543	万和电气	119,000	1,322,090.00	0.29
126	603267	鸿远电子	26,000	1,307,020.00	0.29

127	002318	久立特材	55,500	1,298,145.00	0.28
128	002472	双环传动	38,400	1,286,016.00	0.28
129	601168	西部矿业	77,300	1,285,499.00	0.28
130	600098	广州发展	205,600	1,285,000.00	0.28
131	001696	宗申动力	57,000	1,279,650.00	0.28
132	603338	浙江鼎力	26,800	1,270,320.00	0.28
133	301033	迈普医学	21,100	1,267,266.00	0.28
134	603893	瑞芯微	8,300	1,260,438.00	0.27
135	600895	张江高科	49,000	1,259,300.00	0.27
136	000893	亚钾国际	41,400	1,247,796.00	0.27
137	603659	璞泰来	66,400	1,246,992.00	0.27
138	688235	百济神州	5,300	1,238,292.00	0.27
139	300088	长信科技	206,100	1,228,356.00	0.27
140	600114	东睦股份	60,300	1,226,502.00	0.27
141	301090	华润材料	162,000	1,219,860.00	0.27
142	688114	华大智造	18,700	1,212,321.00	0.26
143	002155	湖南黄金	67,290	1,201,126.50	0.26
144	600079	人福医药	56,300	1,181,174.00	0.26
145	688597	煜邦电力	149,240	1,168,549.20	0.25
146	300573	兴齐眼药	22,560	1,168,382.40	0.25
147	601928	凤凰传媒	104,300	1,165,031.00	0.25
148	600535	天士力	74,300	1,162,795.00	0.25
149	000049	德赛电池	49,800	1,133,448.00	0.25
150	601001	晋控煤业	92,100	1,125,462.00	0.25
151	000825	太钢不锈	309,800	1,112,182.00	0.24
152	601919	中远海控	73,000	1,097,920.00	0.24
153	002637	赞宇科技	109,900	1,096,802.00	0.24
154	688676	金盘科技	32,700	1,093,815.00	0.24
155	300223	北京君正	15,800	1,093,360.00	0.24
156	000551	创元科技	84,100	1,080,685.00	0.24
157	002056	横店东磁	75,800	1,072,570.00	0.23
158	002716	湖南白银	274,900	1,072,110.00	0.23
159	601156	东航物流	81,700	1,069,453.00	0.23
160	600885	宏发股份	47,600	1,061,956.00	0.23
161	000921	海信家电	41,100	1,056,270.00	0.23
162	002913	奥士康	35,500	1,044,055.00	0.23
163	000404	长虹华意	146,500	1,040,150.00	0.23
164	000898	鞍钢股份	448,200	1,039,824.00	0.23
165	603087	甘李药业	18,800	1,029,864.00	0.22
166	000739	普洛药业	73,200	1,024,800.00	0.22
167	688017	绿的谐波	8,119	1,013,981.91	0.22
168	688100	威胜信息	27,300	1,011,465.00	0.22
169	688065	凯赛生物	21,400	1,007,940.00	0.22

170	600609	金杯汽车	189,100	1,000,339.00	0.22
171	002195	岩山科技	177,000	996,510.00	0.22
172	688208	道通科技	32,300	988,380.00	0.22
173	603179	新泉股份	20,700	972,279.00	0.21
174	300285	国瓷材料	56,000	971,600.00	0.21
175	000066	中国长城	65,000	962,000.00	0.21
176	000733	振华科技	19,000	950,950.00	0.21
177	300606	金太阳	47,500	936,700.00	0.20
178	300001	特锐德	38,900	932,433.00	0.20
179	601918	新集能源	141,900	916,674.00	0.20
180	600075	新疆天业	216,600	916,218.00	0.20
181	002432	九安医疗	24,900	907,107.00	0.20
182	002841	视源股份	26,200	906,520.00	0.20
183	000957	中通客车	82,800	905,004.00	0.20
184	600578	京能电力	201,300	903,837.00	0.20
185	000021	深科技	47,500	890,150.00	0.19
186	600511	国药股份	30,300	883,548.00	0.19
187	688588	凌志软件	60,400	880,028.00	0.19
188	000415	渤海租赁	263,000	875,790.00	0.19
189	688088	虹软科技	18,000	868,500.00	0.19
190	600482	中国动力	37,200	858,204.00	0.19
191	600131	国网信通	48,200	853,140.00	0.19
192	688059	华锐精密	18,200	851,032.00	0.19
193	605358	立昂微	36,300	845,790.00	0.18
194	601989	中国重工	180,200	836,128.00	0.18
195	300616	尚品宅配	62,900	828,393.00	0.18
196	300115	长盈精密	38,400	821,760.00	0.18
197	601857	中国石油	95,500	816,525.00	0.18
198	300232	洲明科技	112,000	810,880.00	0.18
199	603700	宁水集团	67,500	808,650.00	0.18
200	688381	帝奥微	37,300	807,918.00	0.18
201	300724	捷佳伟创	14,500	787,350.00	0.17
202	002436	兴森科技	59,300	785,132.00	0.17
203	300595	欧普康视	51,200	781,824.00	0.17
204	002653	海思科	18,500	781,070.00	0.17
205	603203	快克智能	31,400	780,918.00	0.17
206	603939	益丰药房	31,800	778,146.00	0.17
207	600985	淮北矿业	67,460	764,996.40	0.17
208	688475	萤石网络	24,200	762,784.00	0.17
209	600320	振华重工	174,000	760,380.00	0.17
210	600664	哈药股份	204,500	752,560.00	0.16
211	601155	新城控股	54,800	749,664.00	0.16
212	688558	国盛智科	29,500	744,580.00	0.16

