

嘉实海外中国股票混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在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 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外资产托管人	5
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	38
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	38

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	38
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	42
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	45
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	45
7.11 投资组合报告附注	45
§8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	60
§11 备查文件目录	60
11.1 备查文件目录	60
11.2 存放地点	61
11.3 查阅方式	61

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实海外中国股票混合型证券投资基金
基金简称	嘉实海外中国股票混合(QDII)
基金主代码	070012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月12日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,532,803,883.88份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分散投资风险，获取中长期稳定收益
投资策略	本基金基于对宏观经济形势、财政/货币政策、以及相关股票市场等因素的综合分析和预测，进行自上而下的资产配置，和自下而上的精选投资品种。具体策略包括：大类资产配置、股票投资的板块/行业配置、证券选择、币种配置及外汇管理。
业绩比较基准	MSCI 中国指数
风险收益特征	较高风险、较高收益

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100020	100818
法定代表人		经雷	葛海蛟

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦

办公地址	香港花园道 1 号中银大厦
邮政编码	-

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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

2.6 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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-65,831,138.15
本期利润	-211,446,251.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0827
本期加权平均净值利润率	-11.76%
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(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-890,823,981.75
期末可供分配基金份额利润	-0.3517
期末基金资产净值	1,641,979,902.13
期末基金份额净值	0.648
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-35.09%

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

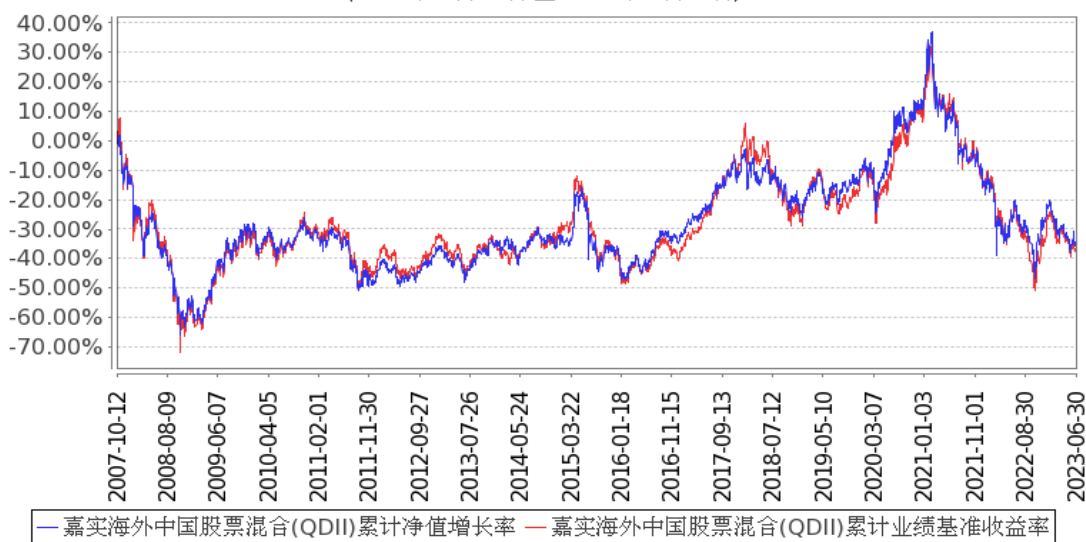
阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	4.35%	1.54%	3.38%	1.59%	0.97%	-0.05%
过去三个月	-8.60%	1.29%	-10.77%	1.30%	2.17%	-0.01%
过去六个月	-11.35%	1.41%	-6.05%	1.47%	-5.30%	-0.06%
过去一年	-17.66%	1.77%	-18.61%	1.83%	0.95%	-0.06%
过去三年	-34.44%	1.81%	-30.71%	1.83%	-3.73%	-0.02%
自基金合同生效起 至今	-35.09%	1.58%	-37.39%	1.75%	2.30%	-0.17%

