

# 嘉实企业变革股票型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工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。

基金托管人中国工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。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 2023 年 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>51</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>51</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	51
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 .....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实企业变革股票型证券投资基金
基金简称	嘉实企业变革股票
基金主代码	001036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 12 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	380,154,672.74 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于企业变革主题相关的股票，深入挖掘上市公司发生变革带来效率提升或者跨越发展的投资机遇。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金运用“自上而下”和“自下而上”相结合的方法精选个股，深入挖掘企业变革过程中符合经济结构调整，产业升级转型方向，且具备持续增长潜力、估值水平相对合理的上市公司。同时，辅以严格的风险管理，以获得中长期的较高投资收益。本基金所指的企业变革，主要是指在经济转型大背景下，通过变革使企业发生跨越式发展，并展现出与变革前相比成长空间巨大的股票。具体投资策略包括：大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010)65215588	(010)66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100020	100140

法定代表人	经雷	陈四清
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-24,208,951.38
本期利润	-53,419,131.80
加权平均基金份额本期利润	-0.1128
本期加权平均净值利润率	-6.57%
本期基金份额净值增长率	-4.98%
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	235,986,148.91
期末可供分配基金份额利润	0.6208
期末基金资产净值	616,140,821.65
期末基金份额净值	1.621
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	62.10%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

过去一个月	4.92%	1.07%	1.04%	0.69%	3.88%	0.38%
过去三个月	-9.39%	0.99%	-3.77%	0.66%	-5.62%	0.33%
过去六个月	-4.98%	0.94%	0.00%	0.67%	-4.98%	0.27%
过去一年	-8.47%	1.08%	-10.72%	0.79%	2.25%	0.29%
过去三年	12.96%	1.42%	-3.19%	0.96%	16.15%	0.46%
自基金合同生效起至今	62.10%	1.69%	21.40%	1.13%	40.70%	0.56%

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：

$$\text{Return}(t) = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

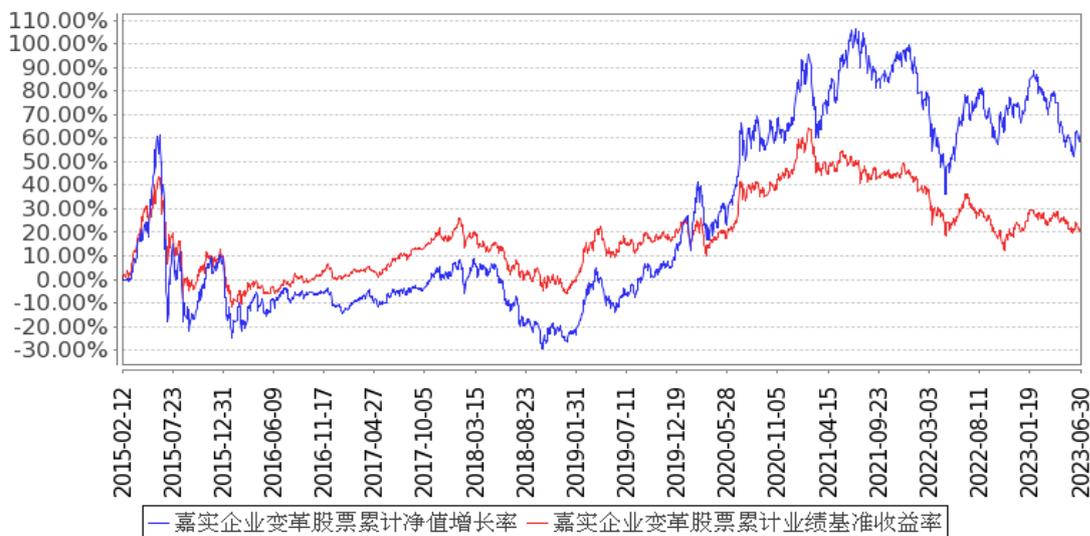
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

嘉实企业变革股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年02月12日至2023年06月30日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2023年6月30日，基金管理人共管理314只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、基础设施基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谢泽林	本基金基金经理	2017年10月17日	-	13年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司研究部任行业研究员，曾任职于股票投资部。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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
谢泽林	公募基金	1	616,140,821.65	2015年9月10日
	私募资产管理计划	2	2,172,325,604.85	2021年1月13日
	其他组合	-	-	-
	合计	3	2,788,466,426.50	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实企业变革股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽

责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 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

