

嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）（原
嘉实瑞熙三年封闭运作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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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。

嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）由嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金封闭期届满转型而来。

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 20 日（基金合同生效日）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	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	7
2.2 基金产品说明（转型前）	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料(转型后)	8
2.5 其他相关资料(转型前)	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	9
3.2 基金净值表现（转型后）	10
3.2 基金净值表现（转型前）	12
3.3 其他指标	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型后）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
§6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）	51

6.1 资产负债表	51
6.2 利润表	52
6.3 净资产（基金净值）变动表	54
6.4 报表附注	57
§7 投资组合报告（转型后）	87
7.1 期末基金资产组合情况	87
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	88
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	89
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	92
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
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	94
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	95
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	95
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	95
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	95
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	95
7.12 投资组合报告附注	95
§7 投资组合报告（转型前）	96
7.1 期末基金资产组合情况	96
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	96
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	97
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	100
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	101
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	101
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	101
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	101
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	101
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	101
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	101
7.12 投资组合报告附注	102
§8 基金份额持有人信息（转型后）	102
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
8.2 期末上市基金前十名持有人	103
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	103
8.4 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	104
§8 基金份额持有人信息（转型前）	104
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	104
8.2 期末上市基金前十名持有人	104
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	105
8.4 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	105
§9 开放式基金份额变动（转型后）	105

§9 开放式基金份额变动（转型前）	105
§10 重大事件揭示.....	106
10.1 基金份额持有人大会决议	106
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	106
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	106
10.4 基金投资策略的改变	106
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	106
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	106
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)	107
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)	111
10.8 其他重大事件（转型后）	116
10.8 其他重大事件（转型前）	117
§11 备查文件目录.....	117
11.1 备查文件目录	117
11.2 存放地点	117
11.3 查阅方式	117

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）	
基金简称	嘉实欣荣混合（LOF）	
场内简称	嘉实欣荣（扩位场内简称：嘉实欣荣 LOF）	
基金主代码	501091	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 1 月 20 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	698,729,993.64 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所	
上市日期	2023 年 1 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	嘉实欣荣混合（LOF）A	嘉实欣荣混合（LOF）C
下属分级基金的交易代码	501091	017767
报告期末下属分级基金的份额总额	698,724,732.28 份	5,261.36 份

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金
基金简称	嘉实瑞熙三年封闭运作混合
场内简称	嘉实瑞熙（扩位场内简称：嘉实瑞熙）
基金主代码	501091
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 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	1,256,721,949.54 份

基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 7 月 22 日

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金采用 GARP（成长—价值）选股策略精选股票进行投资。GARP 策略是指在合理价格投资成长性股票，追求成长与价值的平衡。即将不同成长类型的股票进行成长性分析，提早发掘其成长潜力或者看到其被低估的价值。在行业配置的基础上，本基金选股策略将采用“自下而上”的分析方法，通过优选具备核心竞争力、估值相对合理同时具有较好成长性的公司进行投资。具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% +恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×30%
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。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。
投资策略	本基金采用 GARP（成长—价值）选股策略精选股票进行投资。GARP 策略是指在合理价格投资成长性股票，追求成长与价值的平衡。即将不同成长类型的股票进行成长性分析，提早发掘其成长潜力或者看到其被低估的价值。在行业配置的基础上，本基金选股策略将采用“自下而上”的分析方法，通过优选具备核心竞争力、估值相对合理同时具有较好成长性的公司进行投资。具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60% +恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×30%
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	张姗
	联系电话	(010)65215588	0755-83077987
	电子邮箱	service@jsfund.cn	zhangshan_1027@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）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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		100020	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(转型后)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据 和指标	2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
	嘉实欣荣混合（LOF）A	嘉实欣荣混合（LOF）C
本期已实现收益	-12,995,212.72	-397.46
本期利润	-104,084,018.63	-840.48
加权平均基金份 额本期利润	-0.1278	-0.1881
本期加权平均净 值利润率	-12.40%	-19.02%
本期基金份额净	-12.39%	-13.14%

值增长率		
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	-30,676,014.42	-239.34
期末可供分配基金份额利润	-0.0439	-0.0455
期末基金资产净值	668,048,717.86	5,022.02
期末基金份额净值	0.9561	0.9545
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	-12.39%	-13.14%

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。

（4）本基金合同生效日为 2023 年 01 月 20 日，本报告期自 2023 年 01 月 20 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

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 1 月 19 日)
本期已实现收益	-54,407,246.17
本期利润	71,731,693.71
加权平均基金份额本期利润	0.0571
本期加权平均净值利润率	5.35%
本期基金份额净值增长率	5.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 1 月 19 日)
期末可供分配利润	13,954,275.99
期末可供分配基金份额利润	0.0111
期末基金资产净值	1,371,406,420.75
期末基金份额净值	1.0913
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 1 月 19 日)
基金份额累计净值增长率	9.13%

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。

(4) 本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 01 月 19 日止。

3.2 基金净值表现（转型后）

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实欣荣混合（LOF）A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.25%	1.16%	1.22%	0.64%	2.03%	0.52%
过去三个月	-9.18%	0.95%	-3.31%	0.59%	-5.87%	0.36%
自基金合同生效起至今	-12.39%	0.93%	-5.03%	0.61%	-7.36%	0.32%

嘉实欣荣混合（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.20%	1.16%	1.22%	0.64%	1.98%	0.52%
过去三个月	-9.29%	0.95%	-3.31%	0.59%	-5.98%	0.36%
自基金合同生效起至今	-13.14%	0.95%	-5.80%	0.61%	-7.34%	0.34%

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：

$$\text{Return}(t) = (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) \times 60\% + (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) \times 10\% + (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) \times 30\%$$

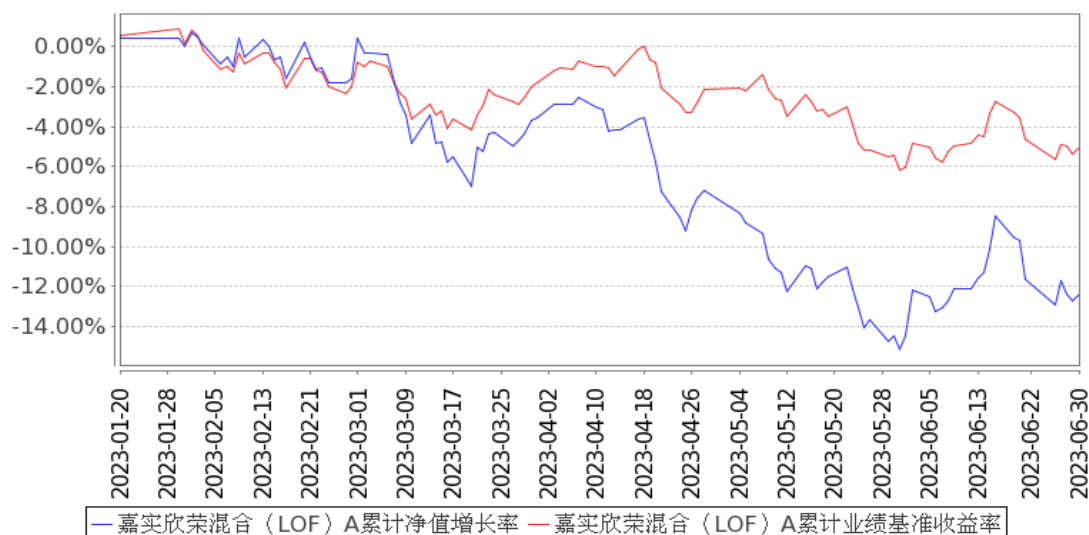
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金转型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

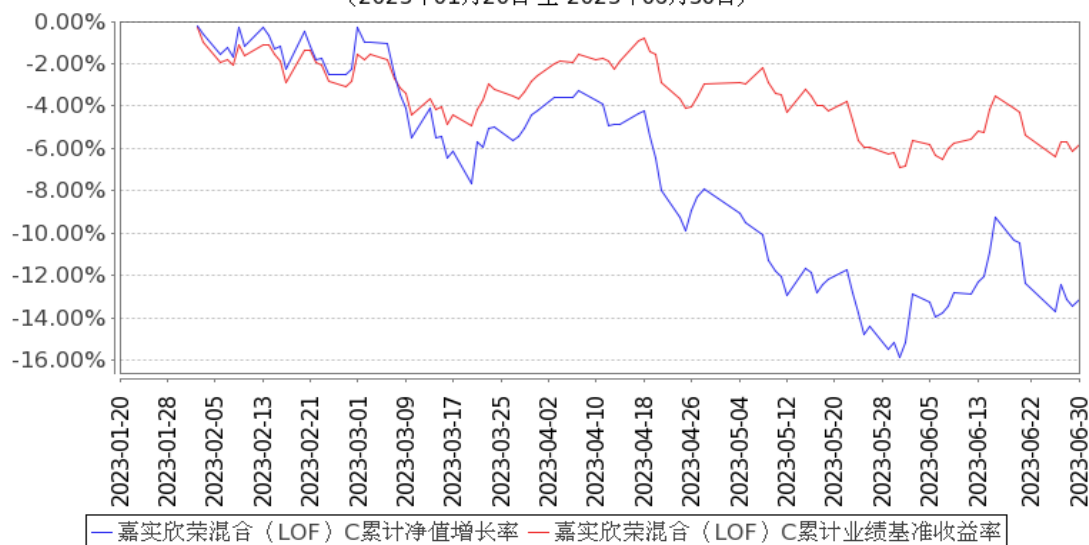
嘉实欣荣混合（LOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2023年01月20日至2023年06月30日）