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

嘉实海外中国股票混合(QDII)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

(2007年10月12日至2023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 2023 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 314 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		
胡 宇 飞	本基金、 嘉实核心 优 势 股 票、嘉实 优势精选 混合、嘉 实蓝筹优 势混合基 金经理	2021 年 7 月 24 日	-	12 年	曾就职于海通证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、观富（北京）资产管理有限公司、上投摩根基金管理有限公司，先后担任 A 股、港股行业研究员、投资经理，2017 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司，从事股票投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实海外中国股票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 6 次，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，沪深 300 持平微跌 0.8%，香港恒生指数跌 4.4%，恒生科技指数跌 5.3%，中国股票宽基指数先扬后抑，大宗商品价格的走势也大体类似，人民币汇率贬值。

A 股和海外中国股票于去年 10 月见底，11 月进入上升周期，以优质资产为代表的蓝筹股反弹凌厉，到春节后开始休整，进入二季度，国内宏观经济动能衰减速度较快，“三驾马车”消费、投资、出口均呈现趋势性回落，房地产市场重回低迷，青年失业率仍处高位，经济预期转弱，股指随之回调明显，投资者在二季度下修了大部分行业公司的业绩预期，蓝筹股普遍回吐了年初的涨幅，其中业绩不扎实、前期估值偏贵的部分股票跌破前期低点。

国际方面，美国经济表现出韧性，美债收益率维持高位，中美利差进一步扩大，对人民币汇率造成了压力，美国三大股指走势强劲，在 AI 创新周期的驱动下，超大型科技公司领涨美股。反应到国内，上半年股价表现较强的个股是美国科技供应链的部分公司，或是美国科技股的主题映射型标的，此外，高股息的国央企在整体疲弱的市场里展现出了较强的防御性，上半年表现优于大盘。

在投资实践中，我们努力精进。回顾过往，我们偏好行业前景良好，商业模式有壁垒，具备竞争优势、进而有能力在中长期实现较高投入资本回报率的公司，简言之，我们更喜欢买“中长期维度的好生意”；投资决策时，通常不对短期景气度赋予明显的权重，公司的估值水平在区间内时高时低，更多的是市场对短期趋势和情绪综合定价的结果，我们对这类波动的容忍度相对较高。这两年投资所面对的内外部环境复杂多变，我们的投资过程也被市场反复考验、挑战，反思过后，我们对投资好生意的偏好没有变，试图精进的是，在投资决策时，更为重视对合理预期回报的预判，进而优化持仓的成本和在投资组合中的比重。与此同时，我们关注更广泛的行业公司的投资机会，对处于深度折价的资产给予更多的关注和耐心，希望能为投资组合创造更多的阿尔法源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.648 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-6.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济疫后复苏的方向是确定的，居民和企业修复资产负债表则需要更多时间，这在客观上，表现为复苏在斜率上和节奏上的平缓。进入 6 月以来，政府屡次表态促进居民消费、维护房

地产市场健康发展，近期的政治局会议进一步明确了对于内需消费、地产合理需求、地方债务化解、资本市场的支持态度，后续落地的政策的力度有望增强。目前多数行业公司的估值水平处于低位，不少资产负债表坚实、具备竞争优势的公司估值偏低，优质公司的预期回报率是有吸引力的。

上半年，我们基本维持了投资组合中的长期持仓，根据预期回报的变化做了个别调整。组合增持的行业包括保险、教育、工业金属、汽车，部分处于低位的医药股，对于竞争趋于激烈的细分领域我们保持谨慎，减少了相关的持仓暴露。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实海外中国股票混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

报告截止日：2023年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	113,052,842.93	197,929,430.74
结算备付金		—	—
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	1,510,327,075.69	1,708,310,366.10
其中：股票投资		1,510,327,075.69	1,708,310,366.10
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		15,659,472.80	5,662,466.14
应收股利		7,803,341.66	587,180.95
应收申购款		174,651.32	146,221.71
递延所得税资产		—	—

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,647,017,384.40	1,912,635,665.64
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	13,480,469.18
应付赎回款		2,043,816.65	1,031,838.87
应付管理人报酬		2,471,691.74	2,849,615.56
应付托管费		411,948.64	474,935.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	110,025.24	221,964.70
负债合计		5,037,482.27	18,058,824.24
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	2,532,803,883.88	2,590,204,606.43
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-890,823,981.75	-695,627,765.03
净资产合计		1,641,979,902.13	1,894,576,841.40
负债和净资产总计		1,647,017,384.40	1,912,635,665.64