国内经济在 1 季度呈现复苏趋势，但进入 2 季度之后复苏的进展和幅度均有些低于预期，年初的强预期遇上了弱现实，人民币在 2 季度持续贬值。受经济基本面和预期的影响，A 股在 1 月份大幅上涨之后，2 月份开始就进入震荡调整期，上半年沪深 300 指数下跌 0.74%、中证 800 全收益指数上涨 1.23%、创业板指数下跌 5.61%。由于经济基本面乏善可陈，AI 和中特估便成为 A 股市场的两大主题，背后主要的驱动因素是板块估值的均值回归、机构配置的再均衡过程，相对而言 AI 主题由于具备远期成长空间，更容易产生估值泡沫。上半年板块表现，通信、传媒、计算机、电子等涨幅均在 30%以上，休闲服务、房地产、农业、食品饮料等板块下跌垫底。

报告期内本基金的配置重点聚焦在符合经济结构调整、产业转型升级方向的优质成长企业。在科技、先进制造、医药健康、消费等四个赛道的持仓持续进行优化，1 季度减持了涨幅较多的计算机个股，但增持的光伏和锂电个股在 2 季度表现相对较差，低估了硅料价格大幅下跌对产业链的影响程度。2 季度增持了业绩兑现度较好的食品饮料、汽车零部件、通信设备等行业个股，减持了景气度相对较低的半导体设计、农业等行业个股。上半年组合净值下跌 4.98%，跑输指数较多，部分重仓股表现不佳对组合有负贡献，给组合带来正贡献的个股仓位比例不够高，均需反思。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.621 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.98%，业绩比较基准收益率为 0.00%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年我们对市场不悲观，国内工业企业的库存周期在底部区域，经济复苏只会迟到、不会缺席。市场经过 2 季度的震荡下跌之后相对悲观，悲观中孕育机会。我们对国内经济的内生增长韧性依然保有较强的信心，充分内卷的经济体其竞争力反而更强、效率更高。我们对持仓的优质成长企业依然抱有坚定信心，其业绩持续成长终究会在股价的收益率上兑现。我们看好食品饮料、智能控制器、快递、工控、产业互联网、医疗设备、检测服务、新能源等细分领域优质企业的业绩兑现。同时，我们也会持续对持仓进一步优化，不断挖掘业绩超预期的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实企业变革股票型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	28,501,809.16	41,361,338.46
结算备付金		2,019,050.32	1,703,865.34
存出保证金		221,141.49	89,469.45
交易性金融资产	6.4.7.2	592,805,442.66	653,348,540.14
其中：股票投资		571,731,123.95	638,622,094.47
基金投资		-	-
债券投资		21,074,318.71	14,726,445.67
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		5.03	875,434.78
应收股利		-	-
应收申购款		461,547.65	60,750,354.02

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		624,008,996.31	758,129,002.19
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		6,142,839.39	4,107,352.43
应付赎回款		148,186.38	55,516.93
应付管理人报酬		764,442.15	764,854.40
应付托管费		127,407.04	127,475.73
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		371.34	135.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	684,928.36	634,355.75
负债合计		7,868,174.66	5,689,691.06
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	380,154,672.74	441,097,840.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	235,986,148.91	311,341,470.61
净资产合计		616,140,821.65	752,439,311.13
负债和净资产总计		624,008,996.31	758,129,002.19

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.621 元，基金份额总额 380,154,672.74 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实企业变革股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-46,276,367.91	-54,140,779.30
1. 利息收入		102,298.32	18,214.05
其中：存款利息收入	6.4.7.13	102,298.32	18,214.05
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）		-18,658,105.29	-15,950,696.35
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-23,924,053.59	-19,973,233.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,110,064.91	1,859,023.95
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	4,155,883.39	2,163,513.48
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-29,210,180.42	-38,228,276.46
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	1,489,619.48	19,979.46
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,142,763.89</b>	<b>3,751,684.63</b>
1. 管理人报酬		6,036,866.67	3,131,527.19
2. 托管费		1,006,144.47	521,921.19
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		242.13	45.67
8. 其他费用	6.4.7.23	99,510.62	98,190.58
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-53,419,131.80</b>	<b>-57,892,463.93</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-53,419,131.80</b>	<b>-57,892,463.93</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-53,419,131.80</b>	<b>-57,892,463.93</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实企业变革股票型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	441,097,840.52	-	311,341,470.61	752,439,311.13
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)	441,097,840.52	-	311,341,470.61	752,439,311.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-60,943,167.78	-	-75,355,321.70	-136,298,489.48
(一)、综合收益总额	-	-	-53,419,131.80	-53,419,131.80
(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)	-60,943,167.78	-	-21,936,189.90	-82,879,357.68
其中：1. 基金申	178,979,709.70	-	128,104,472.66	307,084,182.36