嘉实欣荣混合（LOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2023年01月20日至2023年06月30日）



注：（1）本基金合同生效日 2023 年 01 月 20 日至报告期末未满 1 年。

（2）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，本报告期处于建仓期内。

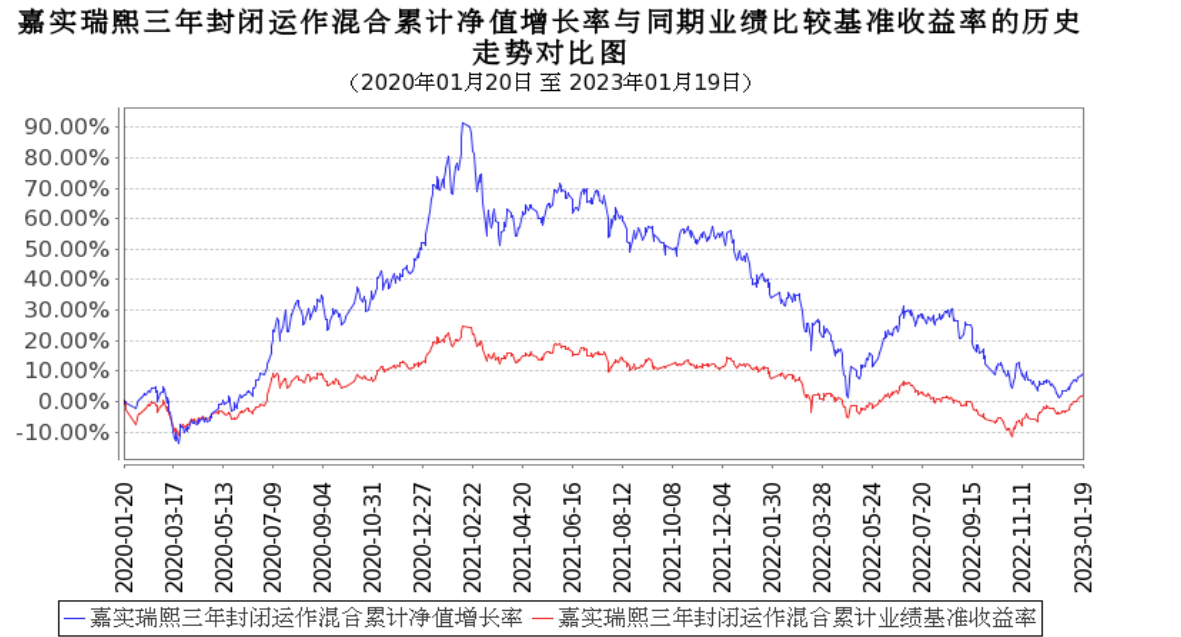
（3）自 2023 年 01 月 20 日起，本基金增设 C 份额类别，份额首次确认日期为 2023 年 02 月 02 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现（转型前）

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	—	—	—	—	—	—
过去三个月	—	—	—	—	—	—
过去六个月	5.52%	0.60%	5.33%	0.45%	0.19%	0.15%
过去一年	-15.81%	1.24%	-3.85%	0.80%	-11.96%	0.44%
自基金合同生效起至今	9.13%	1.53%	2.11%	0.90%	7.02%	0.63%

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



注：（1）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。

（2）自 2023 年 01 月 20 日起，《嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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（转型后）

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪流	本基金、嘉实策略混合、嘉实多元债券、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实阿尔法优选混合、嘉实品质优选股票、嘉实兴锐优选一年持有期混合基金经理	2023 年 1 月 20 日	-	24 年	曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。现任平衡风格投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
洪流	本基金、嘉实策略混合、嘉实多元债券、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实阿尔法优选混合、嘉实品质优选股票、嘉实兴锐优选一年持有期混合基金经理	2020 年 1 月 20 日	2023 年 1 月 20 日	24 年	曾任新疆金新信托证券管理总部信息研究部经理，德恒证券信息研究中心副总经理、经纪业务管理部副总经理，兴业证券研究发展中心高级研究员、理财服务中心首席理财分析师，上海证券资产管理分公司客户资产管理部副总监，圆信永丰基金首席投资官。2019 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任上海 GARP 投资策略组投资总监。现任平衡风格投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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、《嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）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

回顾上半年，A 股和港股市场冲高回落，一季度惯性上行，二季度震荡调整。市场调整主要受到美联储加息、国内房地产消费数据走弱和通缩预期强化等因素的共同影响。上半年总体表现较好的领域是以人工智能和“中国特色的估值体系”为代表的两个方向：人工智能映射全球科技创新的变化奇点，“中国特色的估值体系”对应国内无风险利率系统性下行背景下的低估值高分红资产的价值重估。

操作层面，上半年本基金股票仓位稳中有降，持仓结构较前期相对分散，单一个股占组合比重也适度调减，主要目的是平滑市场波动。行业配置上，本基金在食品饮料和港股互联网行业保持较高的配置比重。增加了数字办公和通信行业龙头公司的行业配置，维持有色金属（铜和金）的行业配置，降低了与中产消费相关度较高的免税行业配置比重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后：

截至 2023 年 6 月 30 日，嘉实欣荣混合（LOF）A 基金份额净值为 0.9561 元，嘉实欣荣混合（LOF）C 基金份额净值为 0.9545 元；自 2023 年 1 月 20 日起至 2023 年 6 月 30 日止，基金 A 份额净值增长率为-12.39%，业绩比较基准收益率为-5.03%；C 份额净值增长率为-13.14%，业绩比较基准收益率为-5.80%。

转型前：

截至 2023 年 1 月 19 日，嘉实瑞熙三年封闭运作混合基金份额净值为 1.0913 元，自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 1 月 19 日止，基金份额净值增长率为 5.52%，业绩比较基准收益率为 5.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看，“活跃资本市场，发挥资本市场功能”成为政策关注的焦点，对房地产行业的政策

放松有利于稳定经济复苏的预期，考虑到 PPI 数据的环比改善，企业盈利增速低点已过，A 股和港股市场目前处于阶段性底部区域。中期看，资本市场的活跃与上行必须充分考虑融资功能与投资功能的再平衡，资本市场的长期回报能力决定中长期增量资金导入的深度和广度。长期视角看，中国资本市场正站在推动经济转型和可持续发展的关键位置，本基金管理人对资本市场长期保持乐观。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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历。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

托管人声明：

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）（转型后）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）

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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	58,750,118.18
结算备付金		1,247,462.72
存出保证金		368,344.15
交易性金融资产	6.4.7.2	604,046,377.28
其中：股票投资		593,774,359.72
基金投资		—
债券投资		10,272,017.56
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		6,133,747.85
应收股利		666,051.20
应收申购款		69,506.02
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		671,281,607.40
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 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		-
应付赎回款		1,470,549.60
应付管理人报酬		838,432.61
应付托管费		139,738.79
应付销售服务费		2.42
应付投资顾问费		-
应交税费		165.11
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	778,978.99
负债合计		3,227,867.52
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	698,729,993.64
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	-30,676,253.76
净资产合计		668,053,739.88
负债和净资产总计		671,281,607.40

注：本基金合同生效日为 2023 年 01 月 20 日，本报告期自基金合同生效日 2023 年 01 月 20 日起至 2023 年 06 月 30 日止。报告截止日 2023 年 06 月 30 日，嘉实欣荣混合（LOF）A 基金份额净值 0.9561 元，基金份额总额 698,724,732.28 份，嘉实欣荣混合（LOF）C 基金份额净值 0.9545 元，基金份额总额 5,261.36 份，基金份额总额合计为 698,729,993.64 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同 生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-97,293,525.19
1. 利息收入		200,300.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	200,300.80
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）		-6,457,022.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-11,618,906.02
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	6,606.52
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	5,155,277.24
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	-91,089,248.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	52,445.20
减：二、营业总支出		6,791,333.92
1. 管理人报酬		5,718,883.61
2. 托管费		953,147.28
3. 销售服务费		9.37
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		25.14
8. 其他费用	6.4.7.23	119,268.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-104,084,859.11
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-104,084,859.11
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-104,084,859.11