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.648 元，基金份额总额 2,532,803,883.88 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-192,516,472.16	-173,467,666.59
1. 利息收入		20,639.45	54,646.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,639.45	54,646.34
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）		-50,024,050.36	-2,629,403.11
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-70,895,455.25	-16,245,932.83
基金投资收益	6.4.7.15	-	-
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	20,871,404.89	13,616,529.72
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）	6.4.7.21	-145,615,113.59	-177,100,604.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		3,083,571.22	6,176,948.61
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	18,481.12	30,745.89
减：二、营业总支出		18,929,779.58	20,790,773.82
1. 管理人报酬		16,131,659.63	17,724,349.96
2. 托管费		2,688,609.99	2,954,058.35
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	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.24	109,509.96	112,365.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-211,446,251.74	-194,258,440.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-211,446,251.74	-194,258,440.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-211,446,251.74	-194,258,440.41

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	2,590,204,606.43	-	-695,627,765.03	1,894,576,841.40
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)	2,590,204,606.43	-	-695,627,765.03	1,894,576,841.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-57,400,722.55	-	-195,196,216.72	-252,596,939.27
(一)、综合收益总额	-	-	-211,446,251.74	-211,446,251.74
(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)	-57,400,722.55	-	16,250,035.02	-41,150,687.53
其中：1. 基金申	20,815,044.99	-	-6,165,328.59	14,649,716.40

购款				
2. 基金赎回款	-78,215,767.54	-	22,415,363.61	-55,800,403.93
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,532,803,883.88	-	-890,823,981.75	1,641,979,902.13
项目	上年度可比期间 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)	2,635,939,950.49	-	-367,812,517.27	2,268,127,433.22
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)	2,635,939,950.49	-	-367,812,517.27	2,268,127,433.22

三、本期 增 减 变 动额(减 少以“-” 号填列)	-23,995,811.59	-	-189,043,459.36	-213,039,270.95
(一)、 综 合 收 益总额	-	-	-194,258,440.41	-194,258,440.41
(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)	-23,995,811.59	-	5,214,981.05	-18,780,830.54
其中:1. 基 金 申 购 款	52,954,304.30	-	-13,816,924.59	39,137,379.71
2 . 基 金 赎 回 款	-76,950,115.89	-	19,031,905.64	-57,918,210.25
(三)、 本 期 向 基 金 份 额 持 有 人 分 配 利 润 产 生 的 基 金 净 值 变 动 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	-	-	-	-
(四)、 其 他 综 合 收 益 结 转 留 存 收 益	-	-	-	-
四、本期 期 末 净 资 产 (基	2,611,944,138.90	-	-556,855,976.63	2,055,088,162.27

金净值)				
------	--	--	--	--

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实海外中国股票混合型证券投资基金(原名为嘉实海外中国股票股票型证券投资基金,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”)证监基金字[2007]261号《关于同意嘉实海外中国股票股票型证券投资基金募集的批复》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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实海外中国股票股票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,《嘉实海外中国股票股票型证券投资基金基金合同》于2007年10月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为29,750,330,282.51份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)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》、《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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[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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 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) 目前基金取得的源自境外的其他收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行,在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(5) 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。

(6) 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 2023年6月30日
活期存款	113,052,842.93
等于: 本金	113,052,311.55
加: 应计利息	531.38
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	113,052,842.93

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,721,968,736.03	—	1,510,327,075.69	-211,641,660.34
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		1,721,968,736.03	-	1,510,327,075.69	-211,641,660.34

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 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	929.30
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	110,025.24

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,590,204,606.43	2,590,204,606.43
本期申购	20,815,044.99	20,815,044.99
本期赎回（以“-”号填列）	-78,215,767.54	-78,215,767.54
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	2,532,803,883.88	2,532,803,883.88

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	77,664,141.08	-773,291,906.11	-695,627,765.03
本期利润	-65,831,138.15	-145,615,113.59	-211,446,251.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,007,820.32	17,257,855.34	16,250,035.02
其中：基金申购款	326,552.13	-6,491,880.72	-6,165,328.59
基金赎回款	-1,334,372.45	23,749,736.06	22,415,363.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,825,182.61	-901,649,164.36	-890,823,981.75

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	20,605.53
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	-
其他	33.92
合计	20,639.45

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-70,895,455.25
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	-70,895,455.25