购款				
2. 基金赎回款	-239,922,877.48	-	-150,040,662.56	-389,963,540.04
(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)	380,154,672.74	-	235,986,148.91	616,140,821.65
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)	251,566,508.13	-	250,800,227.16	502,366,735.29
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)	251,566,508.13	-	250,800,227.16	502,366,735.29

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,727,264.78	-	-59,633,889.15	-63,361,153.93
(一)、综合收益总额	-	-	-57,892,463.93	-57,892,463.93
(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)	-3,727,264.78	-	-1,741,425.22	-5,468,690.00
其中:1.基金申购款	10,919,393.72	-	7,711,822.59	18,631,216.31
2.基金赎回款	-14,646,658.50	-	-9,453,247.81	-24,099,906.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基	247,839,243.35	-	191,166,338.01	439,005,581.36

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

嘉实企业变革股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]97 号《关于准予嘉实企业变革股票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《嘉实企业变革股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实企业变革股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 2 月 12 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,825,389,936.38 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实企业变革股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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	28,501,809.16
等于：本金	28,499,553.62
加：应计利息	2,255.54
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	28,501,809.16

##### 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	616,388,698.93	-	571,731,123.95	-44,657,574.98
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	20,877,856.50	93,340.71	21,074,318.71	103,121.50
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,877,856.50	93,340.71	21,074,318.71	103,121.50
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		637,266,555.43	93,340.71	592,805,442.66	-44,554,453.48

#### 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	67.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	598,080.88
其中：交易所市场	598,080.88
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	86,780.45
合计	684,928.36

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	441,097,840.52	441,097,840.52
本期申购	178,979,709.70	178,979,709.70
本期赎回（以“-”号填列）	-239,922,877.48	-239,922,877.48
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	380,154,672.74	380,154,672.74

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	509,933,029.07	-198,591,558.46	311,341,470.61
本期利润	-24,208,951.38	-29,210,180.42	-53,419,131.80
本期基金份额交易产生的变动数	-69,681,959.29	47,745,769.39	-21,936,189.90
其中：基金申购款	212,308,116.73	-84,203,644.07	128,104,472.66
基金赎回款	-281,990,076.02	131,949,413.46	-150,040,662.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	416,042,118.40	-180,055,969.49	235,986,148.91

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	87,937.92
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	11,204.22
其他	3,156.18
合计	102,298.32

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-23,924,053.59
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	-23,924,053.59

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	767,636,914.32
减：卖出股票成本总额	789,657,065.34
减：交易费用	1,903,902.57
买卖股票差价收入	-23,924,053.59

##### 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1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	100,308.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,009,756.88
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	1,110,064.91

## 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1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	17,046,399.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,997,256.01
减：应计利息总额	38,088.76
减：交易费用	1,297.44
买卖债券差价收入	1,009,756.88

## 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1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,155,883.39
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,155,883.39

## 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6月30日
1. 交易性金融资产	-29,210,180.42
股票投资	-28,574,593.79
债券投资	-635,586.63
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-29,210,180.42

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	1,395,848.14
基金转出费收入	93,771.34
合计	1,489,619.48

#### 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6月30日
审计费用	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	3,728.06
债券托管账户维护费	9,000.00
存托服务费	2.11
合计	99,510.62

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,036,866.67	3,131,527.19
其中：支付销售机构的客户维护费	1,645,331.99	1,211,305.18

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1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,006,144.47	521,921.19

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
中国工商银行股份有限公司_活期	28,501,809.16	87,937.92	8,899,761.72	13,151.71

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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
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	1,305	15,503.40	27,431.10	-
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	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
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	2023年	6个月	新股锁	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-

	环保	3月28日		定							
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		-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股锁定	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01		-
301260	格力博	2023年1月20日	6个月	新股锁定	30.85	23.63	1,461	45,071.85	34,523.43		-
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		-
301303	真兰仪表	2023年2月13日	6个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56		-
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日	6个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98		-
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		-

301322	绿通科技	2023年 2月27日	6个月	新股锁定	131.11	53.24	365	31,859.73	19,432.60	-
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	-
301358	湖南裕能	2023年 2月1日	6个月	新股锁定	23.77	42.89	1,077	25,600.29	46,192.53	-
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	-
301386	未来电器	2023年 3月21日	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
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	-