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）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）	1,256,721,949.54	-	114,684,471.21	1,371,406,420.75

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)	1,256,721,949.54	-	114,684,471.21	1,371,406,420.75
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-557,991,955.90	-	-145,360,724.97	-703,352,680.87
(一)、综合收益总额	-	-	-104,084,859.11	-104,084,859.11
(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)	-557,991,955.90	-	-41,275,865.86	-599,267,821.76
其中:1.基金申购款	2,416,583.66	-	67,077.69	2,483,661.35
2.基金赎回款	-560,408,539.56	-	-41,342,943.55	-601,751,483.11
(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)	698,729,993.64	-	-30,676,253.76	668,053,739.88

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

嘉实欣荣混合型证券投资基金(LOF)是原嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金(以下简称“嘉实瑞熙三年封闭运作混合”)依照《关于嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满及转型相关安排的公告》变更而来。自 2023 年 1 月 20 日起,原嘉实瑞熙三年封闭运作混合正式变更为嘉实欣荣混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)。原《嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》失效,《嘉实欣荣混合型证券投资基金(LOF)基金合同》生效。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为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、《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》、《嘉实欣荣混合型证券投资基金(LOF)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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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业务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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内收益分配方式为现金分红。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期末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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	58,750,118.18
等于：本金	58,743,771.40
加：应计利息	6,346.78
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	58,750,118.18

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		584,976,099.55	—	593,774,359.72	8,798,260.17
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—	—
债券	交易所市场	9,411,299.88	18,031.56	10,272,017.56	842,686.12
	银行间市场	—	—	—	—
	合计	9,411,299.88	18,031.56	10,272,017.56	842,686.12
资产支持证券		—	—	—	—
基金		—	—	—	—
其他		—	—	—	—
合计		594,387,399.43	18,031.56	604,046,377.28	9,640,946.29

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	81.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	674,262.74
其中：交易所市场	674,262.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,634.29
合计	778,978.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实欣荣混合（LOF）A

项目	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,256,721,949.54	1,256,721,949.54
2023 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日基金份额折算调整	-	-
2023 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日未领取红利份额折算 调整	-	-
2023 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日集中申购募集资金本 金及利息	-	-
2023 年 1 月 20 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购 完成后	-	-

本期申购	2,400,840.48	2,400,840.48
本期赎回（以“-”号填列）	-560,398,057.74	-560,398,057.74
本期末	698,724,732.28	698,724,732.28

嘉实欣荣混合（LOF）C

项目	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	—	—
2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日基金份额折算调整	—	—
2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日未领取红利份额折算调整	—	—
2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日集中申购募集资金本金及利息	—	—
2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日基金拆分和集中申购完成后	—	—
本期申购	15,743.18	15,743.18
本期赎回（以“-”号填列）	-10,481.82	-10,481.82
本期末	5,261.36	5,261.36

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）本基金合同于 2023 年 12 月 26 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,256,721,949.54 份基金份额。

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
基金合同生效日	13,954,275.99	100,730,195.22	114,684,471.21
本期利润	-12,995,212.72	-91,088,805.91	-104,084,018.63
本期基金份额交易产生的变动数	-14,634,500.68	-26,641,966.32	-41,276,467.00
其中：基金申购款	44,534.62	22,230.71	66,765.33
基金赎回款	-14,679,035.30	-26,664,197.03	-41,343,232.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,675,437.41	-17,000,577.01	-30,676,014.42

嘉实欣荣混合（LOF）C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-397.46	-443.02	-840.48
本期基金份额交易产生的变动数	285.86	315.28	601.14
其中：基金申购款	311.22	1.14	312.36
基金赎回款	-25.36	314.14	288.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-111.60	-127.74	-239.34

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	172,642.74
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	24,793.96
其他	2,864.10
合计	200,300.80

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20日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,618,906.02
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	-11,618,906.02

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 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,278,934,772.45
减：卖出股票成本总额	1,287,428,925.30
减：交易费用	3,124,753.17
买卖股票差价收入	-11,618,906.02

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 2023年1月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	6,985.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-378.88
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	6,606.52

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 2023年1月20日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	378.88
买卖债券差价收入	-378.88

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 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	5,155,277.24
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	5,155,277.24

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-91,089,248.93
股票投资	-91,931,935.05
债券投资	842,686.12
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	-91,089,248.93

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	52,336.44
基金转出费收入	108.76
合计	52,445.20

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 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	40,389.84
信息披露费	53,260.74
证券出借违约金	-
银行划款手续费	14,926.77
债券托管账户维护费	3,000.00
深港通证券组合费	7,691.17
合计	119,268.52

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 2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,718,883.61
其中：支付销售机构的客户维护费	2,095,345.10

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
	2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	953,147.28

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司_活期	58,750,118.18	172,642.74

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

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
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	1,244	14,778.72	26,148.88	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
300804	广康生化	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023 年 3 月 27 日	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-

301170	锡南科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威 股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月 内（含）	新发未 上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威 股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301203	国泰 环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301225	恒勃 股份	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301260	格力 博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定	30.85	23.63	2,497	77,032.45	59,004.11	-
301261	恒工 精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内（含）	新发未 上市	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
301261	恒工 精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301262	海看 股份	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301293	三博 脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕 科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301301	川宁 生物	2022 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁 定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301310	鑫宏 业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁 定	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-
301315	威士 顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊 股份	2023 年 1 月 12	6 个月	新股锁 定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-

		日								
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁定	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	1 个月内（含）	新发未上市	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
601061	中信	2023 年	6 个月	新股锁	6.58	7.58	2,756	18,134.48	20,890.48	-

	金属	3 月 30 日		定						
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	36.15	38.13	832	30,076.80	31,724.16	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定	19.86	18.06	4,319	85,775.34	78,001.14	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	顾中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	711	16,779.60	45,980.37	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	8,763	49,861.47	47,407.83	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	2,991	33,200.10	50,966.64	-

688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁 定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	39.99	36.71	824	32,951.76	30,249.04	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定	245.56	122.11	207	34,378.40	25,276.77	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股锁 定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定	30.26	25.33	715	21,635.90	18,110.95	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023 年 5 月 25	6 个月	新股锁 定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

		日								
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新发未上市	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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时间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 2023 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	58,750,118.18	-	-	-	58,750,118.18
结算备付金	1,247,462.72	-	-	-	1,247,462.72
存出保证金	368,344.15	-	-	-	368,344.15
交易性金融资产	-	10,272,017.56	-	593,774,359.72	604,046,377.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	6,133,747.85	6,133,747.85
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	666,051.20	666,051.20
应收申购款	-	-	-	69,506.02	69,506.02
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	60,365,925.05	10,272,017.56	-	600,643,664.79	671,281,607.40
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	-	-	-	1,470,549.60	1,470,549.60
应付管理人报酬	-	-	-	838,432.61	838,432.61
应付托管费	-	-	-	139,738.79	139,738.79

应付销售服务费	-	-	-	2.42	2.42
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	165.11	165.11
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	778,978.99	778,978.99
负债总计	-	-	-	3,227,867.52	3,227,867.52
利率敏感度缺口	60,365,925.05	10,272,017.56	-	-597,415,797.27	668,053,739.88

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）
分析	市场利率上升 25 个基点	-82,848.59
	市场利率下降 25 个基点	83,778.94

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 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				
交易性金融资产	-	192,588,277.25	-	192,588,277.25
资产合计	-	192,588,277.25	-	192,588,277.25
以外币计价的负债				

负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	192,588,277.25	-	192,588,277.25

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）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	9,629,413.86	
	所有外币相对人民币贬值 5%	-9,629,413.86	

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	593,774,359.72	88.88
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	593,774,359.72	88.88

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）
分析	业绩比较基准上升 5%	44,227,501.85
	业绩比较基准下降 5%	-44,227,501.85

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
第一层次	602,537,381.41
第二层次	366,947.18
第三层次	1,142,048.69
合计	604,046,377.28

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。

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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）（转型前）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 1 月 19 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 1 月 19 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	338,181,187.58	106,959,245.69
结算备付金		5,576,055.89	58,182,462.21
存出保证金		310,494.57	314,893.63
交易性金融资产	6.4.7.2	991,593,804.93	1,133,121,032.98
其中：股票投资		991,593,804.93	1,133,121,032.98
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		37,715,391.94	4,774,357.48
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.8	—	—

