

# 嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
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	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12 投资组合报告附注	51
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金
基金简称	嘉合锦创优势精选混合
基金主代码	006992
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月16日
基金管理人	嘉合基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,970,897.98份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求有效控制风险和保持资金流动性的前提下，基于较为中长期的持股周期和较为合理的风险收益比，运用"核心+卫星"策略，精选具备良好成长性的股票和被市场低估的价值股，注重安全边际，同时兼顾主题和趋势投资机会，力争为持有人资产追求可持续的、中长期的稳定增值。
投资策略	本基金通过定性与定量相结合的基本面分析体系，坚持"自下而上"为主、"自上而下"为辅的投资视角，通过把握和判断行业发展趋势及行业景气程度变化，精选出具有中长期价值持续增长或者被显著低估的上市公司，运用"核心+卫星"策略，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力求为持有人资产追求可持续的、中长期的稳定增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 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		嘉合基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	崔为中	秦一楠
	联系电话	021-60168288	010-66060069
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-0603-299	95599
传真		021-65015077	010-68121816
注册地址		上海市虹口区广纪路738号1幢329室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200082	100031
法定代表人		金川	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼

## §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01月01日-2023年06月30日)

本期已实现收益	-647,502.17
本期利润	-97,494.28
加权平均基金份额本期利润	-0.0046
本期加权平均净值利润率	-0.30%
本期基金份额净值增长率	-0.31%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	10,591,390.10
期末可供分配基金份额利润	0.5051
期末基金资产净值	31,562,288.08
期末基金份额净值	1.5051
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	50.51%

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、所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（为期末余额，不是当期发生数）。

## 3.2 基金净值表现

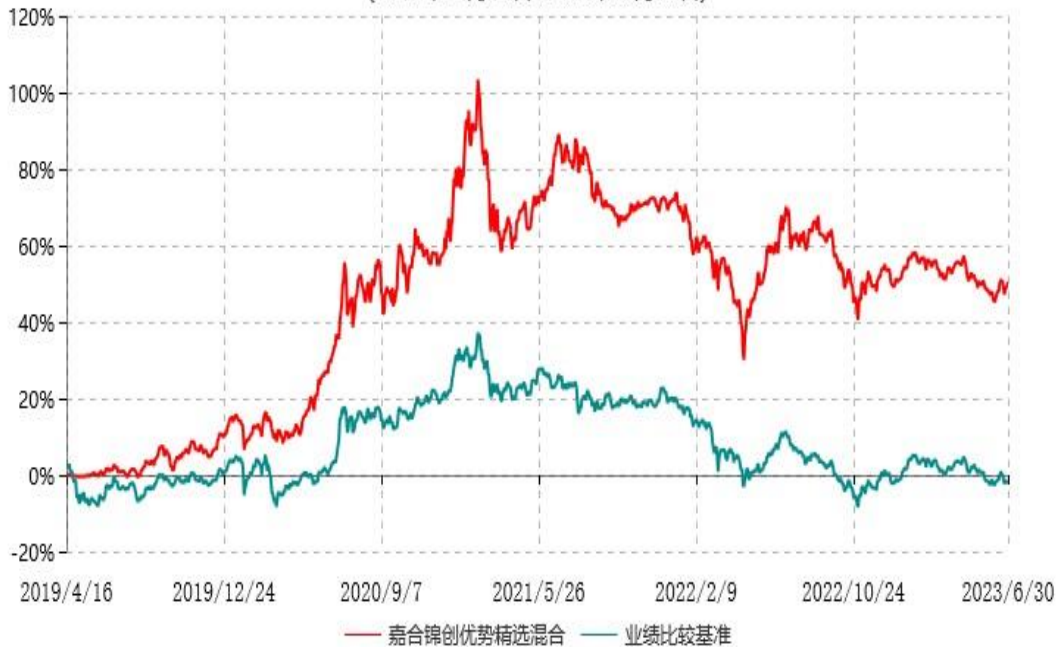
### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.12%	0.73%	0.96%	0.70%	1.16%	0.03%
过去三个月	-2.48%	0.61%	-3.93%	0.66%	1.45%	-0.05%
过去六个月	-0.31%	0.61%	-0.36%	0.67%	0.05%	-0.06%
过去一年	-9.53%	0.91%	-11.19%	0.79%	1.66%	0.12%

