

嘉实科技创新混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
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	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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60

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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	62
§ 10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
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	63
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	67
§ 11 备查文件目录	67
11.1 备查文件目录	67
11.2 存放地点	67
11.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实科技创新混合型证券投资基金
基金简称	嘉实科技创新混合
基金主代码	007343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 7 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
报告期末基金份额总额	728,171,276.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制，追求基金长期资产增值。
投资策略	<p>本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素四方面指标，在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略。本基金主要投资于科技创新企业，科技创新企业是指符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业；属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业；互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合的科技创新企业。本基金首先根据科技创新企业范畴选出备选股票池，并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。</p> <p>具体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。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×65% +恒生指数收益率×15% +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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	张燕
	联系电话	(010)65215588	0755-83199084
	电子邮箱	service@jsfund.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95555
传真		(010)65215588	0755-83195201
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世	深圳市深南大道 7088 号招商银

	纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100005	518040
法定代表人	经雷	缪建民

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(2022年1月1日-2022年6月30日)
本期已实现收益	-192,444,937.25
本期利润	-221,841,108.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2975
本期加权平均净值利润率	-14.11%
本期基金份额净值增长率	-11.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)
期末可供分配利润	608,411,654.40
期末可供分配基金份额利润	0.8355
期末基金资产净值	1,654,335,082.64
期末基金份额净值	2.2719
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)
基金份额累计净值增长率	127.19%

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	13.33%	1.84%	10.15%	1.19%	3.18%	0.65%
过去三个月	11.75%	2.19%	6.10%	1.51%	5.65%	0.68%
过去六个月	-11.35%	2.02%	-7.90%	1.46%	-3.45%	0.56%
过去一年	-10.79%	1.86%	-14.79%	1.24%	4.00%	0.62%
过去三年	127.01%	1.82%	47.43%	1.23%	79.58%	0.59%
自基金合同生效起至今	127.19%	1.77%	49.75%	1.22%	77.44%	0.55%

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：

$$\text{Return}(t) = 65\% * (\text{中国战略新兴产业成份指数}(t) / \text{中国战略新兴产业成份指数}(t-1) - 1) + 15\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$$

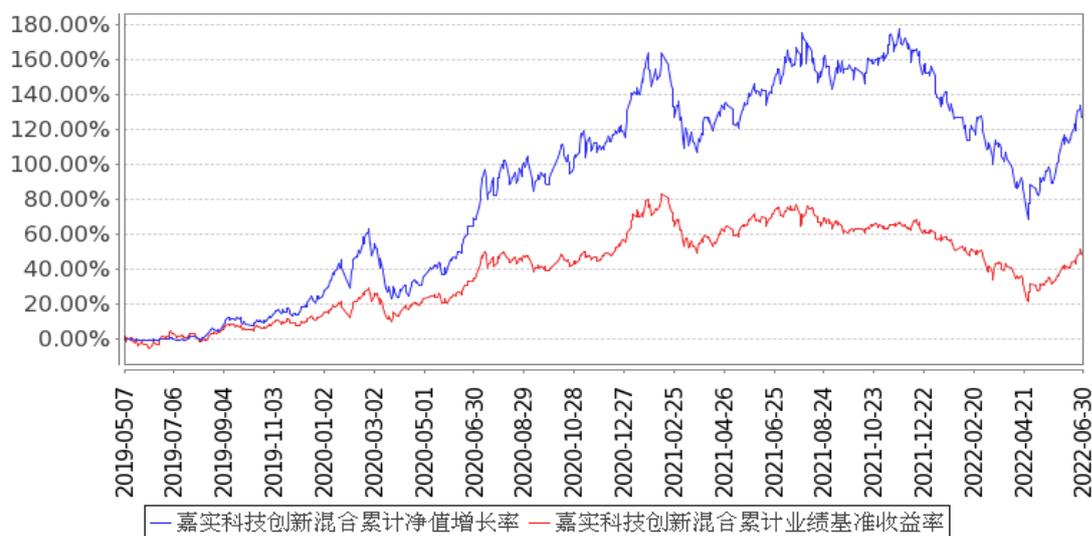
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

嘉实科技创新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05月07日至2022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2022年6月30日，基金管理人共管理277只开放式证券投资基金，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		

王 贵 重	本基金、嘉实文体娱乐股票、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实前沿创新混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实港股互联网产业核心资产混合基金经理	2019 年 5 月 7 日	-	7 年	曾任上海重阳投资管理股份有限公司 TMT 行业研究员。2015 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，历任 TMT 行业研究员、科技组组长，现任大科技研究总监。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
张 丹 华	本基金、嘉实全球互联网股票、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实前沿创新混合、嘉实创新先锋混合、嘉实港股互联网产业核心资产混合基金经理	2020 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 22 日	11 年	2011 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任研究员，现任研究部总监兼科技投资总监。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、《嘉实科技创新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 4 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，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

本基金的投资范围主要聚焦在信息、能源、生命，这三个人类本质的需求上面，寻找能够在供给侧不断提升效率，更好匹配人类需求的公司。我们始终坚信科技能够指数级的做大蛋糕，优秀企业的价值创造，未来会更好。