资产总计		1,373,376,934.91	1,303,351,991.99
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 1 月 19 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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,043,723.04	1,675,421.27
应付托管费		173,953.84	279,236.88
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	752,837.28	1,722,606.80
负债合计		1,970,514.16	3,677,264.95
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,256,721,949.54	1,256,721,949.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	114,684,471.21	42,952,777.50
净资产合计		1,371,406,420.75	1,299,674,727.04
负债和净资产总计		1,373,376,934.91	1,303,351,991.99

注：本基金合同失效前日为 2023 年 01 月 19 日，本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至基金合同失效前日 2023 年 01 月 19 日止。报告截止日 2023 年 01 月 19 日，基金份额净值 1.0913 元，基金份额总额 1,256,721,949.54 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 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		72,968,526.30	-222,602,031.80
1. 利息收入		56,110.14	174,129.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	56,110.14	174,129.34
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）		-53,226,523.72	-238,201,408.49
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-53,206,138.16	-250,330,542.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	1,306,772.78
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-20,385.56	10,822,361.70
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	126,138,939.88	15,425,247.35
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	-	-
减：二、营业总支出		1,236,832.59	13,758,956.99
1. 管理人报酬		1,043,723.04	11,679,898.51
2. 托管费		173,953.84	1,946,649.76
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		-	8.82
8. 其他费用	6.4.7.23	19,155.71	132,399.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		71,731,693.71	-236,360,988.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		71,731,693.71	-236,360,988.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		71,731,693.71	-236,360,988.79

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 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)	1,256,721,949.54	-	42,952,777.50	1,299,674,727.04
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)	1,256,721,949.54	-	42,952,777.50	1,299,674,727.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	71,731,693.71	71,731,693.71
(一)、综合收益总额	-	-	71,731,693.71	71,731,693.71
(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)	-	-	-	-
其中：1. 基金申	-	-	-	-

购款				
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(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)	1,256,721,949.54	-	114,684,471.21	1,371,406,420.75
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)	1,256,721,949.54	-	608,660,697.98	1,865,382,647.52
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)	1,256,721,949.54	-	608,660,697.98	1,865,382,647.52

三、本期 增 减 变 动额(减 少以“-” 号填列)	-	-	-236,360,988.79	-236,360,988.79
(一)、 综 合 收 益总额	-	-	-236,360,988.79	-236,360,988.79
(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)	-	-	-	-
其中:1. 基 金 申 购 款	-	-	-	-
2 . 基 金 赎 回 款	-	-	-	-
(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	1,256,721,949.54	-	372,299,709.19	1,629,021,658.73

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

嘉实瑞熙三年封闭运作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]1642号《关于准予嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实瑞熙三年封闭运作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，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金基金合同》于2020年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,256,721,949.54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、《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》、《嘉实瑞熙三年封闭运作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。

经中国证监会批准，基金管理人嘉实基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为嘉实欣荣混合型证券投资基金(LOF)并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营为编制基础。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日(基金合同失效前日)。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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业务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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

在封闭期内，实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。本基金转型为开放式基金后，实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分

摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

本基金在封闭期内不开放申购或赎回，不产生损益平准金。本基金转型为开放式基金后，损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内收益分配方式为现金分红。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从净资产转出。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- （1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时

的交易不活跃)等情况,基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70

号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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 2023 年 1 月 19 日
活期存款	338,181,187.58
等于：本金	338,127,878.12
加：应计利息	53,309.46
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	338,181,187.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 1 月 19 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	890,863,609.71	—	991,593,804.93	100,730,195.22
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	890,863,609.71	—	991,593,804.93	100,730,195.22

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 1 月 19 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	530,853.57
其中：交易所市场	530,853.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	221,983.71
合计	752,837.28

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 1 月 19 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,256,721,949.54	1,256,721,949.54
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	1,256,721,949.54	1,256,721,949.54

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	68,361,522.16	-25,408,744.66	42,952,777.50
本期利润	-54,407,246.17	126,138,939.88	71,731,693.71
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-

本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,954,275.99	100,730,195.22	114,684,471.21

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 1 月 19 日
活期存款利息收入	46,087.96
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	9,739.65
其他	282.53
合计	56,110.14

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1月19日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-53,206,138.16
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	-53,206,138.16

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 1 月 19 日
卖出股票成交总额	519,016,878.52
减：卖出股票成本总额	571,047,292.13
减：交易费用	1,175,724.55
买卖股票差价收入	-53,206,138.16

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

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	-20,385.56
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	-20,385.56

6.4.7.20 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 1 月 19 日
1. 交易性金融资产	126,138,939.88
股票投资	126,138,939.88
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	126,138,939.88

6.4.7.21 其他收入

无。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日
审计费用	4,737.08
信息披露费	6,246.63
证券出借违约金	-
银行划款手续费	2,965.24
债券托管账户维护费	4,500.00
深港通证券组合费	706.76
合计	19,155.71

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 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	1,043,723.04	11,679,898.51
其中：支付销售机构的客户维护费	380,875.89	3,998,840.22

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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日	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	173,953.84	1,946,649.76

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 1 月 19 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	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
招商银行股份有限公司 _活期	338,181,187.58	46,087.96	61,114,673.24	135,621.34

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(2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2023 年 1 月 19 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 1 月 19 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
300390	天华新能	2022 年 12 月 12 日	6 个月	非公开发行锁定	52.89	57.91	94,536	5,000,009.04	5,474,579.76	-
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定	58.00	94.20	740	42,920.00	69,708.00	-
301115	建科股份	2022 年 8 月 23 日	6 个月	新股锁定	42.05	25.64	685	28,804.25	17,563.40	-
301121	紫建电子	2022 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁定	61.07	60.61	290	17,710.30	17,576.90	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁定	26.80	26.68	468	12,542.40	12,486.24	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定	57.00	49.70	433	24,681.00	21,520.10	-
301161	唯万密封	2022 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁定	18.66	21.83	346	6,456.36	7,553.18	-
301165	锐捷网络	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定	32.38	35.28	1,077	34,873.26	37,996.56	-
301171	易点天下	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	18.18	18.67	985	17,907.30	18,389.95	-
301176	逸豪新材	2022 年 9 月	6 个月	新股锁定	23.88	17.46	544	12,990.72	9,498.24	-

		21 日								
301195	北路智控	2022 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁定	71.17	78.75	330	23,486.10	25,987.50	-
301223	中荣股份	2022 年 10 月 13 日	6 个月	新股锁定	26.28	18.95	815	21,418.20	15,444.25	-
301227	森鹰窗业	2022 年 9 月 16 日	6 个月	新股锁定	38.25	30.79	284	10,863.00	8,744.36	-
301230	泓博医药	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定	40.00	54.19	269	10,760.00	14,577.11	-
301231	荣信文化	2022 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定	25.49	20.80	275	7,009.75	5,720.00	-
301265	华新环保	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股锁定	13.28	11.54	819	10,876.32	9,451.26	-
301267	华夏眼科	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定	50.88	78.92	1,006	51,185.28	79,393.52	-
301269	华大九天	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁定	32.69	91.79	1,168	38,181.92	107,210.72	-
301273	瑞晨环保	2022 年 10 月 11 日	6 个月	新股锁定	37.89	40.76	277	10,495.53	11,290.52	-
301276	嘉曼服饰	2022 年 9 月 1 日	6 个月	新股锁定	40.66	23.85	303	12,319.98	7,226.55	-
301282	金禄电子	2022 年 8 月 18 日	6 个月	新股锁定	30.38	27.82	434	13,184.92	12,073.88	-
301285	鸿日达	2022 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定	14.60	14.22	565	8,249.00	8,034.30	-
301290	东星医疗	2022 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁定	44.09	36.88	330	14,549.70	12,170.40	-

		日								
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股锁定	18.19	15.94	1,042	18,953.98	16,609.48	-
301300	远翔新材	2022年8月9日	6个月	新股锁定	36.15	31.86	211	7,627.65	6,722.46	-
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股锁定	5.00	7.33	3,574	17,870.00	26,197.42	-
301306	西测测试	2022年7月19日	6个月	新股锁定	43.23	45.68	255	11,023.65	11,648.40	-
301308	江波龙	2022年7月27日	6个月	新股锁定	55.67	68.66	819	45,593.73	56,232.54	-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股锁定	39.00	26.02	228	8,892.00	5,932.56	-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股锁定	13.88	18.27	832	11,548.16	15,200.64	-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股锁定	25.25	30.91	247	6,236.75	7,634.77	-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股锁定	7.60	20.15	359	2,728.40	7,233.85	-
301317	鑫磊股份	2023年1月12日	6个月	新股锁定	20.67	25.32	694	14,344.98	17,572.08	-
301318	维海德	2022年8月3日	6个月	新股锁定	64.68	45.05	206	13,324.08	9,280.30	-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定	47.75	66.99	115	5,491.25	7,703.85	-
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股锁定	51.72	40.67	227	11,740.44	9,232.09	-
301327	华宝新能	2022年9月	6个月	新股锁定	237.50	181.51	242	57,475.00	43,925.42	-