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	862,512,746.83
减：卖出股票成本总额	927,894,187.95
减：交易费用	5,514,014.13
买卖股票差价收入	-70,895,455.25

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

无。

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	20,871,404.89
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	20,871,404.89

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-145,615,113.59
股票投资	-145,615,113.59
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	-
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	-145,615,113.59

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	18,481.12
合计	18,481.12

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	414.02
合计	109,509.96

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中国银行（香港）有限公司	基金托管人的子公司、境外资产托管人

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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	16,131,659.63	17,724,349.96
其中：支付销售机构的客户维护费	6,027,505.57	6,098,676.87

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 1.80%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×1.80%/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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,688,609.99	2,954,058.35

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.30%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×0.30%/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

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	20,391,217.00	20,391,217.00
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	20,391,217.00	20,391,217.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.81%	0.78%

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
中国银行股份有限公司_活期	19,117,937.52	20,605.53	29,688,360.17	54,591.02
中国银行（香港）有限公司_活期	93,934,905.41	—	127,272,548.87	—

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(2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日)，本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

根据香港联合交易所有限公司于 2020 年 1 月 24 日发布的《关于中国动物保健品有限公司取消上市地位》的通告，由 2020 年 1 月 30 日上午 9 时起，中国动物保健品有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

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，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、收益的品种。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分散投资风险，获取中长期稳定收益。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同责任，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约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

2023 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	113,052,842.93	-	-	-	113,052,842.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,510,327,075.69	1,510,327,075.69
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	15,659,472.80	15,659,472.80
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	7,803,341.66	7,803,341.66
应收申购款	-	-	-	174,651.32	174,651.32
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	113,052,842.93	-	-	1,533,964,541.47	1,647,017,384.40
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	-	-	-	2,043,816.65	2,043,816.65
应付管理人报酬	-	-	-	2,471,691.74	2,471,691.74
应付托管费	-	-	-	411,948.64	411,948.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	110,025.24	110,025.24
负债总计	-	-	-	5,037,482.27	5,037,482.27
利率敏感度缺口	113,052,842.93	-	-	1,528,927,059.20	1,641,979,902.13
上年度末 2022 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	197,929,430.74	-	-	-	197,929,430.74
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	1,708,310,366.10	1,708,310,366.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	5,662,466.14	5,662,466.14
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	587,180.95	587,180.95

应收申购款	-	-	-	146,221.71	146,221.71
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	197,929,430.74	-	-	1,714,706,234.90	1,912,635,665.64
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	-	-	-	13,480,469.18	13,480,469.18
应付赎回款	-	-	-	1,031,838.87	1,031,838.87
应付管理人报酬	-	-	-	2,849,615.56	2,849,615.56
应付托管费	-	-	-	474,935.93	474,935.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	221,964.70	221,964.70
负债总计	-	-	-	18,058,824.24	18,058,824.24
利率敏感度缺口	197,929,430.74	-	-	-1,696,647,410.66	1,894,576,841.40

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，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和负债进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	117,255.87	93,817,653.56	—	93,934,909.43
结算备付金	—	—	—	—
存出保证金	—	—	—	—
交易性金融资产	58,835,567.44	1,451,491,508.25	—	1,510,327,075.69
衍生金融资产	—	—	—	—
债权投资	—	—	—	—
应收股利	—	6,110,541.66	—	6,110,541.66
应收申购款	—	—	—	—
应收清算款	—	15,659,472.80	—	15,659,472.80
其他资产	—	—	—	—
资产合计	58,952,823.31	1,567,079,176.27	—	1,626,031,999.58
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	58,952,82 3.31	1,567,079,176. 27	-	1,626,031,999.58
项目	上年度末 2022 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	43,331,31 6.54	125,083,529.20	-	168,414,845.74
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	21,711,81 1.77	1,686,598,554. 33	-	1,708,310,366.10
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	43,010.95	-	43,010.95
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	5,662,466 .14	-	-	5,662,466.14
其他资产	-	-	-	-
资产合计	70,705,59 4.45	1,811,725,094. 48	-	1,882,430,688.93
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	13,480,469.18	-	13,480,469.18
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	-	13,480,469.18	-	13,480,469.18
资产负债表外汇风险敞口净额	70,705,594.45	1,798,244,625.30	-	1,868,950,219.75