我们先简单回顾下今年的行业，今年市场的波动很大，更甚于 2021 年。先是 1-4 月份，行情呈现震荡下跌。下跌主要分为三个阶段，1，美债利率上升带来的杀估值，2，俄乌战争带来的滞涨担忧，3，上海疫情带来的供需冲击。从而在投资风格上进行久期的收缩，一度军工、半导体、新能源、计算机、传媒、电子普遍都有 25%以上的跌幅。5-6 月份，市场则呈现了快速的反弹，核心主线依然是能源变革，和车这个新硬件的创新平台。

回到具体行业的观点。

- 汽车的电动化和智能化。目前电动车的渗透率刚刚过 30%，产业趋势一定是不可逆的。电动化、智能化对整个 10 万亿规模的汽车产业带来的重塑，我们坚信孕育着大量的投资机会。我们可以在整个产业链环节看到大量的变化，电池环节、整车环节、车身控制器环节、电机电控、tier1、汽车芯片（模拟、数字、igbt、mcu）等等，科技投资最怕的就是没有变化，变化则意味这机会。当然，快速变化的格局，也意味这挑选机会的难度增大，但坚守有竞争力的公司还是会带来可观的收益。

- 半导体。半导体的逻辑还是国产化比例的提升，但我们同时也看到了风险。半导体行业

是一个 4-5 年为周期的行业，每次宏观的下行，配合供给的增长对带来行业的下行周期。我们从去年 7 月份以来，就认为行业进入景气的中后端，应该聚焦到国产化率比列最低的设备（15%）、材料（10%），零部件（5%）环节，目前这个观点依然不变，IC 设计环节，还是要减少暴露。当下半年出现，降价抢市场的时候，我们再买入汽车智能化相关的 IC 设计公司。

- 数字化。数字化的本质是利用技术的手段，提升组织信息计算、存储、传播的效率，这是一个长期向上的类消费行业，在美国是一个和互联网行业一样大规模的产业。在中国，依然处于产业的早期，但是我们可以看到疫情背景下，大家越来越意识到数字化的重要性。而此轮数字化将会和人工智能深度融合，也会给中国公司带来发展的机会。目前整个板块的估值都到了历史最低的水平。

- 互联网平台，互联网平台受益于网络效应，是一个顶级的商业模式，当然也带来了垄断的问题。平台型企业只看一点，就是社会的价值创造，也就是社会责任，我们有理由相信，未来会达到一个新的平衡。只要让发展，互联网平台，还是会带来很好的股东回报。

- 创新药。人类作为生命体，活的更好、活的更久就是一个永恒的追求。近期，创新药、CXO 也都有显著的跌幅，创新药公司屡屡破发。而创新药的产业链中 CXO 是中国工程师红利带来的优势，也意味着长期的增长前景依然清晰，从工程师红利到科学家红利，也孕育着本土创新药的机会。

- 其他制造业。制造业是今年的重灾区，原材料的上涨和需求的疲弱，但我认为经济全球化依然是人类福祉最大化的选择，中国作为世界工厂的比较优势依然存在。中国制造业的从大到强也会持续。其中军工的信息化国产化也会给行业带来持续的机会。其他具备全球竞争力的细分制造业龙头我们也继续看好。

另外，我们也战略性的看好港股市场，认为港股是未来 1-2 年慢牛的起点。港股市场估值依然位于历史底部区域，同时将受益于中国经济的复苏，及国际流动性的边际改善。

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 2.2719 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.35%，业绩比较基准收益率为-7.90%。

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，结构上我们更加均衡，聚焦在各个板块的龙头。我们长期聚焦的三大需求就是能源、信息、生命。从而衍生出我们看好的 5 大方向，半导体、数字化、新能源、互联网平台、创新药。我们认为各个细分行业的 beta 收敛之后，竞争力会重新成为最重要的增长要素。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：嘉实科技创新混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	174,483,829.18	127,057,635.26
结算备付金		1,339,252.18	2,611,040.63
存出保证金		423,613.80	516,264.78
交易性金融资产	6.4.7.2	1,485,878,105.60	1,615,091,414.34
其中：股票投资		1,470,429,571.33	1,599,885,324.26
基金投资		-	-
债券投资		15,448,534.27	15,206,090.08
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		-	18,150,663.45
应收股利		-	-
应收申购款		2,155,029.26	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	344,420.87
资产总计		1,664,279,830.02	1,763,771,439.33
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		8,831.78	-
应付赎回款		6,349,136.81	-

应付管理人报酬		1,954,933.38	2,288,459.90
应付托管费		325,822.24	381,410.00
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6.72	6.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,306,016.45	1,246,499.18
负债合计		9,944,747.38	3,916,376.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	728,171,276.85	686,706,026.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	926,163,805.79	1,073,149,037.31
净资产合计		1,654,335,082.64	1,759,855,063.31
负债和净资产总计		1,664,279,830.02	1,763,771,439.33