		8 日								
301328	维峰电子	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定	78.80	86.04	191	15,050.80	16,433.64	-
301330	熵基科技	2022 年 8 月 10 日	6 个月	新股锁定	43.32	34.94	694	30,064.08	24,248.36	-
301335	天元宠物	2022 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	49.98	34.85	420	20,991.60	14,637.00	-
301338	凯格精机	2022 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁定	46.33	55.17	257	11,906.81	14,178.69	-
301339	通行宝	2022 年 9 月 2 日	6 个月	新股锁定	18.78	20.66	913	17,146.14	18,862.58	-
301349	信德新材	2022 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁定	138.88	114.33	180	24,998.40	20,579.40	-
301356	天振股份	2022 年 11 月 3 日	6 个月	新股锁定	63.00	45.96	614	38,682.00	28,219.44	-
301361	众智科技	2022 年 11 月 8 日	6 个月	新股锁定	26.44	22.69	517	13,669.48	11,730.73	-
301363	美好医疗	2022 年 9 月 28 日	6 个月	新股锁定	30.66	41.81	445	13,643.70	18,605.45	-
301365	矩阵股份	2022 年 11 月 14 日	6 个月	新股锁定	34.72	24.93	516	17,915.52	12,863.88	-
301366	一博科技	2022 年 9 月 19 日	6 个月	新股锁定	65.35	47.93	268	17,513.80	12,845.24	-
301367	怡和嘉业	2022 年 10 月 21 日	6 个月	新股锁定	119.88	176.17	223	26,733.24	39,285.91	-
301368	丰立智能	2022 年 12 月 7 日	6 个月	新股锁定	22.33	19.45	337	7,525.21	6,554.65	-
301377	鼎泰	2022	6 个月	新股锁	22.88	20.75	770	17,617.60	15,977.50	-

	高科	年 11 月 11 日		定						
301379	天山电子	2022 年 10 月 19 日	6 个月	新股锁定	31.51	26.66	449	14,147.99	11,970.34	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股锁定	25.88	22.92	292	7,556.96	6,692.64	-
301389	隆扬电子	2022 年 10 月 18 日	6 个月	新股锁定	22.50	18.49	1,269	28,552.50	23,463.81	-
301391	卡莱特	2022 年 11 月 24 日	6 个月	新股锁定	96.00	103.26	247	23,712.00	25,505.22	-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股锁定	34.40	31.36	255	8,772.00	7,996.80	-
601059	信达证券	2023 年 1 月 18 日	1 个月内(含)	新发未上市	8.25	8.25	5,628	46,431.00	46,431.00	-
603173	福斯达	2023 年 1 月 12 日	1 个月内(含)	新发未上市	18.65	18.65	588	10,966.20	10,966.20	-
603281	江瀚新材	2023 年 1 月 17 日	1 个月内(含)	新发未上市	35.59	35.59	863	30,714.17	30,714.17	-
688114	华大智造	2022 年 9 月 2 日	6 个月	新股锁定	87.18	113.97	5,336	465,192.48	608,143.92	-
688203	海正生材	2022 年 8 月 9 日	6 个月	新股锁定	16.68	18.10	5,761	96,093.48	104,274.10	-
688244	永信至诚	2022 年 10 月 12 日	6 个月	新股锁定	49.19	60.24	1,506	74,080.14	90,721.44	-
688253	英诺特	2022 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁定	26.06	23.02	4,364	113,725.84	100,459.28	-

688275	万润新能	2022年9月21日	6个月	新股锁定	299.88	184.47	2,707	811,775.16	499,360.29	-
688292	浩瀚深度	2022年8月9日	6个月	新股锁定	16.56	17.78	4,503	74,569.68	80,063.34	-
688376	美埃科技	2022年11月10日	6个月	新股锁定	29.19	32.27	3,713	108,382.47	119,818.51	-
688392	骄成超声	2022年9月19日	6个月	新股锁定	71.18	130.07	2,745	195,389.10	357,042.15	-
688432	有研硅	2022年11月3日	6个月	新股锁定	9.91	13.16	20,044	198,636.04	263,779.04	-
688617	惠泰医疗	2022年11月15日	6个月	大宗交易受让减持锁定	280.33	296.13	30,000	8,409,900.00	8,883,900.00	-

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在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，通过积极主动的资产配置和精选个股，力争实现基金资产持续稳定增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

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时间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 2023 年 1 月 19 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	338,181,187.58	-	-	-	338,181,187.58
结算备付金	5,576,055.89	-	-	-	5,576,055.89
存出保证金	310,494.57	-	-	-	310,494.57
交易性金融资产	-	-	-	991,593,804.93	991,593,804.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	37,715,391.94	37,715,391.94
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	344,067,738.04	-	-	1,029,309,196.87	1,373,376,934.91
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	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,043,723.04	1,043,723.04
应付托管费	-	-	-	173,953.84	173,953.84

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	-	-	-	752,837.28	752,837.28
负债总计	-	-	-	1,970,514.16	1,970,514.16
利率敏感度缺口	344,067,738.04	-	-	-1,027,338,682.71	1,371,406,420.75
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	106,959,245.69	-	-	-	106,959,245.69
结算备付金	58,182,462.21	-	-	-	58,182,462.21
存出保证金	314,893.63	-	-	-	314,893.63
交易性金融资产	-	-	-	-1,133,121,032.98	1,133,121,032.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,774,357.48	4,774,357.48
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	165,456,601.53	-	-	-1,137,895,390.46	1,303,351,991.99
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,675,421.27	1,675,421.27
应付托管费	-	-	-	279,236.88	279,236.88
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	-	-	-	1,722,606.80	1,722,606.80
负债总计	-	-	-	3,677,264.95	3,677,264.95
利率敏感度缺口	165,456,601.53	-	-	-1,134,218,125.51	1,299,674,727.04

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 1 月 19 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，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 2023 年 1 月 19 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	-	192,598,889.71	-	192,598,889.71
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-

资产合计	-	192,598,889.71	-	192,598,889.71
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	-	192,598,889.71	-	192,598,889.71
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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	150,944,764.61	-	150,944,764.61
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-

资产合计	-	150,944,764.61	-	150,944,764.61
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	-	150,944,764.61	-	150,944,764.61

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		
		对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
	相关风险变量的变动	本期末（2023 年 1 月 19 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%	9,629,944.49	7,547,238.23
	所有外币相对人民币贬值 5%	-9,629,944.49	-7,547,238.23

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 1 月 19 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	991,593,804.93	72.30	1,133,121,032.98	87.18
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	991,593,804.93	72.30	1,133,121,032.98	87.18

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 1 月 19 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	92,866,434.98	89,523,305.66
	业绩比较基准下降 5%	-92,866,434.98	-89,523,305.66

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 1 月 19 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	973,822,157.65	1,116,229,660.23
第二层次	88,111.37	385,863.40
第三层次	17,683,535.91	16,505,509.35
合计	991,593,804.93	1,133,121,032.98

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（转型后）

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	593,774,359.72	88.45
	其中：股票	593,774,359.72	88.45
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	10,272,017.56	1.53
	其中：债券	10,272,017.56	1.53
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	59,997,580.90	8.94
8	其他各项资产	7,237,649.22	1.08
9	合计	671,281,607.40	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 192,588,277.25 元，占基金资产净值的比例为 28.83%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	50,613,724.00	7.58
C	制造业	283,137,144.73	42.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	56,493.56	0.01
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	42,782,308.73	6.40
J	金融业	14,351,081.00	2.15
K	房地产业	10,155,825.00	1.52
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	401,186,082.47	60.05

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	76,421,548.45	11.44
非必需消费品	6,936,881.63	1.04
必需消费品	31,555,318.68	4.72
能源	-	-
金融	1,578,577.28	0.24
医疗保健	34,463,464.88	5.16
工业	18,953,659.17	2.84
信息技术	8,476,610.36	1.27
原材料	-	-
房地产	14,202,216.80	2.13
公用事业	-	-
合计	192,588,277.25	28.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	35,115	59,379,465.00	8.89
2	700 HK	腾讯控股	186,200	56,926,659.36	8.52
3	6078 HK	海吉亚医疗	881,600	34,463,464.88	5.16
4	300316	晶盛机电	476,426	33,778,603.40	5.06
5	601899	紫金矿业	2,928,700	33,299,319.00	4.98
6	000063	中兴通讯	408,166	18,587,879.64	2.78
6	763 HK	中兴通讯	292,800	8,476,610.36	1.27
7	600309	万华化学	306,900	26,958,096.00	4.04
8	600388	ST 龙净	1,392,217	25,018,139.49	3.74
9	688111	金山办公	43,311	20,452,320.42	3.06
10	3888 HK	金山软件	685,400	19,494,889.09	2.92
11	300604	长川科技	369,683	17,556,245.67	2.63
12	291 HK	华润啤酒	368,000	17,507,293.82	2.62
13	1186 HK	中国铁建	2,798,000	14,859,072.23	2.22
14	1030 HK	新城发展	10,068,000	14,202,216.80	2.13
15	168 HK	青岛啤酒股份	214,000	14,048,024.86	2.10
16	603501	韦尔股份	123,200	12,078,528.00	1.81
17	002236	大华股份	603,300	11,915,175.00	1.78
18	300496	中科创达	106,600	10,270,910.00	1.54
19	603222	济民医疗	970,160	10,118,768.80	1.51
20	600690	海尔智家	373,945	8,780,228.60	1.31