		日									
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股锁定	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05		-
301419	阿莱德	2023年2月2日	6个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50		-
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		-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10		-
601061	中信金属	2023年3月30日	6个月	新股锁定	6.58	7.58	2,896	19,055.68	21,951.68		-
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	875	31,631.25	33,363.75		-
688249	晶合集成	2023年4月24日	6个月	新股锁定	19.86	18.06	4,838	96,082.68	87,374.28		-
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	颀中科技	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	731	17,251.60	47,273.77		-
688429	时创	2023年	6个月	新股锁	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38		-

	能源	6月20日		定							
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	10,005	56,928.45	54,127.05		-
688472	阿特斯	2023年6月2日	6个月	新股锁定	11.10	17.04	3,437	38,150.70	58,566.48		-
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	861	34,431.39	31,607.31		-
688507	索辰科技	2023年4月10日	6个月	新股锁定	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42		-
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	796	24,086.96	20,162.68	-
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日	6个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
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

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是主要投资于企业变革主题相关的股票，深入挖掘上市公司发生变革带来效率提升或者跨越发展的投资机遇。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

#### 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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,370,301.83	-
合计	6,370,301.83	-

注：评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	13,397,174.96	14,726,445.67
未评级	1,306,841.92	-
合计	14,704,016.88	14,726,445.67

注：评级取自第三方评级机构。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的

其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	28,501,809.16	-	-	-	28,501,809.16
结算备付金	2,019,050.32	-	-	-	2,019,050.32
存出保证金	221,141.49	-	-	-	221,141.49
交易性金融资产	7,677,143.75	13,397,174.96	-	-571,731,123.95	592,805,442.66
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	5.03	5.03
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	461,547.65	461,547.65
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	38,419,144.72	13,397,174.96	-	-572,192,676.63	624,008,996.31
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	-	-	-	6,142,839.39	6,142,839.39
应付赎回款	-	-	-	148,186.38	148,186.38
应付管理人报酬	-	-	-	764,442.15	764,442.15
应付托管费	-	-	-	127,407.04	127,407.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	371.34	371.34
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	684,928.36	684,928.36
负债总计	-	-	-	7,868,174.66	7,868,174.66
利率敏感度缺口	38,419,144.72	13,397,174.96	-	-564,324,501.97	616,140,821.65
上年度末 2022年12月31日					
资产					
银行存款	41,361,338.46	-	-	-	41,361,338.46
结算备付金	1,703,865.34	-	-	-	1,703,865.34
存出保证金	89,469.45	-	-	-	89,469.45
交易性金融资产	-	14,726,445.67	-	-638,622,094.47	653,348,540.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	875,434.78	875,434.78
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	60,750,354.02	60,750,354.02
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	43,154,673.25	14,726,445.67	-	700,247,883.27	758,129,002.19
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	4,107,352.43	4,107,352.43
应付赎回款	-	-	-	55,516.93	55,516.93
应付管理人报酬	-	-	-	764,854.40	764,854.40
应付托管费	-	-	-	127,475.73	127,475.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	135.82	135.82
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	634,355.75	634,355.75
负债总计	-	-	-	5,689,691.06	5,689,691.06
利率敏感度缺口	43,154,673.25	14,726,445.67	-	-694,558,192.21	752,439,311.13

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-95,905.93	-122,129.55
	市场利率下降25个基点	96,816.79	123,592.46

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	571,731,123.95	92.79	638,622,094.47	84.87
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	571,731,123.95	92.79	638,622,094.47	84.87

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	30,020,689.28	46,165,259.60
	业绩比较基准下降5%	-30,020,689.28	-46,165,259.60

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	583,429,402.99	644,475,378.88
第二层次	8,044,090.93	-
第三层次	1,331,948.74	8,873,161.26
合计	592,805,442.66	653,348,540.14

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：无）。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	571,731,123.95	91.62
	其中：股票	571,731,123.95	91.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,074,318.71	3.38
	其中：债券	21,074,318.71	3.38
	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	30,520,859.48	4.89
8	其他各项资产	682,694.17	0.11
9	合计	624,008,996.31	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	22,398,104.70	3.64
B	采矿业	96,268.00	0.02
C	制造业	413,591,375.86	67.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	97,123.52	0.02
F	批发和零售业	21,360,811.43	3.47
G	交通运输、仓储和邮政业	30,267,591.58	4.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,286,717.78	7.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	35,390,108.18	5.74
N	水利、环境和公共设施管理业	79,964.22	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	118,360.21	0.02
R	文化、体育和娱乐业	9,251.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	571,731,123.95	92.79