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.2719 元，基金份额总额 728,171,276.85 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实科技创新混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-208,022,306.38	139,671,718.20
1. 利息收入		404,450.56	291,622.35
其中：存款利息收入	6.4.7.13	404,450.56	291,622.35
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-179,275,720.35	94,779,030.51
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-185,505,365.46	89,638,390.22
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	58,487.75	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	6,171,157.36	5,140,640.29
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-29,396,171.25	43,515,254.75
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	245,134.66	1,085,810.59
减：二、营业总支出		13,818,802.12	15,019,476.45
1. 管理人报酬		11,727,857.17	10,220,798.97
2. 托管费		1,954,642.87	1,703,466.44
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		4.33	-
8. 其他费用	6.4.7.23	136,297.75	3,095,211.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-221,841,108.50	124,652,241.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-221,841,108.50	124,652,241.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-221,841,108.50	124,652,241.75

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实科技创新混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	686,706,026.00	-	1,073,149,037.31	1,759,855,063.31

加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	686,706,026.00	-	1,073,149,037.31	1,759,855,063.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	41,465,250.85	-	-146,985,231.52	-105,519,980.67
(一)、综合收益总额	-	-	-221,841,108.50	-221,841,108.50
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	41,465,250.85	-	74,855,876.98	116,321,127.83
其中:1.基金申购款	175,680,538.32	-	219,131,462.18	394,812,000.50
2.基金赎回款	-134,215,287.47	-	-144,275,585.20	-278,490,872.67
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值	-	-	-	-

变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	728,171,276.85	-	926,163,805.79	1,654,335,082.64
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	491,772,121.07	-	642,099,517.69	1,133,871,638.76
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	491,772,121.07	-	642,099,517.69	1,133,871,638.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	120,894,406.75	-	305,438,044.79	426,332,451.54
(一)、综合收益总额	-	-	124,652,241.75	124,652,241.75
(二)、本期基金份额交易产	120,894,406.75	-	180,785,803.04	301,680,209.79

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	300,751,821.97	-	423,271,575.06	724,023,397.03
2. 基金赎回款	-179,857,415.22	-	-242,485,772.02	-422,343,187.24
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	612,666,527.82	-	947,537,562.48	1,560,204,090.30

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

嘉实科技创新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]640号《关于准予嘉实科技创新混合型证券投资基金注册的批复》核准,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《嘉实科技创新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,《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》于2019年5月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为988,672,545.69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,基金托管人为招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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、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

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

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分

类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失

准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到

的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证券金融公司”)出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.4 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 127,057,635.26 元、2,611,040.63 元、516,264.78 元、344,420.87 元、18,150,663.45 元和 0.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 127,070,965.27 元、2,614,877.02 元、516,764.87 元、0.00 元、18,150,663.45 元和 18.64 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,615,091,414.34 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,615,418,150.08 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,288,459.90 元、381,410.00 元、1,034,499.18 元和 212,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,288,459.90 元、381,410.00 元、1,034,499.18 元和 212,000.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末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》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。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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	174,483,829.18
等于：本金	174,472,729.05
加：应计利息	11,100.13
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	174,483,829.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,248,373,287.42	-	1,470,429,571.33	222,056,283.91	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,946,910.00	213,952.17	15,448,534.27	287,672.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,946,910.00	213,952.17	15,448,534.27	287,672.10
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,263,320,197.42	213,952.17	1,485,878,105.60	222,343,956.01	

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 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,114.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,106,773.11
其中：交易所市场	1,106,773.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	197,128.42
合计	1,306,016.45

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	686,706,026.00	686,706,026.00
本期申购	175,680,538.32	175,680,538.32
本期赎回（以“-”号填列）	-134,215,287.47	-134,215,287.47
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	728,171,276.85	728,171,276.85

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
本期期初	752,374,577.89	320,774,459.42	1,073,149,037.31
本期利润	-192,444,937.25	-29,396,171.25	-221,841,108.50
本期基金份额交易产生的变动数	48,482,013.76	26,373,863.22	74,855,876.98
其中：基金申购款	178,838,332.50	40,293,129.68	219,131,462.18
基金赎回款	-130,356,318.74	-13,919,266.46	-144,275,585.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	608,411,654.40	317,752,151.39	926,163,805.79

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	348,506.01
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	46,015.35
其他	9,929.20
合计	404,450.56

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-185,505,365.46
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	-185,505,365.46

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
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,299,073,980.30
减：卖出股票成本总额	1,480,723,013.46
减：交易费用	3,856,332.30
买卖股票差价收入	-185,505,365.46

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
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	159,362.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-100,875.12
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	58,487.75

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
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,441,630.65
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	34,194,316.75
减：应计利息总额	347,774.76
减：交易费用	414.26
买卖债券差价收入	-100,875.12

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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	6,171,157.36
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	6,171,157.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-29,396,171.25

股票投资	-29,435,282.07
债券投资	39,110.82
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	-29,396,171.25

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	201,202.66
基金转出费收入	43,932.00
合计	245,134.66

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 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	45,621.05
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	15,651.68
债券托管账户维护费	9,000.00
深港通证券组合费	5,291.03
存托服务费	1,226.62
合计	136,297.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,727,857.17	10,220,798.97
其中：支付销售机构的客户维护费	3,704,663.46	444,336.07

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,954,642.87	1,703,466.44

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	4,412,426.64	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,412,426.64	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.61%	-

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
招商银行股份有限公司_活期	174,483,829.18	348,506.01	120,404,045.04	241,846.36

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(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2022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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年3月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-

301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年4月11日	6个月	新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	6个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个月	新股锁定	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股锁定	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股锁定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-