213	688220	翱捷科技	9,500	743,850.00	0.16
214	000401	冀东水泥	169,600	742,848.00	0.16
215	002004	华邦健康	176,500	736,005.00	0.16
216	000543	皖能电力	105,000	735,000.00	0.16
217	600745	闻泰科技	21,900	734,307.00	0.16
218	300662	科锐国际	24,400	724,924.00	0.16
219	600528	中铁工业	96,900	715,122.00	0.16
220	002500	山西证券	122,100	713,064.00	0.16
221	300981	中红医疗	59,400	711,018.00	0.16
222	688772	珠海冠宇	49,700	710,213.00	0.15
223	002225	濮耐股份	142,800	706,860.00	0.15
224	003006	百亚股份	25,300	692,714.00	0.15
225	601877	正泰电器	30,400	689,168.00	0.15
226	688128	中国电研	28,000	686,000.00	0.15
227	002405	四维图新	79,400	678,076.00	0.15
228	600517	国网英大	132,700	676,770.00	0.15
229	603309	维力医疗	52,400	666,528.00	0.15
230	688087	英科再生	25,808	663,265.60	0.14
231	600258	首旅酒店	46,700	659,871.00	0.14
232	002430	杭氧股份	33,500	650,570.00	0.14
233	601567	三星医疗	28,900	647,938.00	0.14
234	603466	风语筑	63,700	642,733.00	0.14
235	000425	徐工机械	82,200	638,694.00	0.14
236	603486	科沃斯	10,900	634,707.00	0.14
237	688082	盛美上海	5,500	626,670.00	0.14
238	002947	恒铭达	18,400	610,696.00	0.13
239	000977	浪潮信息	12,000	610,560.00	0.13
240	000100	TCL 科技	140,500	608,365.00	0.13
241	300320	海达股份	60,600	602,364.00	0.13
242	688286	敏芯股份	8,500	600,865.00	0.13
243	000623	吉林敖东	34,400	583,080.00	0.13
244	600229	城市传媒	81,000	577,530.00	0.13
245	600583	海油工程	105,600	576,576.00	0.13
246	688135	利扬芯片	27,800	575,738.00	0.13
247	601058	赛轮轮胎	43,612	572,189.44	0.12
248	600276	恒瑞医药	11,000	570,900.00	0.12
249	002608	江苏国信	77,700	569,541.00	0.12
250	688231	隆达股份	31,300	564,965.00	0.12
251	300319	麦捷科技	52,500	563,850.00	0.12
252	300825	阿尔特	51,900	561,039.00	0.12
253	002983	芯瑞达	26,000	550,940.00	0.12
254	688288	鸿泉物联	18,900	548,289.00	0.12
255	605080	浙江自然	19,700	547,660.00	0.12