21	603993	洛阳钼业	1,627,700	8,675,641.00	1.30
22	300308	中际旭创	55,400	8,168,730.00	1.22
23	688099	晶晨股份	85,120	7,177,318.40	1.07
24	600967	内蒙一机	702,200	7,092,220.00	1.06
25	603019	中科曙光	138,800	7,064,920.00	1.06
26	3690 HK	美团-W	61,520	6,936,881.63	1.04
27	600489	中金黄金	670,800	6,929,364.00	1.04
28	601318	中国平安	147,500	6,844,000.00	1.02
29	600048	保利发展	511,500	6,664,845.00	1.00
30	300476	胜宏科技	252,900	6,097,419.00	0.91
31	002129	TCL 中环	167,100	5,547,720.00	0.83
32	000617	中油资本	757,100	5,473,833.00	0.82
33	300394	天孚通信	49,400	5,277,402.00	0.79
34	300275	梅安森	342,720	4,763,808.00	0.71
35	000977	浪潮信息	96,700	4,689,950.00	0.70
36	300390	天华新能	116,797	4,181,332.60	0.63
37	9979 HK	绿城管理控股	714,000	4,094,586.94	0.61
38	000002	万 科 A	249,000	3,490,980.00	0.52
39	600426	华鲁恒升	104,200	3,191,646.00	0.48
40	688122	西部超导	56,970	3,174,938.10	0.48
41	002463	沪电股份	149,800	3,136,812.00	0.47
42	300033	同花顺	11,600	2,033,248.00	0.30
43	000426	兴业银锡	192,500	1,709,400.00	0.26
44	388 HK	香港交易所	5,800	1,578,577.28	0.24
45	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
46	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
47	688249	晶合集成	4,319	78,001.14	0.01
48	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
49	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
50	301260	格力博	2,497	59,004.11	0.01
51	688472	阿特斯	2,991	50,966.64	0.01
52	688469	中芯集成	8,763	47,407.83	0.01
53	688361	中科飞测	711	45,980.37	0.01
54	002384	东山精密	1,700	44,030.00	0.01
55	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
56	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
57	688146	中船特气	832	31,724.16	0.00
58	688484	南芯科技	824	30,249.04	0.00
59	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
60	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
61	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
62	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
63	001287	中电港	1,244	26,148.88	0.00

64	688507	索辰科技	207	25,276.77	0.00
65	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
66	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
67	002311	海大集团	466	21,827.44	0.00
68	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
69	601061	中信金属	2,756	20,890.48	0.00
70	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
71	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
72	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
73	688570	天玛智控	715	18,110.95	0.00
74	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
75	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
76	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
77	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
78	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
79	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
80	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
81	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
82	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
83	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
84	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
85	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
86	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
87	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
88	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
89	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
90	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
91	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
92	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
93	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
94	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
95	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
96	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
97	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
98	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
99	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
100	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
101	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
102	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
103	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
104	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
105	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
106	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00

107	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
108	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
109	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
110	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
111	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
112	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
113	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
114	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
115	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
116	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
117	603172	万丰股份	122	1,967.86	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300316	晶盛机电	35,958,717.14	5.38
2	300413	芒果超媒	30,762,758.39	4.60
3	002415	海康威视	29,852,106.36	4.47
4	600809	山西汾酒	28,149,632.00	4.21
5	601899	紫金矿业	27,134,052.00	4.06
6	603993	洛阳钼业	18,628,778.00	2.79
6	3993 HK	洛阳钼业	7,895,125.74	1.18
7	300750	宁德时代	26,134,729.69	3.91
8	1797 HK	东方甄选	26,016,006.69	3.89
9	688122	西部超导	24,733,535.36	3.70
10	000063	中兴通讯	15,939,593.49	2.39
10	763 HK	中兴通讯	7,935,750.22	1.19
11	688111	金山办公	23,566,516.82	3.53
12	601601	中国太保	22,568,479.00	3.38
13	1030 HK	新城发展	22,402,934.64	3.35
14	601318	中国平安	22,101,343.50	3.31
15	300496	中科创达	21,895,474.80	3.28
16	600309	万华化学	20,720,043.41	3.10
17	002384	东山精密	19,898,406.00	2.98
18	3888 HK	金山软件	19,238,123.02	2.88
19	002129	TCL 中环	18,739,176.75	2.81
20	300604	长川科技	17,542,715.11	2.63
21	002648	卫星化学	17,436,525.12	2.61
22	603069	海汽集团	17,099,699.01	2.56
23	688099	晶晨股份	16,428,122.82	2.46
24	1186 HK	中国铁建	14,848,048.76	2.22
25	601939	建设银行	14,694,107.00	2.20

26	002179	中航光电	14,618,222.00	2.19
----	--------	------	---------------	------

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300316	晶盛机电	74,143,693.51	11.10
2	002484	江海股份	54,256,014.06	8.12
3	688116	天奈科技	49,374,397.79	7.39
4	002180	纳思达	48,805,813.84	7.31
5	600570	恒生电子	47,697,972.02	7.14
6	002384	东山精密	45,569,026.31	6.82
7	601888	中国中免	45,450,917.69	6.80
8	002129	TCL 中环	42,850,384.84	6.41
9	000001	平安银行	42,568,685.25	6.37
10	603993	洛阳钼业	34,940,234.00	5.23
10	3993 HK	洛阳钼业	7,213,588.25	1.08
11	002415	海康威视	41,559,040.02	6.22
12	600809	山西汾酒	40,497,640.21	6.06
13	300059	东方财富	37,000,837.33	5.54
14	600519	贵州茅台	35,630,356.00	5.33
15	603290	斯达半导	31,358,152.73	4.69
16	601728	中国电信	30,391,237.66	4.55
17	168 HK	青岛啤酒股份	18,210,997.68	2.73
17	600600	青岛啤酒	11,882,123.00	1.78
18	300413	芒果超媒	29,868,623.90	4.47
19	600958	东方证券	29,836,352.68	4.47
20	688777	中控技术	26,954,248.79	4.03
21	300054	鼎龙股份	26,482,176.26	3.96
22	000729	燕京啤酒	26,283,030.78	3.93
23	000069	华侨城 A	24,831,704.00	3.72
24	002311	海大集团	24,324,488.81	3.64
25	300750	宁德时代	24,313,961.40	3.64
26	301327	华宝新能	24,236,605.88	3.63
27	688122	西部超导	24,213,268.46	3.62
28	600256	广汇能源	23,993,793.00	3.59
29	002475	立讯精密	23,700,216.01	3.55
30	000776	广发证券	22,558,106.00	3.38
31	002791	坚朗五金	22,295,869.90	3.34
32	603300	华铁应急	21,874,951.71	3.27
33	002532	天山铝业	21,834,541.20	3.27
34	300015	爱尔眼科	20,241,239.21	3.03
35	600315	上海家化	19,987,886.50	2.99
36	700 HK	腾讯控股	19,744,895.94	2.96

37	601601	中国太保	19,443,933.90	2.91
38	300390	天华新能	18,210,259.41	2.73
39	600030	中信证券	17,696,250.00	2.65
40	603368	柳药集团	16,877,081.04	2.53
41	600388	ST 龙净	16,876,813.02	2.53
42	603444	吉比特	15,640,736.08	2.34
43	603806	福斯特	15,569,609.58	2.33
44	002648	卫星化学	15,515,369.86	2.32
45	1171 HK	兖矿能源	15,509,828.81	2.32
46	603069	海汽集团	15,233,565.88	2.28
47	291 HK	华润啤酒	15,194,258.67	2.27
48	1797 HK	东方甄选	14,706,081.93	2.20
49	002179	中航光电	14,469,409.10	2.17
50	002155	湖南黄金	14,200,148.60	2.13
51	601939	建设银行	14,117,434.00	2.11
52	300795	米奥会展	14,032,708.00	2.10

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	981,541,415.14
卖出股票收入（成交）总额	1,278,934,772.45