		日									
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68		-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股锁定	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80		-
301217	铜冠铜箔	2022年1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	4,284	73,984.68	63,531.72		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	535	51,672.06	46,983.70		-
301220	亚香股份	2022年6月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
301222	浙江	2022年	6个月	新股锁	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-

	恒威	3月2日		定							
301233	盛帮股份	2022年6月24日	1个月内(含)	新发未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股锁定	72.88	31.38	1,722	83,666.24	54,036.36		-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新发未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80		-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75		-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60		-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02		-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76		-
301286	侨源股份	2022年6月6日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-

301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股锁定	82.79	65.19	6,759	559,577.61	440,619.21	-
688400	凌云光	2022年6月27日	1个月内(含)	新发未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-

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通过精选个股和严格的风险控制，追求基金长期资产增值。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 risk 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，将风险控制可在可承受的范围内。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	1,060,511.95	1,019,253.28
未评级	-	-
合计	1,060,511.95	1,019,253.28

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	174,483,829.18	-	-	-	174,483,829.18
结算备付金	1,339,252.18	-	-	-	1,339,252.18
存出保证金	423,613.80	-	-	-	423,613.80
交易性金融资产	14,388,022.32	-	1,060,511.95	1,470,429,571.33	1,485,878,105.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,155,029.26	2,155,029.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	190,634,717.48	-	1,060,511.95	1,472,584,600.59	1,664,279,830.02
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	-	-	-	8,831.78	8,831.78
应付赎回款	-	-	-	6,349,136.81	6,349,136.81
应付管理人报酬	-	-	-	1,954,933.38	1,954,933.38
应付托管费	-	-	-	325,822.24	325,822.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	6.72	6.72

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,306,016.45	1,306,016.45
负债总计	-	-	-	9,944,747.38	9,944,747.38
利率敏感度缺口	190,634,717.48	-	1,060,511.95	1,462,639,853.21	1,654,335,082.64
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	127,057,635.26	-	-	-	127,057,635.26
结算备付金	2,611,040.63	-	-	-	2,611,040.63
存出保证金	516,264.78	-	-	-	516,264.78
交易性金融资产	14,186,836.80	-	1,019,253.28	1,599,885,324.26	1,615,091,414.34
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	18,150,663.45	18,150,663.45
应收利息	-	-	-	344,420.87	344,420.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	144,371,777.47	-	1,019,253.28	1,618,380,408.58	1,763,771,439.33
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,288,459.90	2,288,459.90
应付托管费	-	-	-	381,410.00	381,410.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,034,499.18	1,034,499.18
应付税费	-	-	-	6.94	6.94
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	212,000.00	212,000.00
负债总计	-	-	-	3,916,376.02	3,916,376.02
利率敏感度缺口	144,371,777.47	-	1,019,253.28	1,614,464,032.56	1,759,855,063.31

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-25,292.20	-16,193.45
	市场利率下降 25 个基点	25,524.19	16,432.20

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 2022年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	471,485,728.24	-	471,485,728.24
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-

其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	471,485,728.24	-	471,485,728.24
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	-	471,485,728.24	-	471,485,728.24
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	47,381,886.33	-	47,381,886.33
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算	-	-	-	-

款				
其它资产	-	-	-	-
资产合计	-	47,381,886.33	-	47,381,886.33
以外币计价的 负债				
应付证券清算 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	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	47,381,886.33	-	47,381,886.33

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月 31日）
分析	所有外币相对人民 币升值 5%	23,574,286.41	2,369,094.32
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-23,574,286.41	-2,369,094.32

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	1,470,429,571.33	88.88	1,599,885,324.26	90.91
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	1,470,429,571.33	88.88	1,599,885,324.26	90.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	105,745,439.19	104,595,180.51
	业绩比较基准下降5%	-105,745,439.19	-104,595,180.51

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,469,117,425.69	1,566,013,760.58
第二层次	15,395,017.16	49,077,653.76
第三层次	1,365,662.75	-
合计	1,485,878,105.60	1,615,091,414.34

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

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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>》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

§ 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	1,470,429,571.33	88.35
	其中：股票	1,470,429,571.33	88.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,448,534.27	0.93
	其中：债券	15,448,534.27	0.93
	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	175,823,081.36	10.56
8	其他各项资产	2,578,643.06	0.15
9	合计	1,664,279,830.02	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 471,485,728.24 元，占基金资产净值的比例为 28.50%。

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	55,599.00	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	877,247,348.69	53.03
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	923,952.38	0.06
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	77,167,651.06	4.66
J	金融业	3,669,284.00	0.22

K	房地产业	10,202,010.00	0.62
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	28,693,923.11	1.73
N	水利、环境和公共设施管理业	565,082.26	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	385,422.91	0.02
R	文化、体育和娱乐业	13,609.90	0.00
S	综合	-	-
	合计	998,943,843.09	60.38

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	165,609,373.61	10.01
非必需消费品	127,831,355.36	7.73
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	36,311,367.40	2.19
医疗保健	135,544,450.80	8.19
工业	-	-
信息技术	6,189,181.07	0.37
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	471,485,728.24	28.50