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002139	拓邦股份	2,911,500	37,995,075.00	6.17
2	300012	华测检测	1,804,701	35,191,669.50	5.71
3	002352	顺丰控股	661,118	29,809,810.62	4.84
4	300124	汇川技术	445,300	28,592,713.00	4.64
5	603613	国联股份	725,938	26,808,890.34	4.35
6	603345	安井食品	180,000	26,424,000.00	4.29
7	300760	迈瑞医疗	86,669	25,983,366.20	4.22
8	300207	欣旺达	1,400,743	22,860,125.76	3.71
9	300498	温氏股份	1,219,962	22,386,302.70	3.63

10	300146	汤臣倍健	924,500	22,169,510.00	3.60
11	603883	老百姓	710,140	21,197,679.00	3.44
12	002410	广联达	607,400	19,734,426.00	3.20
13	002675	东诚药业	1,323,800	19,473,098.00	3.16
14	002085	万丰奥威	2,542,800	17,621,604.00	2.86
15	002384	东山精密	655,800	16,985,220.00	2.76
16	000423	东阿阿胶	283,300	15,142,385.00	2.46
17	002126	银轮股份	799,999	14,159,982.30	2.30
18	002965	祥鑫科技	237,800	13,240,704.00	2.15
19	000063	中兴通讯	280,000	12,751,200.00	2.07
20	688033	天宜上佳	564,306	10,789,530.72	1.75
21	301004	嘉益股份	259,400	10,064,720.00	1.63
22	688408	中信博	107,884	9,097,857.72	1.48
23	002459	晶澳科技	211,740	8,829,558.00	1.43
24	600702	舍得酒业	67,501	8,366,748.95	1.36
25	002129	TCL 中环	250,000	8,300,000.00	1.35
26	600686	金龙汽车	1,000,000	8,140,000.00	1.32
27	688711	宏微科技	132,000	7,700,880.00	1.25
28	605589	圣泉集团	300,000	6,522,000.00	1.06
29	600809	山西汾酒	35,000	6,477,450.00	1.05
30	002484	江海股份	300,000	6,387,000.00	1.04
31	601677	明泰铝业	430,000	5,968,400.00	0.97
32	601012	隆基绿能	200,000	5,734,000.00	0.93
33	603517	绝味食品	150,000	5,572,500.00	0.90
34	688390	固德威	31,909	5,324,335.74	0.86
35	300661	圣邦股份	64,341	5,284,326.33	0.86
36	688308	欧科亿	114,852	4,594,080.00	0.75
37	003038	鑫铂股份	90,000	3,731,400.00	0.61
38	002841	视源股份	25,000	1,671,000.00	0.27
39	603605	珀莱雅	14,000	1,573,600.00	0.26
40	300726	宏达电子	18,700	836,264.00	0.14
41	603185	弘元绿能	7,890	588,199.50	0.10
42	600233	圆通速递	31,441	457,780.96	0.07
43	688089	嘉必优	11,446	341,090.80	0.06
44	688617	惠泰医疗	896	334,880.00	0.05
45	300747	锐科激光	10,000	304,800.00	0.05
46	002050	三花智控	10,000	302,600.00	0.05
47	688582	芯动联科	6,476	299,402.44	0.05
48	300408	三环集团	9,991	293,235.85	0.05
49	688508	芯朋微	5,000	289,950.00	0.05
50	600933	爱柯迪	12,100	281,809.00	0.05
51	688543	国科军工	4,094	228,607.10	0.04
52	300285	国瓷材料	7,465	204,541.00	0.03