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	81,301,599.98	93,447,510.99
	所有外币相对人民币贬值 5%	-81,301,599.98	-93,447,510.99

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	1,510,327,075.69	91.98	1,708,310,366.10	90.17
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	1,510,327,075.69	91.98	1,708,310,366.10	90.17

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	75,286,241.16	87,160,192.99
	业绩比较基准下降 5%	-75,286,241.16	-87,160,192.99

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,510,327,075.69	1,708,310,366.10

第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	1,510,327,075.69	1,708,310,366.10

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	1,510,327,075.69	91.70
	其中：普通股	1,451,491,508.25	88.13
	存托凭证	58,835,567.44	3.57
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-

	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	113,052,842.93	6.86
8	其他各项资产	23,637,465.78	1.44
9	合计	1,647,017,384.40	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	1,451,491,508.25	88.40
美国	58,835,567.44	3.58
合计	1,510,327,075.69	91.98

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
金融	429,499,773.10	26.16
非必需消费品	374,153,998.80	22.79
通信服务	195,331,717.13	11.90
医疗保健	132,198,517.20	8.05
必需消费品	125,421,549.30	7.64
原材料	82,148,418.00	5.00
房地产	56,849,286.80	3.46
工业	43,408,662.36	2.64
能源	40,806,834.80	2.49
公用事业	30,508,318.20	1.86
合计	1,510,327,075.69	91.98

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 （英文）	公司名称 （中文）	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 （地区）	数量 （股）	公允价值	占基 金资 产净 值比 例（%）
1	Hong Kong Exchanges &	香港交 易所	388 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	560,000	152,414,357.76	9.28

	Clearing Ltd							
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	460,000	140,635,141.28	8.56
3	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	4,180,000	137,197,999.84	8.36
4	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	9988 HK	香港证券交易所	中国香港	1,130,000	84,597,196.88	5.15
4	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	68,473	41,239,263.15	2.51
5	China Pacific Insurance Group Co Ltd	中国太保	2601 HK	香港证券交易所	中国香港	3,800,000	70,946,361.00	4.32
6	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	1,500,000	68,941,054.50	4.20
7	Zijin Mining Group Co Ltd	紫金矿业	2899 HK	香港证券交易所	中国香港	6,500,000	68,918,005.00	4.20
8	Li Ning Co Ltd	李宁	2331 HK	香港证券交易所	中国香港	1,700,000	66,064,476.90	4.02
9	China Resources Beer Holdings Co Ltd	华润啤酒	291 HK	香港证券交易所	中国香港	1,350,000	64,225,126.80	3.91
10	China Mengniu Dairy Co Ltd	蒙牛乳业	2319 HK	香港证券交易所	中国香港	2,250,000	61,196,422.50	3.73
11	China Resources	华润置地	1109 HK	香港证券交易所	中国香港	1,600,000	48,975,577.60	2.98

	Land Ltd			所				
12	JD.com Inc	京东集团	9618 HK	香港证券交易所	中国香港	400,142	48,845,394.76	2.97
13	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际	2313 HK	香港证券交易所	中国香港	700,000	48,242,603.50	2.94
14	China Mobile Ltd	中国移动	941 HK	香港证券交易所	中国香港	650,000	38,384,332.35	2.34
15	New Oriental Education & Technology Group Inc	新东方	9901 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	28,350,885.00	1.73
15	New Oriental Education & Technology Group Inc	新东方	EDU UN	纽约证券交易所	美国	4,500	1,284,060.79	0.08
16	CNOOC Ltd	中国海洋石油	883 HK	香港证券交易所	中国香港	2,500,000	25,815,440.00	1.57
17	China Resources Gas Group Ltd	华润燃气	1193 HK	香港证券交易所	中国香港	900,000	22,238,157.60	1.35
18	AviChina Industry & Technology Co Ltd	中航科工	2357 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000,000	21,021,144.00	1.28
19	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港证券交易所	中国香港	600,000	20,772,209.40	1.27
20	Hygeia Healthcar	海吉亚医疗	6078 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	19,545,976.00	1.19