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	-	-
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）	10,272,017.56	1.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,272,017.56	1.54

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	110068	龙净转债	55,400	10,272,017.56	1.54

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
无。

7.11.2 本期国债期货投资评价
无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，福建龙净环保股份有限公司出现本期被监管部门立案调查。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	368,344.15
2	应收清算款	6,133,747.85
3	应收股利	666,051.20
4	应收利息	—
5	应收申购款	69,506.02
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,237,649.22

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	110068	龙净转债	10,272,017.56	1.54

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。

§ 7 投资组合报告（转型前）

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	991,593,804.93	72.20
	其中：股票	991,593,804.93	72.20
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	343,757,243.47	25.03
8	其他各项资产	38,025,886.51	2.77
9	合计	1,373,376,934.91	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 192,598,889.71 元，占基金资产净值的比例为 14.04%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	53,178,346.24	3.88
C	制造业	451,571,386.37	32.93
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	24,572,246.20	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	4,065,390.00	0.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	90,750,994.97	6.62
J	金融业	108,543,325.05	7.91
K	房地产业	15,068,473.60	1.10
L	租赁和商务服务业	50,784,375.92	3.70
M	科学研究和技术服务业	375,263.35	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	79,393.52	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,720.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	798,994,915.22	58.26

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	76,212,828.73	5.56
非必需消费品	2,856,945.83	0.21
必需消费品	67,888,489.57	4.95
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	45,640,625.58	3.33
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	192,598,889.71	14.04

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	54,715	102,875,690.15	7.50
2	700 HK	腾讯控股	230,200	76,212,828.73	5.56
3	300316	晶盛机电	1,017,336	67,764,750.96	4.94
4	6078 HK	海吉亚医疗	818,800	45,640,625.58	3.33
5	601888	中国中免	150,278	34,810,395.92	2.54
6	291 HK	华润啤酒	646,000	34,136,937.82	2.49

7	168 HK	青岛啤酒股份	500,000	33,751,551.75	2.46
8	600958	东方证券	2,917,144	32,526,155.60	2.37
9	600388	ST 龙净	1,690,401	28,973,473.14	2.11
10	002311	海大集团	444,671	28,178,801.27	2.05
11	600570	恒生电子	597,260	27,706,891.40	2.02
12	002129	TCL 中环	676,238	27,658,134.20	2.02
13	688777	中控技术	290,224	27,519,039.68	2.01
14	000001	平安银行	1,792,805	27,053,427.45	1.97
15	000776	广发证券	1,371,200	24,900,992.00	1.82
16	300059	东方财富	1,026,800	23,965,512.00	1.75
17	603993	洛阳钼业	4,752,900	23,954,616.00	1.75
18	601728	中国电信	4,788,550	21,117,505.50	1.54
19	600809	山西汾酒	69,502	20,744,956.96	1.51
20	002532	天山铝业	2,213,400	19,123,776.00	1.39
21	600315	上海家化	606,250	18,721,000.00	1.37
22	603300	华铁应急	2,420,300	15,973,980.00	1.16
23	000069	华侨城 A	2,769,940	15,068,473.60	1.10
24	603806	福斯特	200,913	14,686,740.30	1.07
25	603444	吉比特	38,808	13,981,746.24	1.02
26	600309	万华化学	144,900	13,888,665.00	1.01
27	603290	斯达半导	39,200	13,641,208.00	0.99
28	601899	紫金矿业	1,172,800	13,581,024.00	0.99
29	002675	东诚药业	675,800	12,941,570.00	0.94
30	000729	燕京啤酒	1,197,400	12,836,128.00	0.94
31	002155	湖南黄金	904,758	12,015,186.24	0.88
32	002791	坚朗五金	110,267	11,307,880.85	0.82
33	600690	海尔智家	353,000	9,305,080.00	0.68
34	600702	舍得酒业	52,463	8,898,774.06	0.65
35	688617	惠泰医疗	30,000	8,883,900.00	0.65
36	603939	益丰药房	148,600	8,798,606.00	0.64
37	603368	柳药集团	419,100	8,461,629.00	0.62
38	603883	老百姓	177,476	7,312,011.20	0.53
39	301165	锐捷网络	182,377	6,949,152.56	0.51
40	688122	西部超导	72,373	6,874,711.27	0.50
41	002594	比亚迪	24,100	6,519,050.00	0.48
42	300390	天华新能	94,536	5,474,579.76	0.40
43	600428	中远海特	645,300	4,065,390.00	0.30
44	600256	广汇能源	348,800	3,627,520.00	0.26
45	3690 HK	美团-W	20,620	2,856,945.83	0.21
46	688311	盟升电子	17,636	1,455,146.36	0.11
47	688114	华大智造	5,336	608,143.92	0.04
48	688275	万润新能	2,707	499,360.29	0.04
49	300054	鼎龙股份	19,900	457,700.00	0.03

50	688392	骄成超声	2,745	357,042.15	0.03
51	688073	毕得医药	2,544	318,610.56	0.02
52	688432	有研硅	20,044	263,779.04	0.02
53	688498	源杰科技	1,582	215,610.78	0.02
54	301327	华宝新能	762	142,361.42	0.01
55	688376	美埃科技	3,713	119,818.51	0.01
56	688116	天奈科技	1,436	118,455.64	0.01
57	000301	东方盛虹	7,400	108,558.00	0.01
58	301269	华大九天	1,168	107,210.72	0.01
59	688143	长盈通	1,938	106,202.40	0.01
60	688203	海正生材	5,761	104,274.10	0.01
61	688253	英诺特	4,364	100,459.28	0.01
62	688244	永信至诚	1,506	90,721.44	0.01
63	688292	浩瀚深度	4,503	80,063.34	0.01
64	301267	华夏眼科	1,006	79,393.52	0.01
65	301095	广立微	740	69,708.00	0.01
66	301308	江波龙	819	56,232.54	0.00
67	600030	中信证券	2,350	50,807.00	0.00
68	601059	信达证券	5,628	46,431.00	0.00
69	301367	怡和嘉业	223	39,285.91	0.00
70	603281	江瀚新材	863	30,714.17	0.00
71	301356	天振股份	614	28,219.44	0.00
72	301301	川宁生物	3,574	26,197.42	0.00
73	301195	北路智控	330	25,987.50	0.00
74	301391	卡莱特	247	25,505.22	0.00
75	301330	熵基科技	694	24,248.36	0.00
76	301389	隆扬电子	1,269	23,463.81	0.00
77	301152	天力锂能	433	21,520.10	0.00
78	301349	信德新材	180	20,579.40	0.00
79	301339	通行宝	913	18,862.58	0.00
80	301363	美好医疗	445	18,605.45	0.00
81	301171	易点天下	985	18,389.95	0.00
82	301121	紫建电子	290	17,576.90	0.00
83	301317	鑫磊股份	694	17,572.08	0.00
84	301115	建科股份	685	17,563.40	0.00
85	301296	新巨丰	1,042	16,609.48	0.00
86	301328	维峰电子	191	16,433.64	0.00
87	301377	鼎泰高科	770	15,977.50	0.00
88	301223	中荣股份	815	15,444.25	0.00
89	301311	昆船智能	832	15,200.64	0.00
90	301335	天元宠物	420	14,637.00	0.00
91	301230	泓博医药	269	14,577.11	0.00
92	301338	凯格精机	257	14,178.69	0.00

93	301365	矩阵股份	516	12,863.88	0.00
94	301366	一博科技	268	12,845.24	0.00
95	301132	满坤科技	468	12,486.24	0.00
96	301290	东星医疗	330	12,170.40	0.00
97	301282	金禄电子	434	12,073.88	0.00
98	301379	天山电子	449	11,970.34	0.00
99	301361	众智科技	517	11,730.73	0.00
100	301306	西测测试	255	11,648.40	0.00
101	301273	瑞晨环保	277	11,290.52	0.00
102	603173	福斯达	588	10,966.20	0.00
103	301176	逸豪新材	544	9,498.24	0.00
104	301265	华新环保	819	9,451.26	0.00
105	301318	维海德	206	9,280.30	0.00
106	301326	捷邦科技	227	9,232.09	0.00
107	301227	森鹰窗业	284	8,744.36	0.00
108	301285	鸿日达	565	8,034.30	0.00
109	301398	星源卓镁	255	7,996.80	0.00
110	301319	唯特偶	115	7,703.85	0.00
111	301313	凡拓数创	247	7,634.77	0.00
112	301161	唯万密封	346	7,553.18	0.00
113	301316	慧博云通	359	7,233.85	0.00
114	301276	嘉曼服饰	303	7,226.55	0.00
115	301300	远翔新材	211	6,722.46	0.00
116	301388	欣灵电气	292	6,692.64	0.00
117	301368	丰立智能	337	6,554.65	0.00
118	301309	万得凯	228	5,932.56	0.00
119	301231	荣信文化	275	5,720.00	0.00
120	002648	卫星化学	119	2,093.21	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