过去三年	10.10%	1.31%	-5.58%	0.96%	15.68%	0.35%
自基金合同生效起至今	50.51%	1.19%	-1.58%	0.98%	52.09%	0.21%

### 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变动的比较

嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年04月16日-2023年06月30日)



注：截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

## §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

嘉合基金管理有限公司（以下简称“嘉合基金”或“公司”）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年8月8日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇



仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2023年6月30日，公司注册资本金为人民币3亿元。

截至2023年6月30日，嘉合基金旗下共管理25只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合中债-1-3年政策性金融债指数证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合锦鑫混合型证券投资基金、嘉合磐弘一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐恒债券型证券投资基金、嘉合磐益纯债债券型证券投资基金、嘉合胶东经济圈中高等级信用债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、嘉合锦荣混合型证券投资基金及嘉合磐辉纯债债券型证券投资基金。

#### 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		
杨彦喆	嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股股票型证券投资基金的基金经理。	2020-06-22	-	8年	伯明翰大学金融工程硕士，南京大学工业工程学士。2015年加入嘉合基金管理有限公司量化投资部，负责量化选股、期货CTA策略和量化策略平台的开发。

注：1、杨彦喆的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》和其他有关法律、法规、基金合同的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，没有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

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

#### 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2023年上半年，市场进入战略机遇和风险挑战并存、不确定难预料因素增多的时期。经济基本面复苏力度不强。整体来看，市场机会更多在于技术、事件、政策驱动带来的主题行情；其中穿插的两次复苏交易，都是在市场已经充分反映悲观预期之后的情绪修复，事后看也并没有带来总量板块的主升浪。具体分析，2023年2月至4月，AI及中特估主题领涨市场，而新能源产业链进入降价博弈阶段，持续下跌。进入5月份后，年报、一季报出炉，业绩表现较好但前期滞涨的行业启动反弹，典型的有新能源产业链、可选消费等行业；与此同时前期涨幅明显的中特估主题波动放大。

在二季度投资策略方面，进入到我们擅长的以业绩为基，寻找高增长且基本面坚实的股票为主线的市场环境。我们在兼顾各行业特征的前提下，重点侧重成长风格，以市场分析师评价、量价特征为辅助构建我们的投资组合。最终我们的组合呈现高成长、高质量、低估值的特征，在具备安全边际的前提下兼顾进攻性，以期为投资者创造良好的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合锦创优势精选混合基金份额净值为1.5051元，本报告期内，基金份额净值增长率为-0.31%，同期业绩比较基准收益率为-0.36%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年，在前期积压需求释放、政策性力量支撑和低基数效应的共同作用下，中国宏观经济恢复性增长态势明显，需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力得到不同程度的缓解，呈现出“触底反弹”的运行特征。不同于以往经济周期，在经历了过去三年之后，本轮中国经济复苏需经历社会秩序与交易修复阶段、资产负债表修复阶段、常态化扩展阶段等三个不同阶段，当前中国经济复苏正处于从第一阶段向第二阶段转换的关键期，这既是中国经济复苏的恢复性增长期，也是各种潜在风险显化和矛盾的集中爆发期。从权益视角来看，当前市场或已经处在预期的冰点附近。市场预期变化并非一蹴而就，年初以来，市场在现实与预期的交织中震荡，但最终“弱预期，弱现实”的组合成为了市场的主导因素，上证指数也在这一过程中逐步走弱。展望下半年，预期与现实的再平衡将会是市场最值得关注的变化。政策方面，我们仍然可以期待政策的积极调整，中美关系的缓和也将缓解当前市场的压力。经济方面，经济渐进的恢复，服务业的修复以及政策的呵护将会支撑经济逐步回升。前期库存周期与价格下行带来的压力或将逐步缓解。从行走趋势来看，政策持续支持的方向值得关注，主要包括半导体产业链（半导体设备、面板、存储、封测等）、AI相关的硬件方向（光模块、服务器）等。“中特估”或许也将是资本市场发展的重要方向之一，重点关注国企改革相关方向，主要包括央企的并购重组方向以及国企改革专项行动方向。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会，委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议，并和相关托管人充分协商后，向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告，以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意，并经本公司总经理批准后实施。