	e Holdings Co Ltd			所				
21	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港证券交易所	中国香港	300,060	17,290,582.43	1.05
22	Meituan	美团-W	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	150,000	16,913,723.10	1.03
23	Innovent Biologics Inc	信达生物	1801 HK	香港证券交易所	中国香港	601,000	16,401,655.41	1.00
24	Kanzhun Ltd	看准科技有限公司	BZ UW	纳斯达克证券交易所	美国	150,000	16,312,243.50	0.99
25	Asymchem Laboratories Tianjin Co Ltd	凯莱英	6821 HK	香港证券交易所	中国香港	200,000	16,208,408.40	0.99
26	PetroChina Co Ltd	中国石油	857 HK	香港证券交易所	中国香港	3,000,000	14,991,394.80	0.91
27	Great Wall Motor Co Ltd	长城汽车	2333 HK	香港证券交易所	中国香港	1,800,000	14,886,289.08	0.91
28	China State Construction International Holdings Ltd	中国建筑国际	3311 HK	香港证券交易所	中国香港	1,800,000	14,819,906.52	0.90
29	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	石药集团	1093 HK	香港证券交易所	中国香港	2,300,000	14,440,972.74	0.88
30	XPeng Inc	小鹏汽车	9868 HK	香港证券交易所	中国香港	300,000	13,829,700.00	0.84
31	CMOC Group Ltd	洛阳栾川钼业集团股	3993 HK	香港证券交易所	中国香港	3,500,000	13,230,413.00	0.81

		份有限公司						
32	AK Medical Holdings Ltd	爱康医疗	1789 HK	香港证券交易所	中国香港	2,100,000	13,165,874.40	0.80
33	Angelalign Technology Inc	时代天使	6699 HK	香港证券交易所	中国香港	162,000	10,910,803.52	0.66
34	Bosideng International Holdings Ltd	波司登	3998 HK	香港证券交易所	中国香港	3,254,000	9,900,405.64	0.60
35	China Gas Holdings Ltd	中国燃气	384 HK	香港证券交易所	中国香港	1,000,000	8,270,160.60	0.50
36	China Overseas Land & Investment Ltd	中国海外发展	688 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	7,873,709.20	0.48
37	Sany Heavy Equipment International Holdings Co Ltd	三一国际	631 HK	香港证券交易所	中国香港	800,000	7,567,611.84	0.46
38	Arrail Group Ltd	瑞尔集团有限公司	6639 HK	香港证券交易所	中国香港	500,000	3,462,034.90	0.21
39	China Animal Healthcare Ltd	中国动物保健品	940 HK	香港证券交易所	中国香港	6,387,000	-	-

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	----------	------	----------	----------------

1	China Pacific Insurance Group Co Ltd	2601 HK	81,286,125.75	4.29
2	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	75,854,731.29	4.00
3	Alibaba Group Holding Ltd	BABA UN	51,630,762.80	2.73
3	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	6,887,593.21	0.36
4	China Mobile Ltd	941 HK	39,861,999.87	2.10
5	Huaneng Power International Inc	902 HK	35,417,778.78	1.87
6	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	35,356,378.22	1.87
7	New Oriental Education & Technology Group Inc	9901 HK	29,079,697.08	1.53
7	New Oriental Education & Technology Group Inc	EDU UN	1,330,752.72	0.07
8	CNOOC Ltd	883 HK	25,755,191.25	1.36
9	Hygeia Healthcare Holdings Co Ltd	6078 HK	25,157,109.04	1.33
10	China Mengniu Dairy Co Ltd	2319 HK	24,467,101.80	1.29
11	Li Ning Co Ltd	2331 HK	22,933,460.85	1.21
12	China Resources Gas Group Ltd	1193 HK	22,780,995.73	1.20
13	PetroChina Co Ltd	857 HK	22,029,970.54	1.16
14	Tencent Holdings Ltd	700 HK	21,538,897.98	1.14
15	Innovent Biologics Inc	1801 HK	21,371,180.78	1.13
16	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	20,665,046.58	1.09
17	CSPC Pharmaceutical Group Ltd	1093 HK	19,608,099.65	1.03
18	XPeng Inc	9868 HK	18,226,843.09	0.96
19	Angelalign Technology Inc	6699 HK	17,172,718.34	0.91