256	002811	郑中设计	50,700	535,392.00	0.12
257	600176	中国巨石	46,800	533,520.00	0.12
258	601399	国机重装	177,100	531,300.00	0.12
259	002373	千方科技	57,100	531,030.00	0.12
260	300184	力源信息	54,000	530,280.00	0.12
261	603612	索通发展	28,500	523,830.00	0.11
262	002204	大连重工	87,100	519,987.00	0.11
263	002429	兆驰股份	118,500	519,030.00	0.11
264	688162	巨一科技	19,000	517,560.00	0.11
265	600050	中国联通	96,300	514,242.00	0.11
266	603617	君禾股份	71,500	512,655.00	0.11
267	300642	透景生命	34,800	512,256.00	0.11
268	001313	粤海饲料	66,100	508,970.00	0.11
269	002970	锐明技术	10,300	508,820.00	0.11
270	301106	骏成科技	17,000	506,600.00	0.11
271	002752	昇兴股份	89,200	496,844.00	0.11
272	002587	奥拓电子	76,400	492,780.00	0.11
273	300070	碧水源	106,900	481,050.00	0.10
274	300181	佐力药业	27,200	471,376.00	0.10
275	300577	开润股份	23,000	471,270.00	0.10
276	003033	征和工业	11,100	470,529.00	0.10
277	002920	德赛西威	4,600	469,798.00	0.10
278	300206	理邦仪器	38,500	462,770.00	0.10
279	601601	中国太保	12,300	461,373.00	0.10
280	600216	浙江医药	30,400	449,616.00	0.10
281	600827	百联股份	48,900	446,946.00	0.10
282	688819	天能股份	16,100	446,936.00	0.10
283	605198	安德利	11,000	443,410.00	0.10
284	002065	东华软件	45,600	437,760.00	0.10
285	300999	金龙鱼	14,700	434,091.00	0.09
286	002881	美格智能	9,200	426,880.00	0.09
287	600208	衢州发展	143,700	425,352.00	0.09
288	603337	杰克股份	11,800	423,384.00	0.09
289	000550	江铃汽车	20,500	416,765.00	0.09
290	002111	威海广泰	38,600	414,178.00	0.09
291	002266	浙富控股	133,400	410,872.00	0.09
292	688008	澜起科技	5,000	410,000.00	0.09
293	600036	招商银行	8,900	408,955.00	0.09
294	600703	三安光电	32,600	404,892.00	0.09
295	600901	江苏金租	65,275	395,566.50	0.09
296	601179	中国西电	62,700	384,978.00	0.08
297	002281	光迅科技	7,800	384,696.00	0.08
298	603009	北特科技	9,200	383,640.00	0.08

299	603306	华懋科技	8,700	378,450.00	0.08
300	000768	中航西飞	13,600	371,824.00	0.08
301	600177	雅戈尔	50,700	370,110.00	0.08
302	601811	新华文轩	25,400	370,078.00	0.08
303	603355	莱克电气	16,400	367,688.00	0.08
304	600718	东软集团	37,200	362,700.00	0.08
305	603345	安井食品	4,500	361,890.00	0.08
306	603081	大丰实业	32,800	354,896.00	0.08
307	301091	深城交	12,090	353,511.60	0.08
308	002408	齐翔腾达	77,700	348,096.00	0.08
309	300529	健帆生物	16,100	347,277.00	0.08
310	301028	东亚机械	28,200	346,578.00	0.08
311	603368	柳药集团	20,300	343,273.00	0.07
312	600958	东方证券	35,200	340,736.00	0.07
313	002936	郑州银行	162,600	334,956.00	0.07
314	601990	南京证券	41,200	332,896.00	0.07
315	002611	东方精工	27,500	331,650.00	0.07
316	000786	北新建材	11,900	315,112.00	0.07
317	002681	奋达科技	45,400	307,358.00	0.07
318	603699	纽威股份	9,700	302,349.00	0.07
319	688312	燕麦科技	12,300	295,569.00	0.06
320	301062	上海艾录	33,700	291,168.00	0.06
321	600460	士兰微	11,600	287,912.00	0.06
322	600428	中远海特	44,900	280,625.00	0.06
323	000034	神州数码	7,400	278,536.00	0.06
324	000032	深桑达 A	12,800	258,944.00	0.06
325	603610	麒盛科技	20,500	256,045.00	0.06
326	600312	平高电气	16,200	249,318.00	0.05
327	603606	东方电缆	4,400	227,524.00	0.05
328	600282	南钢股份	50,600	212,520.00	0.05
329	603055	台华新材	22,900	209,077.00	0.05
330	688775	影石创新	384	47,677.44	0.01
331	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
332	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.01
333	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
334	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
335	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
336	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
337	688661	和林微纳	100	3,977.00	0.00
338	300743	天地数码	160	3,203.20	0.00
339	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
340	002185	华天科技	200	2,020.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	9,919,821.00	1.22
2	603477	巨星农牧	6,714,016.00	0.83
3	002195	岩山科技	5,948,837.00	0.73
4	600685	中船防务	5,914,240.00	0.73
5	688668	鼎通科技	5,336,327.51	0.66
6	603893	瑞芯微	5,095,322.00	0.63
7	600216	浙江医药	5,002,773.00	0.62
8	300203	聚光科技	4,853,531.00	0.60
9	301236	软通动力	4,667,503.00	0.58
10	300496	中科创达	4,537,648.00	0.56
11	000957	中通客车	4,351,321.00	0.54
12	300251	光线传媒	4,196,455.00	0.52
13	002606	大连电瓷	4,168,171.00	0.51
14	300017	网宿科技	4,113,502.00	0.51
15	002457	青龙管业	4,043,501.00	0.50
16	600418	江淮汽车	3,871,273.00	0.48
17	688521	芯原股份	3,824,448.07	0.47
18	601989	中国重工	3,819,734.00	0.47
19	002968	新大正	3,812,361.00	0.47
20	600606	绿地控股	3,738,695.00	0.46