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	002415	海康威视	4,109,813	148,775,230.60	8.99
2	300750	宁德时代	274,967	146,832,378.00	8.88
3	002475	立讯精密	3,795,789	128,259,710.31	7.75
4	3690 HK	美团-W	748,800	124,359,130.02	7.52
5	002812	恩捷股份	370,132	92,699,559.40	5.60
6	1024 HK	快手-W	1,100,000	82,217,966.60	4.97
7	1801 HK	信达生物	2,587,000	77,211,940.90	4.67
8	700 HK	腾讯控股	250,200	75,830,449.87	4.58
9	002025	航天电器	987,000	68,912,340.00	4.17
10	300666	江丰电子	980,245	59,794,945.00	3.61
11	2269 HK	药明生物	950,000	58,332,509.90	3.53
12	603659	璞泰来	632,504	53,383,337.60	3.23
13	300496	中科创达	312,728	40,804,749.44	2.47
14	300037	新宙邦	736,540	38,712,542.40	2.34

15	388 HK	香港交易所	110,000	36,311,367.40	2.19
16	300395	菲利华	800,550	36,024,750.00	2.18
17	002594	比亚迪	101,001	33,682,823.49	2.04
18	603259	药明康德	255,600	26,579,844.00	1.61
19	688368	晶丰明源	85,409	13,653,482.74	0.83
20	002179	中航光电	169,385	10,725,458.20	0.65
21	600641	万业企业	523,180	10,202,010.00	0.62
22	688083	中望软件	41,061	8,598,994.62	0.52
23	002410	广联达	155,300	8,454,532.00	0.51
24	002028	思源电气	218,521	7,792,458.86	0.47
25	603501	韦尔股份	43,300	7,492,199.00	0.45
26	772 HK	阅文集团	200,000	6,482,340.20	0.39
27	002384	东山精密	275,900	6,326,387.00	0.38
28	909 HK	明源云	355,000	3,813,121.17	0.23
29	002484	江海股份	158,600	3,701,724.00	0.22
30	300059	东方财富	144,460	3,669,284.00	0.22
31	268 HK	金蝶国际	151,000	2,376,059.90	0.14
32	1797 HK	新东方在线	130,500	2,102,587.24	0.13
33	688032	禾迈股份	2,365	2,059,915.00	0.12
34	688388	嘉元科技	24,161	2,050,544.07	0.12
35	688037	芯源微	11,917	1,727,607.49	0.10
36	688297	中无人机	30,839	1,640,018.02	0.10
37	688246	嘉和美康	49,551	1,321,029.66	0.08
38	301238	瑞泰新材	34,966	1,296,327.26	0.08
39	2333 HK	长城汽车	89,000	1,228,446.23	0.07
40	300369	绿盟科技	113,994	1,199,216.88	0.07
41	688120	华海清科	4,822	1,197,784.80	0.07
42	688349	三一重能	28,601	1,165,490.75	0.07
43	688326	经纬恒润	6,832	1,004,713.92	0.06
44	3888 HK	金山软件	34,000	889,739.68	0.05
45	688019	安集科技	4,052	862,751.84	0.05
46	688072	拓荆科技	5,300	822,030.00	0.05
47	688047	龙芯中科	8,345	768,991.75	0.05
48	688331	荣昌生物	15,915	744,185.40	0.04
49	301099	雅创电子	8,867	740,217.16	0.04
50	603906	龙蟠科技	19,200	709,248.00	0.04
51	688385	复旦微电	8,986	585,797.34	0.04
52	688091	上海谊众	3,294	525,063.60	0.03
53	688295	中复神鹰	13,998	524,785.02	0.03
54	688105	诺唯赞	6,180	524,682.00	0.03
55	688234	天岳先进	6,759	440,619.21	0.03
56	688279	峰岬科技	5,505	406,929.60	0.02

57	688772	珠海冠宇	12,960	397,872.00	0.02
58	688153	唯捷创芯	7,674	391,374.00	0.02
59	688131	皓元医药	2,737	388,900.33	0.02
60	688337	普源精电	6,563	381,179.04	0.02
61	688207	格灵深瞳	13,391	380,304.40	0.02
62	300973	立高食品	3,593	373,492.35	0.02
63	301150	中一科技	4,026	365,898.42	0.02
64	688046	药康生物	12,070	353,651.00	0.02
65	688238	和元生物	12,836	349,909.36	0.02
66	688162	巨一科技	5,671	323,303.71	0.02
67	688639	华恒生物	2,302	303,127.36	0.02
68	688167	炬光科技	2,014	299,582.50	0.02
69	688119	中钢洛耐	33,327	293,944.14	0.02
70	688151	华强科技	12,238	292,121.06	0.02
71	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
72	301302	华如科技	4,651	282,999.62	0.02
73	688182	灿勤科技	18,387	270,840.51	0.02
74	688045	必易微	3,939	264,622.02	0.02
75	688306	均普智能	47,094	260,429.82	0.02
76	688733	壹石通	3,409	250,186.51	0.02
77	688665	四方光电	1,687	249,676.00	0.02
78	688800	瑞可达	1,967	248,451.77	0.02
79	688325	赛微微电	4,039	247,186.80	0.01
80	688776	国光电气	1,447	245,975.53	0.01
81	301268	铭利达	6,407	243,766.07	0.01
82	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
83	688190	云路股份	3,026	235,271.50	0.01
84	301187	欧圣电气	8,759	228,329.22	0.01
85	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
86	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.01
87	688209	英集芯	6,822	208,753.20	0.01
88	301162	国能日新	3,331	201,609.02	0.01
89	688711	宏微科技	2,611	199,219.30	0.01
90	301153	中科江南	3,973	196,933.29	0.01
91	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
92	300834	星辉环材	6,349	191,974.69	0.01
93	301101	明月镜片	3,703	190,074.99	0.01
94	2400 HK	心动公司	10,800	188,877.26	0.01
95	688211	中科微至	4,501	183,325.73	0.01
96	301120	新特电气	10,311	182,450.94	0.01
97	688206	概伦电子	6,000	182,400.00	0.01
98	688125	安达智能	3,774	179,415.96	0.01