20	AK Medical Holdings Ltd	1789 HK	15,641,215.31	0.83
----	-------------------------	---------	---------------	------

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	AIA Group Ltd	1299 HK	104,012,394.41	5.49
2	China Resources Beer Holdings Co Ltd	291 HK	93,007,305.66	4.91
3	Meituan	3690 HK	77,124,980.62	4.07
4	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	57,834,194.74	3.05
5	China Resources Land Ltd	1109 HK	53,082,768.64	2.80
6	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	52,370,244.96	2.76
7	Huaneng Power International Inc	902 HK	38,415,057.52	2.03
8	WuXi AppTec Co Ltd	2359 HK	37,092,275.57	1.96
9	Postal Savings Bank of China Co Ltd	1658 HK	33,865,665.50	1.79
10	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	29,970,597.56	1.58
11	Longfor Group Holdings Ltd	960 HK	28,698,643.34	1.51
12	China Railway Group Ltd	390 HK	27,891,665.26	1.47
13	AviChina Industry & Technology Co Ltd	2357 HK	22,479,886.67	1.19
14	JD.com Inc	9618 HK	15,854,397.99	0.84
14	JD.com Inc	JD UW	5,062,889.54	0.27
15	China Communications Construction Co Ltd	1800 HK	19,053,107.84	1.01
16	Dada Nexus Ltd	DADA UW	16,395,669.18	0.87
17	Huadian Power International Corp Ltd	1071 HK	15,778,977.37	0.83
18	China Telecom Corp Ltd	728 HK	14,627,723.35	0.77
19	Pharmaron Beijing Co Ltd	3759 HK	12,380,411.81	0.65
20	Pop Mart	9992 HK	11,296,953.81	0.60

	International Group Ltd			
--	----------------------------	--	--	--

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	875,526,011.13
卖出收入（成交）总额	862,512,746.83

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，中国平安保险(集团)股份有限公司、招商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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 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	-
2	应收清算款	15,659,472.80
3	应收股利	7,803,341.66
4	应收利息	-
5	应收申购款	174,651.32

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,637,465.78

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 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 (%)
228,152	11,101.39	28,745,947.64	1.13	2,504,057,936.24	98.87

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	36,280.32	0.00

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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年10月12日)基金份额总额	29,750,330,282.51
本报告期期初基金份额总额	2,590,204,606.43
本报告期基金总申购份额	20,815,044.99
减：本报告期基金总赎回份额	78,215,767.54
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,532,803,883.88

§ 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

2023 年 4 月 29 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》, 张峰先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》, 程剑先生任公司副总经理。

2023 年 4 月 29 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》, 李明先生任公司财务总监。

2023 年 6 月 20 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》, 姚志鹏先生任公司副总经理。

(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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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(%)	
信达国际 证券有限 公司 CINDA INTERNATI ONAL SEC URITIES LIMITED	-	313,815,280.95	18.06	627,630.50	19.41	-
元大证券 (香港)有 限公司 Yuanta Securit ies (Hong Ko ng) Comp any Limi ted	-	236,201,081.02	13.59	472,402.16	14.61	-
中泰国际 证券有限 公司 ZHONGTAI INTER NATIONAL SECURIT IES LIM ITED	-	201,350,455.72	11.58	302,025.75	9.34	-
申万宏源 (香港)有 限公司 Shenwan Hongyua n Securi ties (H.K.) L imited	-	148,972,858.97	8.57	297,945.68	9.21	-
海通国际	-	121,009,259.	6.96	242,018.50	7.48	-

证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.		04				
招银国际证券有限公司 CMB International Securities Limited	-	118,143,822.04	6.80	236,287.61	7.31	新增
华泰金融控股 Huatai Financial Holdings	-	114,761,241.79	6.60	229,522.49	7.10	-
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	67,534,360.56	3.89	55,138.29	1.71	-
野村证券 NOMURA	-	49,347,789.31	2.84	73,375.54	2.27	-
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	45,610,755.18	2.62	91,221.50	2.82	-
侨丰证券有限公司 OSK Securities Hong K	-	39,421,588.38	2.27	77,166.49	2.39	-

ong Limited						
农银国际 证券有限公司 ABCIS SECURITIES COMPANY LIMITED	-	36,930,726.16	2.12	73,861.44	2.28	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	36,428,468.81	2.10	72,856.95	2.25	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	36,163,630.23	2.08	54,245.46	1.68	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	33,635,825.66	1.94	67,271.65	2.08	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	24,803,961.05	1.43	39,148.22	1.21	-
建银国际	-	21,614,602.8	1.24	43,229.21	1.34	-