基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

除了投资总监外，其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员，不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种，基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

对于在交易所上市的证券，采用交易所发布的行情信息来估值。对于固定收益品种，采用中国证券投资基金业协会核算估值工作小组免费提供的固定收益品种的估值处理标准来估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 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

本基金自2020年2月14日起至2023年6月30日基金资产净值低于人民币五千万元，已经连续六十个工作日以上。本基金管理人已按照法律法规和基金合同的要求向中国证监会报告并提交了解决方案。

## §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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-嘉合基金管理有限公司2023年1月1日至2023年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，嘉合基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，嘉合基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §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：嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06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	4,179,715.93	6,313,625.61
结算备付金		-	-
存出保证金		7,802.40	1,284.10
交易性金融资产	6.4.7.2	27,484,676.14	25,580,749.13
其中：股票投资		27,484,676.14	25,580,749.13
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	9.99

递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		31,672,194.47	31,895,668.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		38,352.93	34,736.09
应付托管费		2,556.84	2,315.74
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	6.4.7.5	68,996.62	45,928.99
负债合计		109,906.39	82,980.82
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	20,970,897.98	21,070,843.08
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	10,591,390.10	10,741,844.93
净资产合计		31,562,288.08	31,812,688.01
负债和净资产总计		31,672,194.47	31,895,668.83

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额净值1.5051元，基金份额总额20,970,897.98份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		173,370.89	-78,067.50
1.利息收入		23,807.23	1,360.69
其中：存款利息收入	6.4.7.8	23,807.23	1,360.69
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）		-400,726.32	-163,098.59
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-696,338.34	-173,823.97
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	295,612.02	10,725.38
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）	6.4.7.16	550,007.89	83,265.54
4.汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5.其他收入（损失以“-”号填列)	6.4.7.17	282.09	404.86
<b>减：二、营业总支出</b>		270,865.17	28,383.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	239,111.34	11,828.06
2. 托管费	6.4.10.2.2	15,940.70	788.60
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	15,813.13	15,766.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)</b>		-97,494.28	-106,450.55
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列)</b>		-97,494.28	-106,450.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-97,494.28	-106,450.55

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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	21,070,843.08	-	10,741,844.93	31,812,688.01



值)				
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)	21,070,843.08	-	10,741,844.93	31,812,688.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-99,945.10	-	-150,454.83	-250,399.93
(一)、综合收益总额	-	-	-97,494.28	-97,494.28
(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)	-99,945.10	-	-52,960.55	-152,905.65
其中: 1.基金申购款	10,498.66	-	5,607.70	16,106.36
2.基金赎回款	-110,443.76	-	-58,568.25	-169,012.01
(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）	20,970,897.98	-	10,591,390.10	31,562,288.08
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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）	1,133,271.81	-	836,262.00	1,969,533.81
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）	1,133,271.81	-	836,262.00	1,969,533.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-374,317.68	-	-332,587.08	-706,904.76
（一）、综合收益总额	-	-	-106,450.55	-106,450.55
（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）	-374,317.68	-	-226,136.53	-600,454.21
其中：1.基金申购款	119,665.42	-	74,312.51	193,977.93
2.基金赎回款	-493,983.10	-	-300,449.04	-794,432.14
（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)	758,954.13	-	503,674.92	1,262,629.05