99	300957	贝泰妮	814	177,069.42	0.01
100	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.01
101	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.01
102	688212	澳华内镜	3,496	163,612.80	0.01
103	688766	普冉股份	986	160,846.18	0.01
104	301212	联盛化学	4,158	155,441.76	0.01
105	688290	景业智能	3,040	154,736.00	0.01
106	688282	理工导航	3,185	152,784.45	0.01
107	688265	南模生物	2,374	152,007.22	0.01
108	301168	通灵股份	3,281	147,907.48	0.01
109	688161	威高骨科	3,069	147,895.11	0.01
110	301136	招标股份	7,172	143,081.40	0.01
111	688173	希荻微	4,236	142,117.80	0.01
112	688251	井松智能	3,392	141,853.44	0.01
113	1765 HK	希望教育	254,000	141,191.87	0.01
114	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.01
115	301180	万祥科技	6,536	136,929.20	0.01
116	688767	博拓生物	2,220	136,885.20	0.01
117	301190	善水科技	5,741	136,233.93	0.01
118	688097	博众精工	3,983	135,621.15	0.01
119	301148	嘉戎技术	5,153	133,358.10	0.01
120	603113	金能科技	12,000	132,720.00	0.01
121	301258	富士莱	2,942	132,548.81	0.01
122	301097	天益医疗	2,486	130,023.27	0.01
123	301100	风光股份	5,985	129,156.30	0.01
124	301199	迈赫股份	4,014	128,608.56	0.01
125	688150	莱特光电	5,626	125,122.24	0.01
126	688049	炬芯科技	3,260	124,075.60	0.01
127	688225	亚信安全	5,534	124,072.28	0.01
128	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.01
129	301179	泽宇智能	2,941	120,022.21	0.01
130	688670	金迪克	2,310	116,932.20	0.01
131	688625	呈和科技	2,672	116,606.08	0.01
132	688257	新锐股份	2,899	114,858.38	0.01
133	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.01
134	301137	哈焊华通	6,431	111,743.67	0.01
135	301078	孩子王	7,551	110,697.66	0.01
136	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.01
137	301196	唯科科技	2,705	102,319.16	0.01
138	301163	宏德股份	2,764	101,994.08	0.01
139	301222	浙江恒威	3,315	101,431.46	0.01
140	688175	高凌信息	2,851	96,477.84	0.01

141	301135	瑞德智能	3,376	96,066.48	0.01
142	301155	海力风电	1,054	95,914.00	0.01
143	301130	西点药业	2,370	94,254.90	0.01
144	688163	赛伦生物	3,607	89,814.30	0.01
145	688227	品高股份	4,164	89,192.88	0.01
146	688193	仁度生物	1,635	88,453.50	0.01
147	301138	华研精机	2,849	87,606.75	0.01
148	688661	和林微纳	1,452	87,061.92	0.01
149	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.01
150	300263	隆华科技	9,663	86,580.48	0.01
151	301110	青木股份	2,013	86,466.00	0.01
152	688509	正元地信	15,433	83,183.87	0.01
153	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.00
154	688103	国力股份	1,595	81,536.40	0.00
155	688613	奥精医疗	2,617	80,969.98	0.00
156	301193	家联科技	2,970	80,635.50	0.00
157	688236	春立医疗	4,052	80,229.60	0.00
158	301133	金钟股份	2,860	79,422.20	0.00
159	301158	德石股份	3,783	78,697.42	0.00
160	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.00
161	688283	坤恒顺维	1,595	76,033.65	0.00
162	300919	中伟股份	610	75,579.00	0.00
163	301279	金道科技	2,956	73,863.56	0.00
164	301182	凯旺科技	2,932	69,664.32	0.00
165	688786	悦安新材	1,513	68,992.80	0.00
166	688768	容知日新	907	68,551.06	0.00
167	300979	华利集团	925	67,599.00	0.00
168	688210	统联精密	3,105	67,285.35	0.00
169	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
170	688319	欧林生物	3,412	64,452.68	0.00
171	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
172	688799	华纳药厂	1,917	61,631.55	0.00
173	301081	严牌股份	4,024	60,681.92	0.00
174	688329	艾隆科技	1,846	59,718.10	0.00
175	688216	气派科技	2,000	57,720.00	0.00
176	301072	中捷精工	1,802	57,718.06	0.00
177	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.00
178	300972	万辰生物	4,300	55,599.00	0.00
179	688718	唯赛勃	3,145	55,414.90	0.00
180	301236	软通动力	1,722	54,036.36	0.00
181	688656	浩欧博	1,371	53,647.23	0.00
182	301035	润丰股份	644	53,097.80	0.00