证券有限公司 CCB International Securities Limited		1				
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	21,217,165.43	1.22	42,434.33	1.31	-
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	17,661,010.88	1.02	35,322.03	1.09	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	16,313,369.20	0.94	27,178.99	0.84	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	14,569,332.83	0.84	29,846.03	0.92	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch	-	13,353,416.56	0.77	26,706.82	0.83	新增

(Asia Pacific) Limited						
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	3,981,166.47	0.23	5,971.75	0.18	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	3,631,984.48	0.21	8,685.44	0.27	-
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	1,565,604.41	0.09	2,045.49	0.06	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	-
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-

中银国际 证券有限 公司 BOCI S ecurities Limited	-	-	-	-	-	-
中信建投 (国际)证 券有限公 司 China Securitie s (Internat ional) B rokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-
中信证券 国际有限 公司 CITIC Securitie s Intern ational Company Limited	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司 China Galaxy I nternatio nal Fina ncials H oldings	-	-	-	-	-	-
中国光大 证券(香 港)有限公 司 China Everbrigh t Securi ties (HK) Lim	-	-	-	-	-	-

ited						
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
申银万国证券(香港)有限公司 Shenyin Wanguo Securities (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
群益证券(香港)有限公司 CSC Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-
派杰亚洲证券有限公司 Piper Jaffray Asia Securities	-	-	-	-	-	-

Limited						
农银证券 有限公司 CAF Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资 本证券股 份有限公 司 Macquarie Secur ities Gr oup	-	-	-	-	-	-
里昂证券 有限公司 CLSA L imited	-	-	-	-	-	-
凯基证券 (香港)有 限公司 KGI Se curities (Hong Ko ng) Limi ted	-	-	-	-	-	-
金贝塔证 券有限公 司 iGoldenbe ta Sec urities Company Limited	-	-	-	-	-	-
极讯公司 Instinet	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司 HUATAI SECURIT IES CO., LTD.	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited						
工银国际证券有限公司 ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Banking	-	-	-	-	-	-
东盛证券(经纪)有限公司 Tung Shing Securities (Brokers)	-	-	-	-	-	-
东航国际金融有限公司 CES Capital International	-	-	-	-	-	-

al Co., Ltd.						
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
大和资本市场香港有限公司 Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
Oppenheimer	-	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		的 比 例 (%)		总 额 的 比 例 (%)		的 比 例 (%)		的 比 例 (%)
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰国际证券有限公司 ZHONGTAI INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源(香港)有限公司 Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
招银国际证券有限公司 CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰金融控股 Huatai Financial Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	-	-
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	-	-
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
侨丰证券有限公司 OSK Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
农银国际证券有限公司 ABCI SECURITIES COMPANY LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse	-	-	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Limited								
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	-	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong K ong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	-	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投(国际)证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-
中国光大证券(香港)有限公司 China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国证券(香港)有限公司 Shenyin Wanguo Securities (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
群益证券(香港)有限公司 CSC Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
派杰亚洲证券有限公司 Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
农银证券有限公司 CAF Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
凯基证券(香港)有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
极讯公司 Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-

华泰证券股份有限公司 HUATAI SECURITIES CO.,LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong)Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
工银国际证券有限公司 ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
法国巴黎兴业银行 SOCIETE GENERALE Corporate and Investment Bank ing	-	-	-	-	-	-	-	-
东盛证券(经纪)有限公司 Tung Shing Securities (Brokers)	-	-	-	-	-	-	-	-
东航国际金融有限公司 CES Capital International Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
大和资本市场香港有限公司 Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Oppenheimer	-	-	-	-	-	-	-	-

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防范不法分子诈骗活动的提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年3月21日
2	关于嘉实海外中国股票混合(QDII)2023年4月7日、4月10日暂停申购、赎回及定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年4月4日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年4月29日
4	关于嘉实海外中国股票混合(QDII)2023年5月26日暂停申购、赎回及定投业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年5月24日
5	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年6月14日
6	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023年6月20日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

(1) 中国证监会同意嘉实海外中国股票股票型证券投资基金募集的文件；

- (2) 《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金招募说明书》;
- (4) 《嘉实海外中国股票混合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) 报告期内嘉实海外中国股票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

2023 年 8 月 29 日