53	688581	安杰思	1,629	198,809.23	0.03
54	301262	海看股份	6,917	190,389.75	0.03
55	688639	华恒生物	2,039	184,488.72	0.03
56	603369	今世缘	3,400	179,520.00	0.03
57	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.03
58	688536	思瑞浦	769	167,642.00	0.03
59	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.03
60	688334	西高院	8,879	157,912.84	0.03
61	300709	精研科技	6,180	152,460.60	0.02
62	603927	中科软	3,800	146,528.00	0.02
63	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.02
64	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.02
65	301315	威士顿	2,253	132,828.53	0.02
66	603195	公牛集团	1,332	127,951.92	0.02
67	301141	中科磁业	2,617	119,750.28	0.02
68	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.02
69	601065	江盐集团	8,748	116,094.39	0.02
70	300593	新雷能	5,000	114,550.00	0.02
71	002414	高德红外	14,170	110,100.90	0.02
72	688631	莱斯信息	3,357	108,400.08	0.02
73	688479	友车科技	3,318	103,760.10	0.02
74	688200	华峰测控	651	99,603.00	0.02
75	600587	新华医疗	2,800	98,924.00	0.02
76	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.02
77	688429	时创能源	3,452	98,752.08	0.02
78	301357	北方长龙	1,900	98,250.90	0.02
79	301323	新莱福	2,277	97,593.33	0.02
80	601133	柏诚股份	6,632	97,123.52	0.02
81	688535	华海诚科	1,607	96,642.01	0.02
82	600547	山东黄金	4,100	96,268.00	0.02
83	688118	普元信息	2,781	96,027.93	0.02
84	300567	精测电子	1,000	95,150.00	0.02
85	301386	未来电器	3,776	94,554.26	0.02
86	601689	拓普集团	1,154	93,127.80	0.02
87	603666	亿嘉和	2,044	92,286.60	0.01
88	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.01
89	688249	晶合集成	4,838	87,374.28	0.01
90	688798	艾为电子	1,435	84,880.25	0.01
91	002959	小熊电器	1,000	83,500.00	0.01
92	301157	华塑科技	1,498	83,481.42	0.01
93	300496	中科创达	865	83,342.75	0.01
94	301295	美硕科技	2,146	81,770.28	0.01
95	301428	世纪恒通	2,289	80,343.40	0.01

96	301203	国泰环保	2,243	79,964.22	0.01
97	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
98	301337	亚华电子	2,318	78,804.24	0.01
99	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.01
100	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
101	688311	盟升电子	1,085	75,884.90	0.01
102	603882	金域医学	1,000	75,500.00	0.01
103	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
104	300369	绿盟科技	5,791	71,634.67	0.01
105	002241	歌尔股份	4,000	71,000.00	0.01
106	603678	火炬电子	2,000	68,920.00	0.01
107	688608	恒玄科技	500	60,515.00	0.01
108	603799	华友钴业	1,300	59,683.00	0.01
109	301129	瑞纳智能	800	58,936.00	0.01
110	688472	阿特斯	3,437	58,566.48	0.01
111	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.01
112	688469	中芯集成	10,005	54,127.05	0.01
113	688361	中科飞测	731	47,273.77	0.01
114	002609	捷顺科技	4,000	46,640.00	0.01
115	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.01
116	301358	湖南裕能	1,077	46,192.53	0.01
117	603125	常青科技	1,596	44,779.00	0.01
118	603305	旭升集团	1,400	39,018.00	0.01
119	688077	大地熊	1,280	38,668.80	0.01
120	688595	芯海科技	1,172	37,480.56	0.01
121	001282	三联锻造	1,045	37,026.15	0.01
122	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
123	301260	格力博	1,461	34,523.43	0.01
124	603180	金牌厨柜	1,000	33,520.00	0.01
125	688146	中船特气	875	33,363.75	0.01
126	301165	锐捷网络	522	32,217.84	0.01
127	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.01
128	688484	南芯科技	861	31,607.31	0.01
129	300835	龙磁科技	1,000	31,380.00	0.01
130	001360	南矿集团	1,762	30,163.44	0.00
131	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
132	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
133	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
134	688381	帝奥微	861	27,793.08	0.00
135	001287	中电港	1,305	27,431.10	0.00
136	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
137	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
138	003028	振邦智能	608	25,420.48	0.00

139	001367	海森药业	549	24,687.92	0.00
140	301311	昆船智能	832	24,527.36	0.00
141	300373	扬杰科技	600	24,342.00	0.00
142	301391	卡莱特	203	23,785.51	0.00
143	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
144	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.00
145	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
146	301368	丰立智能	337	23,317.03	0.00
147	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
148	601061	中信金属	2,896	21,951.68	0.00
149	603172	万丰股份	1,220	21,138.94	0.00
150	301339	通行宝	825	20,732.25	0.00
151	688570	天玛智控	796	20,162.68	0.00
152	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
153	301322	绿通科技	365	19,432.60	0.00
154	301367	怡和嘉业	131	19,432.54	0.00
155	301363	美好医疗	437	19,223.63	0.00
156	301267	华夏眼科	313	19,077.35	0.00
157	301366	一博科技	434	18,857.30	0.00
158	301195	北路智控	398	18,530.88	0.00
159	688002	睿创微纳	409	18,323.20	0.00
160	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
161	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
162	002912	中新赛克	400	17,604.00	0.00
163	689009	九号公司	470	17,319.50	0.00
164	605499	东鹏饮料	100	17,290.00	0.00
165	301377	鼎泰高科	751	17,273.00	0.00
166	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
167	301230	泓博医药	377	16,927.30	0.00
168	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
169	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
170	301296	新巨丰	942	15,900.96	0.00
171	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
172	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
173	301152	天力锂能	337	15,050.42	0.00
174	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
175	002439	启明星辰	500	14,880.00	0.00
176	301327	华宝新能	188	14,872.68	0.00
177	301328	维峰电子	257	14,633.58	0.00
178	301361	众智科技	517	14,574.23	0.00
179	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
180	301389	隆扬电子	778	14,144.04	0.00
181	688593	新相微	959	13,991.81	0.00