183	688314	康拓医疗	1,085	52,676.75	0.00
184	688316	青云科技	1,428	51,493.68	0.00
185	688255	凯尔达	1,648	50,923.20	0.00
186	688071	华依科技	1,101	50,910.24	0.00
187	688607	康众医疗	1,890	48,535.20	0.00
188	688468	科美诊断	3,919	48,321.27	0.00
189	301219	腾远钴业	535	46,983.70	0.00
190	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
191	301050	雷电微力	419	42,553.64	0.00
192	688622	禾信仪器	1,204	41,200.88	0.00
193	301087	可孚医疗	916	39,058.24	0.00
194	000938	紫光股份	1,957	37,965.80	0.00
195	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
196	301053	远信工业	1,544	36,067.84	0.00
197	301068	大地海洋	1,436	34,679.40	0.00
198	301079	邵阳液压	1,396	34,620.80	0.00
199	688367	工大高科	1,717	34,391.51	0.00
200	688517	金冠电气	2,892	33,662.88	0.00
201	688272	富吉瑞	1,263	33,545.28	0.00
202	688226	威腾电气	2,693	33,527.85	0.00
203	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
204	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
205	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
206	301090	华润材料	2,764	30,155.24	0.00
207	688038	中科通达	2,132	29,911.96	0.00
208	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.00
209	300981	中红医疗	1,082	27,288.04	0.00
210	688501	青达环保	1,759	27,071.01	0.00
211	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
212	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
213	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
214	301039	中集车辆	2,064	22,353.12	0.00
215	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
216	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
217	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
218	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.00
219	301127	天源环保	1,843	20,512.59	0.00
220	301018	申菱环境	782	20,183.42	0.00
221	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
222	300902	国安达	551	19,510.91	0.00
223	301091	深城交	681	18,591.30	0.00
224	301149	隆华新材	1,214	18,586.34	0.00

225	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
226	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
227	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
228	300890	翔丰华	286	15,821.52	0.00
229	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
230	300909	汇创达	579	14,886.09	0.00
231	301189	奥尼电子	445	14,822.95	0.00
232	300925	法本信息	1,236	14,770.20	0.00
233	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
234	301093	华兰股份	409	13,861.01	0.00
235	300994	久祺股份	420	13,780.20	0.00
236	300986	志特新材	370	13,616.00	0.00
237	300932	三友联众	689	12,670.71	0.00
238	300997	欢乐家	928	12,398.08	0.00
239	300940	南极光	491	11,553.23	0.00
240	301126	达嘉维康	662	11,340.06	0.00
241	300895	铜牛信息	373	10,824.46	0.00
242	301111	粤万年青	379	10,392.18	0.00
243	301092	争光股份	330	10,381.80	0.00
244	301046	能辉科技	290	10,036.90	0.00
245	301009	可靠股份	801	9,996.48	0.00
246	301015	百洋医药	462	9,969.96	0.00
247	300993	玉马遮阳	738	9,431.64	0.00
248	300933	中辰股份	1,112	9,062.80	0.00
249	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
250	301021	英诺激光	290	8,758.00	0.00
251	300962	中金辐照	576	8,697.60	0.00
252	300966	共同药业	286	8,537.10	0.00
253	300985	致远新能	295	8,466.50	0.00
254	301013	利和兴	706	8,464.94	0.00
255	300926	博俊科技	359	8,382.65	0.00
256	301052	果麦文化	252	8,298.36	0.00
257	301028	东亚机械	733	7,931.06	0.00
258	300937	药易购	244	7,812.88	0.00
259	300978	东箭科技	593	7,738.65	0.00
260	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
261	300945	曼卡龙	474	7,621.92	0.00
262	301026	浩通科技	203	7,486.64	0.00
263	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
264	301038	深水规院	346	7,193.34	0.00
265	301012	扬电科技	170	6,971.70	0.00
266	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00

267	301066	万事利	482	6,873.32	0.00
268	300927	江天化学	391	6,764.30	0.00
269	301002	崧盛股份	261	6,491.07	0.00
270	300998	宁波方正	201	6,080.25	0.00
271	300971	博亚精工	245	6,039.25	0.00
272	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
273	300943	春晖智控	382	6,001.22	0.00
274	300991	创益通	406	5,838.28	0.00
275	301011	华立科技	175	5,755.75	0.00
276	300955	嘉亨家化	232	5,688.64	0.00
277	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
278	301010	晶雪节能	218	5,526.30	0.00
279	300963	中洲特材	283	5,484.54	0.00
280	300950	德固特	328	5,346.40	0.00
281	300961	深水海纳	394	5,342.64	0.00
282	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
283	300931	通用电梯	672	5,194.56	0.00
284	300948	冠中生态	324	5,141.88	0.00
285	301016	雷尔伟	275	5,128.75	0.00
286	301056	森赫股份	572	4,953.52	0.00
287	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
288	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
289	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
290	301007	德迈仕	303	4,566.21	0.00
291	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
292	300960	通业科技	234	4,380.48	0.00
293	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
294	300992	泰福泵业	200	4,262.00	0.00
295	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
296	300995	奇德新材	191	4,087.40	0.00
297	300929	华骐环保	293	4,028.75	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	002415	海康威视	118,324,513.11	6.72
2	3690 HK	美团-W	88,438,089.93	5.03
3	002812	恩捷股份	86,829,103.60	4.93
4	700 HK	腾讯控股	72,651,717.11	4.13
5	002594	比亚迪	69,348,103.65	3.94
6	1024 HK	快手-W	66,599,282.66	3.78