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:

金川

沈珂

陈若

-----

-----

-----

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

嘉合锦创优势精选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")《关于准予嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2018]1521号)批准,由嘉合基金管理有限公司(以下简称"嘉合基金公司")依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金基金合同》发售,基金合同于2019年4月16日生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币201,405,428.71元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。本基金的基金管理人为嘉合基金公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。(以下简称"农业银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金基金合同》和《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金招募说明书》(更新)的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投

资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为50%-95%；基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×80%+中债综合全价指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况、2023年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 主要税项说明

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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号文《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号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

2018年1月1日（含）以后，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，以管理人为增值税纳税人，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日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。自2013年1月1日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在2018年1月1日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 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06月30日
活期存款	4,179,715.93
等于：本金	4,178,886.96
加：应计利息	828.97
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	4,179,715.93

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	27,669,745.26	-	27,484,676.14	-185,069.12
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	27,669,745.26	-	27,484,676.14	-185,069.12

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

#### 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**

本基金本报告期末无买入返售金融资产期末余额。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30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	54,120.23
其中：交易所市场	54,120.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	14,876.39
合计	68,996.62

**6.4.7.6 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,070,843.08	21,070,843.08
本期申购	10,498.66	10,498.66
本期赎回（以“-”号填列）	-110,443.76	-110,443.76
本期末	20,970,897.98	20,970,897.98

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**6.4.7.7 未分配利润**

单位：人民币元



项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	18,209,429.45	-7,467,584.52	10,741,844.93
本期利润	-647,502.17	550,007.89	-97,494.28
本期基金份额交易产生的变动数	-86,245.34	33,284.79	-52,960.55
其中：基金申购款	9,064.78	-3,457.08	5,607.70
基金赎回款	-95,310.12	36,741.87	-58,568.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,475,681.94	-6,884,291.84	10,591,390.10

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	22,944.16
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	806.52
其他	56.55
合计	23,807.23

#### 6.4.7.9 股票投资收益

##### 6.4.7.9.1 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	74,486,019.56
减：卖出股票成本总额	74,986,278.40
减：交易费用	196,079.50
买卖股票差价收入	-696,338.34

##### 6.4.7.9.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资证券出借差价收入。

#### 6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期无债券投资收益。

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告无债券投资收益-买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	295,612.02
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	295,612.02

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	550,007.89
——股票投资	550,007.89
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	550,007.89

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	282.09
合计	282.09

注：1、赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费部分按持有期间的增加而递减计入基金财产。

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	936.74
合计	15,813.13

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于2023年8月5日发布的《嘉合基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自2023年8月7日起基金管理费率自1.50%调整至 1.20%，托管费率不变。

#### 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

本基金本报告不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。

##### 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
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东

广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

###### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	239,111.34	11,828.06
其中：支付销售机构的客户维护费	2,801.88	4,148.25

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	15,940.70	788.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。

计算方法如下：

$$H=E \times \text{年费率} / \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金不收取销售服务费。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

#### 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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 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

本基金本报告期末及上年度末均未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

#### 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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	4,179,715.93	22,944.16	180,698.98	1,346.06

注：除上表列示的金额外，本基金通过“中国农业银行托管业务部清算专户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，2023年6月30日的相关余额为人民币0元（2022年06月30日：人民币0元）。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06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

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监



督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

#### **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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，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，其余均能及时变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，以保障基金持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、权证等权益类工具，以及债券等固定收益类工具，其中权益类投资占有较大比例。本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不超过该上市公司可流通股票的15%（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该比例限制), 本基金与由本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, 不超过该上市公司可流通股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