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	600418	江淮汽车	10,778,067.00	1.33
2	300476	胜宏科技	10,059,538.00	1.24
3	301236	软通动力	8,534,916.00	1.05
4	002384	东山精密	8,472,286.00	1.04
5	000039	中集集团	7,427,180.00	0.92
6	002625	光启技术	7,250,387.00	0.89
7	603477	巨星农牧	6,964,628.00	0.86
8	002261	拓维信息	6,518,472.00	0.80
9	300203	聚光科技	6,368,201.00	0.78
10	300724	捷佳伟创	6,146,520.00	0.76
11	601555	东吴证券	6,117,212.00	0.75
12	601108	财通证券	6,112,538.60	0.75
13	688521	芯原股份	6,002,085.58	0.74
14	600988	赤峰黄金	5,991,935.00	0.74

15	601958	金铂股份	5,672,679.00	0.70
16	000830	鲁西化工	5,227,402.00	0.64
17	002797	第一创业	4,938,663.00	0.61
18	002195	岩山科技	4,917,829.00	0.61
19	600143	金发科技	4,773,053.00	0.59
20	605376	博迁新材	4,763,228.00	0.59

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	712,209,034.20
卖出股票收入（成交）总额	1,089,764,952.91

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，东吴证券股份有限公司、江苏常熟农村商业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

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	4,067,509.95
2	应收清算款	4,027,477.41
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,247.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,098,234.72

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 (%)
4,557	71,477.27	240,100,369.98	73.71	85,621,553.67	26.29

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	1,813,716.15	0.56

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	50~100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021年11月26日） 基金份额总额	364,323,192.22
本报告期期初基金份额总额	617,393,232.79
本报告期基金总申购份额	3,418,317.62
减：本报告期基金总赎回份额	295,089,626.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	325,721,923.65

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。

§ 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**

2025年5月22日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

(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

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

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，会计师事务所为容诚会计师事务所（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 (%)	
国泰海通证券股份有限公司	4	348,460,040.33	19.34	151,896.70	19.34	-
国金证券股份有限公司	1	253,290,922.30	14.06	110,425.79	14.06	-
开源证券股份有限公司	3	212,094,055.77	11.77	92,455.90	11.77	-
中国国际金融股份有限公司	2	191,818,855.71	10.65	83,617.81	10.65	-
广发证券股份有限公司	5	178,942,213.42	9.93	78,013.49	9.93	-
浙商证券股份有限公司	2	148,091,161.62	8.22	64,564.54	8.22	-
华泰证券股份有限公司	3	139,558,910.73	7.75	60,851.49	7.75	-
中信证券股份有限公司	3	131,552,603.28	7.30	57,348.62	7.30	-

民生证券股份有限公司	1	88,969,055.67	4.94	38,780.32	4.94	-
招商证券股份有限公司	2	59,009,415.28	3.28	25,742.18	3.28	-
兴业证券股份有限公司	1	24,892,252.81	1.38	10,849.79	1.38	-
国盛证券有限责任公司	2	24,717,123.30	1.37	10,776.15	1.37	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	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	-	-	-	-	-
国联民生证券股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

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) 合规风控能力较强；
- (4) 研究、交易等服务能力较强。

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. 国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。国联证券股份有限公司更名为国联民生证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：东兴证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国都证券股份有限公司退租交易单元 1 个。华宝证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	99,172.59	44.03	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

华泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	126,046.71	55.97	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国联民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 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	2025-01-01 至 2025-06-30	187,679,268.26	-	30,000,000.00	157,679,268.26	48.41
	2	2025-01-01 至 2025-05-11	241,281,560.86	-	241,281,560.86	-	-
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。

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 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腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金注册的批复文件；
中国证监会准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更注册的批复；
- (2) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实量化精选股票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。

嘉实基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日