7	2269 HK	药明生物	60,200,141.13	3.42
8	603501	韦尔股份	56,712,338.12	3.22
9	1801 HK	信达生物	55,775,657.87	3.17
10	603259	药明康德	55,390,547.16	3.15
11	002179	中航光电	53,911,798.59	3.06
12	603659	璞泰来	52,492,890.44	2.98
13	002475	立讯精密	43,559,159.45	2.48
14	002025	航天电器	40,934,122.39	2.33
15	002384	东山精密	37,865,807.20	2.15
16	300390	天华超净	37,688,217.24	2.14
17	388 HK	香港交易所	34,473,829.99	1.96
18	600406	国电南瑞	28,154,043.72	1.60
19	300496	中科创达	25,236,857.22	1.43
20	002028	思源电气	21,409,948.79	1.22

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	002371	北方华创	84,346,364.81	4.79
2	600563	法拉电子	70,762,737.88	4.02
3	002938	鹏鼎控股	66,893,083.35	3.80
4	002594	比亚迪	57,087,240.82	3.24
5	300390	天华超净	55,077,862.80	3.13
6	002179	中航光电	53,945,586.69	3.07
7	603799	华友钴业	52,637,326.78	2.99
8	600905	三峡能源	44,923,252.93	2.55
9	603501	韦尔股份	44,614,037.46	2.54
10	300263	隆华科技	43,670,713.35	2.48
11	688037	芯源微	42,851,451.60	2.43
12	603259	药明康德	39,134,149.66	2.22
13	301099	雅创电子	37,626,929.89	2.14
14	600862	中航高科	37,006,508.71	2.10
15	600641	万业企业	34,705,264.06	1.97
16	601985	中国核电	32,097,743.00	1.82
17	600406	国电南瑞	28,777,219.60	1.64
18	002025	航天电器	24,111,949.27	1.37
19	002384	东山精密	23,844,156.00	1.35
20	688286	敏芯股份	19,679,274.35	1.12

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	1,380,702,542.60
卖出股票收入（成交）总额	1,299,073,980.30

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	14,388,022.32	0.87
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）	1,060,511.95	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,448,534.27	0.93

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	019664	21 国债 16	141,550	14,388,022.32	0.87
2	123123	江丰转债	7,636	1,060,511.95	0.06

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

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	423,613.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,155,029.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,578,643.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123123	江丰转债	1,060,511.95	0.06

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 (%)
176,124	4,134.42	171,244,308.34	23.52	556,926,968.51	76.48

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	1,546,604.64	0.21

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	50~100
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 (2019 年 5 月 7 日) 基金份额总额	988,672,545.69
本报告期期初基金份额总额	686,706,026.00
本报告期基金总申购份额	175,680,538.32
减：本报告期基金总赎回份额	134,215,287.47
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	728,171,276.85

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

2022 年 1 月 22 日本基金管理人发布《关于嘉实科技创新混合基金经理变更的公告》，张丹华先生不再担任本基金基金经理职务，由王贵重先生单独管理本基金。

2022 年 5 月 12 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

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 (%)	
东吴证券股份有限公司	2	973,882,042.49	36.67	614,816.06	35.72	-
中信建投证券股份有限公司	2	568,766,173.95	21.42	368,080.25	21.38	-
长江证券股份有限公司	2	508,369,654.39	19.14	338,325.31	19.66	-
中国国际金融股份有限公司	1	206,207,297.50	7.77	144,345.10	8.39	-
华创证券有限责任公司	2	144,695,323.60	5.45	91,347.93	5.31	-
方正证券股份有限公司	2	81,082,897.65	3.05	51,187.79	2.97	-
中信证券	2	67,932,318.1	2.56	42,885.58	2.49	-

股份有限 公司		9				
大同证券 有限责任 公司	2	62,944,106.1 9	2.37	44,061.21	2.56	-
南京证券 股份有限 公司	1	41,558,871.3 0	1.57	26,236.52	1.52	-
安信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	4	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

证券股份 有限公司						
--------------	--	--	--	--	--	--

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，本基金新增以下交易单元：首创证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，华鑫证券有限责任公司新增交易单元 1 个，民生证券股份有限公司新增交易单元 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 (%)
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	14,183,310.00	100.00	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
大同证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
南京证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华鑫证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
首创证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
五矿证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 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 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	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	2022 年 1 月 21 日
2	关于嘉实科技创新混合基金经理变更的公告	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	2022 年 1 月 22 日
3	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	2022 年 5 月 12 日
4	关于调整北京雪球基金销售有限公司代销嘉实旗下部分基金最低持有和最低赎回份额的公告	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	2022 年 5 月 30 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实科技创新混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实科技创新混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实科技创新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) 报告期内嘉实科技创新混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2022 年 8 月 29 日