本基金经营活动的现金流量与市场利率变化有一定的相关性, 因此利率风险在一定程度上存在。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控, 并通过对所持投资品种平均剩余到期年限等参数的监控进行利率风险管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位: 人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	4,179,715.93	-	-	-	-	-	4,179,715.93
存出保证金	7,802.40	-	-	-	-	-	7,802.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	27,484,676.14	27,484,676.14
资产总计	4,187,518.33	-	-	-	-	27,484,676.14	31,672,194.47
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	38,352.93	38,352.93
应付托管费	-	-	-	-	-	2,556.84	2,556.84
其他负债	-	-	-	-	-	68,996.62	68,996.62
负债总计	-	-	-	-	-	109,906.39	109,906.39
利率敏	4,187,518.33	-	-	-	-	27,374,769.75	31,562,288.08

感度缺口							
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	6,313,625.61	-	-	-	-	-	6,313,625.61
存出保证金	1,284.10	-	-	-	-	-	1,284.10
交易性金融资产	-	-	-	-	-	25,580,749.13	25,580,749.13
应收申购款	-	-	-	-	-	9.99	9.99
资产总计	6,314,909.71	-	-	-	-	25,580,759.12	31,895,668.83
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	34,736.09	34,736.09
应付托管费	-	-	-	-	-	2,315.74	2,315.74
其他负债	-	-	-	-	-	45,928.99	45,928.99
负债总计	-	-	-	-	-	82,980.82	82,980.82
利率敏感度缺口	6,314,909.71	-	-	-	-	25,497,778.30	31,812,688.01

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

#### 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，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

#### 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06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	27,484,676.14	87.08	25,580,749.13	80.41
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	27,484,676.14	87.08	25,580,749.13	80.41

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)

		本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,469,323.14	1,489,148.32
	业绩比较基准下降5%	-1,469,323.14	-1,489,148.32

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	27,484,676.14	25,506,493.13
第二层次	-	74,256.00
第三层次	-	-
合计	27,484,676.14	25,580,749.13

###### 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。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022年12月31日：无)。

###### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	27,484,676.14	86.78
	其中：股票	27,484,676.14	86.78
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	4,179,715.93	13.20
8	其他各项资产	7,802.40	0.02
9	合计	31,672,194.47	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

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	265,530.80	0.84
B	采矿业	1,241,023.00	3.93

C	制造业	19,485,128.74	61.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	456,990.00	1.45
E	建筑业	733,660.00	2.32
F	批发和零售业	539,128.00	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	607,082.00	1.92
H	住宿和餐饮业	13,360.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	938,120.60	2.97
J	金融业	2,538,907.00	8.04
K	房地产业	105,733.00	0.33
L	租赁和商务服务业	11,053.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	108,340.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	146,688.00	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	293,932.00	0.93
S	综合	-	-
	合计	27,484,676.14	87.08

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	600	1,014,600.00	3.21
2	002459	晶澳科技	23,940	998,298.00	3.16
3	601899	紫金矿业	60,900	692,433.00	2.19
4	300124	汇川技术	8,300	532,943.00	1.69



5	000596	古井贡酒	2,100	519,498.00	1.65
6	000651	格力电器	13,100	478,281.00	1.52
7	601166	兴业银行	29,700	464,805.00	1.47
8	688169	石头科技	1,300	416,884.00	1.32
9	600660	福耀玻璃	11,600	415,860.00	1.32
10	605117	德业股份	2,680	400,794.00	1.27
11	002812	恩捷股份	4,100	395,035.00	1.25
12	600919	江苏银行	53,600	393,960.00	1.25
13	601985	中国核电	55,300	389,865.00	1.24
14	002049	紫光国微	4,100	382,325.00	1.21
15	601006	大秦铁路	50,000	371,500.00	1.18
16	600999	招商证券	27,100	367,747.00	1.17
17	600085	同仁堂	6,300	362,628.00	1.15
18	002142	宁波银行	13,500	341,550.00	1.08
19	002938	鹏鼎控股	14,000	340,060.00	1.08
20	002410	广联达	10,440	339,195.60	1.07
21	002180	纳思达	9,700	332,225.00	1.05
22	601138	工业富联	12,700	320,040.00	1.01
23	002179	中航光电	6,950	315,182.50	1.00
24	601669	中国电建	53,400	306,516.00	0.97
25	603345	安井食品	2,000	293,600.00	0.93
26	000063	中兴通讯	6,400	291,456.00	0.92
27	601688	华泰证券	18,700	257,499.00	0.82
28	002851	麦格米特	6,900	251,643.00	0.80
29	300856	科思股份	3,000	236,310.00	0.75
30	600196	复星医药	7,500	231,750.00	0.73
31	600419	天润乳业	13,000	210,860.00	0.67
32	300750	宁德时代	900	205,911.00	0.65
33	688599	天合光能	4,816	205,209.76	0.65
34	601088	中国神华	6,600	202,950.00	0.64
35	000157	中联重科	29,700	200,475.00	0.64