182	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
183	301356	天振股份	630	13,797.00	0.00
184	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
185	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
186	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
187	301223	中荣股份	698	13,066.56	0.00
188	301365	矩阵股份	774	12,740.04	0.00
189	301379	天山电子	449	12,540.57	0.00
190	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
191	301335	天元宠物	517	12,325.28	0.00
192	002714	牧原股份	280	11,802.00	0.00
193	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
194	301115	建科股份	475	10,858.50	0.00
195	300681	英搏尔	500	10,645.00	0.00
196	301290	东星医疗	330	10,576.50	0.00
197	301313	凡拓数创	247	10,455.51	0.00
198	600399	抚顺特钢	1,000	10,200.00	0.00
199	301398	星源卓镁	255	9,562.50	0.00
200	301265	华新环保	819	9,516.78	0.00
201	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
202	301176	逸豪新材	544	9,345.92	0.00
203	301231	荣信文化	275	9,251.00	0.00
204	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
205	301273	瑞晨环保	277	8,686.72	0.00
206	301326	捷邦科技	227	8,632.81	0.00
207	688273	麦澜德	223	8,253.23	0.00
208	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
209	301285	鸿日达	565	8,186.85	0.00
210	301161	唯万密封	346	7,996.06	0.00
211	301227	森鹰窗业	284	7,875.32	0.00
212	301388	欣灵电气	292	7,840.20	0.00
213	301276	嘉曼服饰	303	7,726.50	0.00
214	301349	信德新材	143	7,170.02	0.00
215	600481	双良节能	500	6,990.00	0.00
216	301319	唯特偶	115	6,882.75	0.00
217	301309	万得凯	228	6,279.12	0.00
218	300476	胜宏科技	238	5,738.18	0.00
219	002600	领益智造	800	5,528.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	603345	安井食品	32,569,574.00	4.33
2	002139	拓邦股份	29,116,818.00	3.87
3	002352	顺丰控股	26,266,908.00	3.49
4	300146	汤臣倍健	25,686,307.04	3.41
5	300012	华测检测	22,224,306.46	2.95
6	603613	国联股份	21,965,848.15	2.92
7	300760	迈瑞医疗	19,779,918.00	2.63
8	002410	广联达	18,843,269.20	2.50
9	002085	万丰奥威	18,304,415.00	2.43
10	002129	TCL 中环	18,125,481.50	2.41
11	600481	双良节能	17,531,044.04	2.33
12	601318	中国平安	17,450,689.00	2.32
13	300124	汇川技术	15,661,208.00	2.08
14	002851	麦格米特	15,586,385.00	2.07
15	603883	老百姓	15,185,939.50	2.02
16	688390	固德威	14,719,582.06	1.96
17	002459	晶澳科技	14,618,829.00	1.94
18	605111	新洁能	14,504,404.52	1.93
19	300207	欣旺达	14,497,618.00	1.93
20	000423	东阿阿胶	13,512,541.00	1.80

#### 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	300496	中科创达	40,532,553.45	5.39
2	300760	迈瑞医疗	30,137,300.00	4.01
3	002410	广联达	28,685,769.00	3.81
4	002352	顺丰控股	26,569,624.32	3.53
5	605111	新洁能	25,106,346.08	3.34
6	603185	弘元绿能	21,362,103.35	2.84
7	600933	爱柯迪	21,279,125.36	2.83
8	002384	东山精密	18,588,626.84	2.47
9	002439	启明星辰	18,452,025.79	2.45
10	002959	小熊电器	18,417,954.81	2.45
11	600481	双良节能	18,388,403.14	2.44
12	300012	华测检测	18,247,273.62	2.43
13	601689	拓普集团	17,702,438.00	2.35
14	002414	高德红外	17,618,866.81	2.34
15	301129	瑞纳智能	16,989,551.00	2.26
16	002851	麦格米特	16,250,012.74	2.16
17	002714	牧原股份	15,905,102.04	2.11
18	601318	中国平安	15,471,236.00	2.06
19	300285	国瓷材料	14,709,670.40	1.95