无。

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	002484	江海股份	51,980,060.06	4.00
2	688116	天奈科技	49,255,309.97	3.79
3	002180	纳思达	48,060,506.84	3.70
4	002384	东山精密	27,733,968.31	2.13
5	300054	鼎龙股份	26,032,221.26	2.00
6	301327	华宝新能	24,108,517.80	1.85
7	002475	立讯精密	23,700,216.01	1.82

8	600256	广汇能源	20,301,339.00	1.56
9	300390	天华新能	17,992,203.41	1.38
10	600030	中信证券	17,645,446.00	1.36
11	603290	斯达半导	17,340,441.21	1.33
12	000001	平安银行	17,211,968.90	1.32
13	002415	海康威视	15,833,524.02	1.22
14	1171 HK	兖矿能源	15,509,828.81	1.19
15	000301	东方盛虹	12,051,561.37	0.93
16	600600	青岛啤酒	11,882,123.00	0.91
17	300015	爱尔眼科	11,321,916.80	0.87
18	300059	东方财富	10,364,625.00	0.80
19	600570	恒生电子	10,325,705.98	0.79
20	601888	中国中免	9,944,907.00	0.77

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	303,381,124.20
卖出股票收入（成交）总额	519,016,878.52

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，福建龙净环保股份有限公司出现本期被监管部门立案调查。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	310,494.57
2	应收清算款	37,715,391.94
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	38,025,886.51

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息（转型后）

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数	户均持有的基 金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
嘉实欣荣 混 合 (LOF) A	9,676	72,212.15	4,000,823.86	0.57	694,723,908.42	99.43
嘉实欣荣 混 合 (LOF) C	9	584.60	-	-	5,261.36	100.00
合计	9,636	72,512.45	4,000,823.86	0.57	694,729,169.78	99.43

注：(1)嘉实欣荣混合（LOF）A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份
额比例，分别为机构投资者持有嘉实欣荣混合（LOF）A 份额占嘉实欣荣混合（LOF）A 总份额比例、
个人投资者持有嘉实欣荣混合（LOF）A 份额占嘉实欣荣混合（LOF）A 总份额比例；

(2)嘉实欣荣混合（LOF）C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份
额比例，分别为机构投资者持有嘉实欣荣混合（LOF）C 份额占嘉实欣荣混合（LOF）C 总份额比例、
个人投资者持有嘉实欣荣混合（LOF）C 份额占嘉实欣荣混合（LOF）C 总份额比例。

8.2 期末上市基金前十名持有人

嘉实欣荣混合（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	刘劲松	2,306,211.00	5.89
2	宁波万坤投资管理合 伙企业（有限合伙）一 万坤全天候量化1号 私募投资基金	1,063,827.00	2.72
3	刘嵩	992,378.00	2.53
4	王依林	992,198.00	2.53
5	孙惠杰	931,099.00	2.38
6	杨正桂	791,874.00	2.02
7	宾球壮	777,128.00	1.98
8	韦杭岑	765,800.00	1.95
9	姚宏春	758,500.00	1.94
10	潘小彦	750,001.00	1.91

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实欣荣混合（LOF）A	3,928,370.30	0.56
	嘉实欣荣混合（LOF）C	-	-

	合计	3,928,370.30	0.56
--	----	--------------	------

8.4 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	份额级别	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	嘉实欣荣混合（LOF）A	>100
	嘉实欣荣混合（LOF）C	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实欣荣混合（LOF）A	>100
	嘉实欣荣混合（LOF）C	—
	合计	>100

§ 8 基金份额持有人信息（转型前）

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（%）
16,429	76,494.12	9,990,932.86	0.79	1,246,731,016.68	99.21

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	吴迅	10,089,643.00	12.79
2	钱中明	3,867,235.00	4.90
3	中国工商银行股份有限公司—兴全优选进取三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	2,634,600.00	3.34
4	刘劲松	2,306,211.00	2.92
5	文凯全	1,757,988.00	2.23
6	陆彩玉	1,518,749.00	1.92
7	潘小彦	1,504,648.00	1.91
8	宁波万坤投资管理合伙企业（有限合伙）—万坤全天候量化1号私募投资基金	1,063,827.00	1.35
9	刘嵩	992,378.00	1.26
10	王依林	992,198.00	1.26

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

8.3 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	5,491,884.78	0.44

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§9 开放式基金份额变动（转型后）

单位：份

项目	嘉实欣荣混合（LOF）A	嘉实欣荣混合（LOF）C
基金合同生效日 （2023 年 1 月 20 日） 基金份额总额	1,256,721,949.54	—
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	2,400,840.48	15,743.18
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	560,398,057.74	10,481.82
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金份 额总额	698,724,732.28	5,261.36

注：本基金期初份额为转型日（2023 年 1 月 20 日）的基金份额

§9 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2020 年 1 月 20 日） 基金份额总额	1,256,721,949.54
本报告期期初基金份额总额	1,256,721,949.54
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,256,721,949.54

§ 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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

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	458,184,332.98	20.37	289,254.70	20.00	新增
国盛证券有限责任公司	4	393,109,886.43	17.48	248,177.28	17.16	新增
中信建投证券股份有限公司	2	351,268,083.66	15.62	221,749.70	15.33	新增
中信证券股份有限公司	2	245,438,956.56	10.91	161,032.17	11.13	新增
方正证券股份有限公司	2	225,714,953.72	10.04	158,000.96	10.92	新增
长江证券股份有限公司	2	190,846,505.64	8.49	120,480.94	8.33	新增
华创证券有限责任公司	2	113,713,463.75	5.06	71,788.59	4.96	新增
安信证券股份有限公司	2	107,647,284.77	4.79	67,959.01	4.70	新增
中国国际金融股份有限公司	1	74,852,328.76	3.33	52,396.66	3.62	新增
东北证券股份有限公司	2	51,993,101.85	2.31	32,822.84	2.27	新增
中国中金财富证券有限公司	4	36,013,792.03	1.60	22,736.41	1.57	新增
财通证券股份有限公司	2	—	—	—	—	新增

大同证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	新增
东海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
国融证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
海通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
华宝证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
华鑫证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	新增
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
南京证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	新增
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	新增
首创证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
五矿证券 有限公司	2	-	-	-	-	新增
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	新增
中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	新增

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：国融证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国盛证券有限责任公司新增交易单元 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	—	—	—	—	—	—
国盛证券有限责任公司	—	—	—	—	—	—
中信建投证券股份有限公司	8,239,137.50	87.44	—	—	—	—
中信证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
方正证券股份有限公司	—	—	—	—	—	—
长江证券股份有限公司	519,324.25	5.51	—	—	—	—

华创证 券有限 责任公 司	663,674.75	7.04	-	-	-	-
安信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
财通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
大同证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
东海证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国联证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国融证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 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	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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(%)	
海通证券	2	285,265,262.	34.70	180,088.21	33.92	-

股份有限公司		27				
华创证券 有限责任 公司	2	175,808,962. 68	21.39	110,988.40	20.91	-
中信建投 证券股份 有限公司	2	119,919,677. 45	14.59	75,707.84	14.26	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	115,616,590. 87	14.06	80,931.61	15.25	-
中信证券 股份有限 公司	2	68,540,552.5 0	8.34	43,270.62	8.15	-
方正证券 股份有限 公司	2	56,952,935.8 6	6.93	39,866.89	7.51	-
安信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
财通证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
大同证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国联证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国融证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-

国盛证券 有限责任公司	4	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
南京证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- （1）经营行为规范；
- （2）财务状况良好；
- （3）研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：国融证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国盛证券有限责任公司新增交易单元 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(%)
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

有限公司						
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满及转型相关安排的公告	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	2023 年 1 月 18 日
2	关于嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	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	2023 年 1 月 20 日
3	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	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	2023 年 3 月 21 日
4	关于嘉实欣荣混合（LOF）2023 年 4 月 7 日、4 月 10 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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	2023 年 4 月 4 日
5	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	2023 年 4 月 29 日
6	关于嘉实欣荣混合（LOF）2023 年 5 月 26 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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	2023 年 5 月 24 日

7	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	2023 年 6 月 20 日
---	----------------------	-----------------------------	-----------------

10.8 其他重大事件（转型前）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于嘉实瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金封闭运作期届满及转型相关安排的公告	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	2023 年 1 月 18 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瑞熙三年封闭运作混合型证券投资基金注册的批复文件；
- （2）《嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- （3）《嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- （4）《嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照；
- （6）报告期内嘉实欣荣混合型证券投资基金（LOF）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