36	000166	申万宏源	41,500	191,730.00	0.61
37	600026	中远海能	15,100	190,864.00	0.60
38	002444	巨星科技	8,600	188,168.00	0.60
39	002050	三花智控	5,900	178,534.00	0.57
40	603611	诺力股份	6,700	176,478.00	0.56
41	300206	理邦仪器	11,700	176,436.00	0.56
42	002746	仙坛股份	21,800	171,784.00	0.54
43	002038	双鹭药业	16,400	165,476.00	0.52
44	002085	万丰奥威	23,700	164,241.00	0.52
45	600760	中航沈飞	3,640	163,800.00	0.52
46	603197	保隆科技	3,000	162,750.00	0.52
47	000729	燕京啤酒	12,900	160,863.00	0.51
48	600066	宇通客车	10,900	160,666.00	0.51
49	000860	顺鑫农业	4,700	158,343.00	0.50
50	600131	国网信通	7,600	153,444.00	0.49
51	002384	东山精密	5,900	152,810.00	0.48
52	603027	千禾味业	7,200	152,064.00	0.48
53	603997	继峰股份	10,600	151,580.00	0.48
54	688080	映翰通	3,070	150,123.00	0.48
55	002006	精工科技	6,900	148,833.00	0.47
56	000888	峨眉山 A	12,800	146,688.00	0.46
57	603439	贵州三力	8,500	145,010.00	0.46
58	000950	重药控股	20,900	140,657.00	0.45
59	688389	普门科技	5,982	140,517.18	0.45
60	000661	长春高新	1,000	136,300.00	0.43
61	600329	达仁堂	3,000	134,670.00	0.43
62	600985	淮北矿业	11,600	133,632.00	0.42
63	000951	中国重汽	7,800	131,430.00	0.42
64	002594	比亚迪	500	129,135.00	0.41
65	300491	通合科技	4,400	126,280.00	0.40
66	603368	柳药集团	5,000	123,550.00	0.39

67	601900	南方传媒	6,000	123,060.00	0.39
68	603856	东宏股份	9,300	122,667.00	0.39
69	600729	重庆百货	3,900	122,616.00	0.39
70	002614	奥佳华	14,800	120,472.00	0.38
71	603109	神驰机电	6,700	119,595.00	0.38
72	002014	永新股份	13,700	118,916.00	0.38
73	002056	横店东磁	6,500	118,365.00	0.38
74	002724	海洋王	13,600	118,048.00	0.37
75	300976	达瑞电子	2,300	116,610.00	0.37
76	600970	中材国际	9,100	116,025.00	0.37
77	002233	塔牌集团	14,900	115,028.00	0.36
78	600418	江淮汽车	9,100	114,569.00	0.36
79	002895	川恒股份	5,800	114,260.00	0.36
80	002293	罗莱生活	9,900	113,850.00	0.36
81	002563	森马服饰	18,300	113,826.00	0.36
82	000921	海信家电	4,200	113,190.00	0.36
83	600498	烽火通信	5,400	109,998.00	0.35
84	002869	金溢科技	5,000	109,900.00	0.35
85	002714	牧原股份	2,600	109,590.00	0.35
86	300919	中伟股份	1,800	108,450.00	0.34
87	601728	中国电信	19,200	108,096.00	0.34
88	600166	福田汽车	31,700	107,780.00	0.34
89	002737	葵花药业	4,300	104,662.00	0.33
90	600606	绿地控股	35,700	98,175.00	0.31
91	600683	京投发展	15,300	92,718.00	0.29
92	002456	欧菲光	15,700	87,920.00	0.28
93	603768	常青股份	4,900	87,073.00	0.28
94	688569	铁科轨道	2,068	87,000.76	0.28
95	600060	海信视像	3,500	86,625.00	0.27
96	600469	风神股份	13,400	86,296.00	0.27
97	688063	派能科技	429	85,049.25	0.27