20	601012	隆基绿能	14,190,273.40	1.89
----	--------	------	---------------	------

#### 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	751,340,688.61
卖出股票收入（成交）总额	767,636,914.32

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	7,677,143.75	1.25
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）	13,397,174.96	2.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,074,318.71	3.42

#### 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	113025	明泰转债	58,200	12,536,830.11	2.03
2	019688	22 国债 23	41,000	4,145,889.67	0.67
3	019694	23 国债 01	22,000	2,224,412.16	0.36
4	019703	23 国债 10	13,000	1,306,841.92	0.21
5	113582	火炬转债	5,100	860,344.85	0.14

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

无。

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

无。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	221,141.49
2	应收清算款	5.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	461,547.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	682,694.17

### 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	113025	明泰转债	12,536,830.11	2.03
2	113582	火炬转债	860,344.85	0.14

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
13,218	28,760.38	141,692,842.25	37.27	238,461,830.49	62.73

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,706,134.33	0.45

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	>=100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 2 月 12 日) 基金份额总额	1,825,389,936.38
本报告期期初基金份额总额	441,097,840.52
本报告期基金总申购份额	178,979,709.70
减：本报告期基金总赎回份额	239,922,877.48
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	380,154,672.74

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安证券股份有限公司	3	275,823,183.18	18.34	193,078.62	19.02	-
华泰证券股份有限公司	3	228,535,086.89	15.19	159,974.56	15.76	-

公司						
国盛证券 有限责任 公司	4	141,223,531. 84	9.39	89,155.13	8.78	-
东方财富 证券股份 有限公司	2	139,824,181. 62	9.29	88,272.03	8.70	-
浙商证券 股份有限 公司	2	135,316,855. 22	9.00	88,152.15	8.68	-
中信证券 股份有限 公司	4	118,148,226. 55	7.85	82,703.70	8.15	-
国金证券 股份有限 公司	1	113,010,576. 06	7.51	79,107.86	7.79	-
长江证券 股份有限 公司	2	107,225,097. 29	7.13	75,060.32	7.39	-
东吴证券 股份有限 公司	1	42,371,668.7 9	2.82	26,749.23	2.64	-
东方证券 股份有限 公司	2	40,676,751.8 3	2.70	25,678.49	2.53	-
天风证券 股份有限 公司	2	40,293,989.3 6	2.68	25,438.11	2.51	-
申万宏源 证券有限 公司	1	37,414,394.4 3	2.49	26,190.10	2.58	-
广发证券 股份有限 公司	5	34,942,648.2 3	2.32	22,058.85	2.17	-
中信建投 证券股份 有限公司	3	32,443,601.9 6	2.16	22,710.52	2.24	-
开源证券 股份有限 公司	2	17,075,891.0 7	1.14	10,780.06	1.06	-
安信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
东兴证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
高盛（中 国）证 券有限 责任公 司	2	-	-	-	-	-
光大证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
国都证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
国联证 券股份 有限公 司	2	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	2	-	-	-	-	-
海通证 券股份 有限公 司	3	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	2	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	1	-	-	-	-	-
华金证 券股份 有限公 司	2	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	1	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	2	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份	2	-	-	-	-	-

有限公司						
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
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. 高盛高华证券有限责任公司更名为高盛（中国）证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：长江证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：财通证券股份有限公司新增交易单元 2 个，广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国联证券股份有限公司新增交易单元 2 个，国盛证券有限责任公司新增交易单元 2 个，华泰证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰君安证券股份有限公司	1,181,455.61	2.95	-	-	-	-

华泰证 券股份 有限公 司	12,540,508. 98	31.35	-	-	-	-
国盛证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	11,025,320. 78	27.56	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	3,580,720.2 2	8.95	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	6,348,656.3 9	15.87	-	-	-	-

广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	5,329,837.57	13.32	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛(中国)证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

海通证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华福证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
华金证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国银 河证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券有 限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
--------------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 2 月 28 日
2	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	证券日报、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
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 4 月 29 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023 年 6 月 20 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023-05-08 至 2023-05-28	53,897,967.51	79,574,238.57	133,472,206.08	-	-

#### 产品特有风险

报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实企业变革股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实企业变革股票型证券投资基金基金合同》；

- (3) 《嘉实企业变革股票型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实企业变革股票型证券投资基金招募说明书》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实企业变革股票型证券投资基金公告的各项原稿。

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2023 年 8 月 29 日