98	600612	老凤祥	1,200	83,856.00	0.27
99	002997	瑞鹄模具	2,800	83,244.00	0.26
100	300943	春晖智控	4,900	83,104.00	0.26
101	002223	鱼跃医疗	2,300	82,777.00	0.26
102	000625	长安汽车	6,400	82,752.00	0.26
103	300950	德固特	3,900	82,680.00	0.26
104	688516	奥特维	438	82,519.20	0.26
105	300532	今天国际	4,000	82,240.00	0.26
106	002017	东信和平	6,240	81,806.40	0.26
107	000858	五粮液	500	81,785.00	0.26
108	002011	盾安环境	5,900	81,597.00	0.26
109	300146	汤臣倍健	3,400	81,532.00	0.26
110	002478	常宝股份	10,900	81,205.00	0.26
111	000928	中钢国际	8,400	81,060.00	0.26
112	603129	春风动力	500	80,950.00	0.26
113	601163	三角轮胎	5,100	80,937.00	0.26
114	688626	翔宇医疗	1,773	80,689.23	0.26
115	688348	昱能科技	427	80,203.41	0.25
116	601877	正泰电器	2,900	80,185.00	0.25
117	300972	万辰生物	1,800	79,812.00	0.25
118	000338	潍柴动力	6,400	79,744.00	0.25
119	300389	艾比森	3,900	79,443.00	0.25
120	300855	图南股份	2,210	78,057.20	0.25
121	600517	国网英大	13,600	77,520.00	0.25
122	603156	养元饮品	3,100	76,570.00	0.24
123	300314	戴维医疗	3,600	76,104.00	0.24
124	002518	科士达	1,900	76,019.00	0.24
125	688551	科威尔	1,156	75,810.48	0.24
126	600109	国金证券	8,700	75,429.00	0.24
127	688006	杭可科技	2,475	75,413.25	0.24
128	601108	财通证券	10,300	74,572.00	0.24

129	000783	长江证券	12,800	74,240.00	0.24
130	002422	科伦药业	2,500	74,200.00	0.24
131	688390	固德威	444	74,085.84	0.23
132	002500	山西证券	13,100	73,098.00	0.23
133	601555	东吴证券	10,500	72,870.00	0.23
134	603367	辰欣药业	4,800	72,864.00	0.23
135	603533	掌阅科技	2,600	72,072.00	0.23
136	002603	以岭药业	2,800	71,932.00	0.23
137	600256	广汇能源	10,400	71,344.00	0.23
138	000756	新华制药	3,300	71,214.00	0.23
139	300869	康泰医学	3,100	71,176.00	0.23
140	300444	双杰电气	9,200	70,840.00	0.22
141	688029	南微医学	850	69,326.00	0.22
142	603218	日月股份	3,600	68,364.00	0.22
143	601068	中铝国际	12,700	68,072.00	0.22
144	301257	普蕊斯	1,200	67,440.00	0.21
145	600905	三峡能源	12,500	67,125.00	0.21
146	002773	康弘药业	3,500	66,920.00	0.21
147	600757	长江传媒	7,700	66,220.00	0.21
148	300882	万胜智能	2,300	65,274.00	0.21
149	600785	新华百货	4,800	65,232.00	0.21
150	601928	凤凰传媒	5,000	57,000.00	0.18
151	600153	建发股份	4,400	48,004.00	0.15
152	002739	万达电影	3,800	47,652.00	0.15
153	002048	宁波华翔	3,500	46,900.00	0.15
154	603737	三棵树	700	45,794.00	0.15
155	600028	中国石化	7,200	45,792.00	0.15
156	002237	恒邦股份	4,200	45,738.00	0.14
157	600160	巨化股份	3,300	45,474.00	0.14
158	603056	德邦股份	2,900	44,718.00	0.14
159	300378	鼎捷软件	1,300	44,525.00	0.14

160	601009	南京银行	5,400	43,200.00	0.14
161	300639	凯普生物	4,200	42,084.00	0.13
162	688385	复旦微电	836	41,883.60	0.13
163	603086	先达股份	6,020	41,237.00	0.13
164	600438	通威股份	1,200	41,172.00	0.13
165	603127	昭衍新药	1,000	40,900.00	0.13
166	300121	阳谷华泰	4,200	40,110.00	0.13
167	300761	立华股份	2,160	39,808.80	0.13
168	300122	智飞生物	900	39,780.00	0.13
169	002250	联化科技	3,800	39,748.00	0.13
170	600096	云天化	2,300	39,261.00	0.12
171	600546	山煤国际	2,700	39,069.00	0.12
172	002060	粤水电	5,900	38,822.00	0.12
173	300442	润泽科技	1,260	38,757.60	0.12
174	002597	金禾实业	1,600	37,760.00	0.12
175	600971	恒源煤电	4,800	37,392.00	0.12
176	600941	中国移动	400	37,320.00	0.12
177	603799	华友钴业	800	36,728.00	0.12
178	601225	陕西煤业	2,000	36,380.00	0.12
179	002124	天邦食品	8,000	36,320.00	0.12
180	600797	浙大网新	5,000	35,700.00	0.11
181	002131	利欧股份	15,100	34,730.00	0.11
182	002612	朗姿股份	1,400	33,292.00	0.11
183	688116	天奈科技	712	32,574.00	0.10
184	300661	圣邦股份	390	32,030.70	0.10
185	600488	津药药业	5,500	30,910.00	0.10
186	600268	国电南自	4,100	30,709.00	0.10
187	000957	中通客车	2,800	29,568.00	0.09
188	300145	中金环境	9,500	27,930.00	0.09
189	600114	东睦股份	3,100	23,622.00	0.07
190	600992	贵绳股份	1,200	21,576.00	0.07

191	601898	中煤能源	2,500	21,100.00	0.07
192	600036	招商银行	600	19,656.00	0.06
193	002970	锐明技术	600	18,894.00	0.06
194	688303	大全能源	439	17,757.55	0.06
195	600295	DR鄂尔多斯	1,680	15,069.60	0.05
196	300545	联得装备	500	13,885.00	0.04
197	002835	同为股份	600	13,632.00	0.04
198	300132	青松股份	2,400	13,608.00	0.04
199	605108	同庆楼	400	13,360.00	0.04
200	688556	高测股份	228	12,115.92	0.04
201	002439	启明星辰	400	11,904.00	0.04
202	601888	中国中免	100	11,053.00	0.04
203	002377	国创高新	4,600	11,040.00	0.03
204	601336	新华保险	300	11,031.00	0.03
205	002273	水晶光电	900	10,746.00	0.03
206	603045	福达合金	700	10,598.00	0.03
207	300910	瑞丰新材	190	9,557.00	0.03
208	603828	柯利达	3,000	8,940.00	0.03
209	600486	扬农化工	100	8,742.00	0.03
210	300097	智云股份	1,300	8,697.00	0.03
211	300697	电工合金	700	8,386.00	0.03
212	002775	文科园林	2,200	8,250.00	0.03
213	002620	瑞和股份	1,500	7,800.00	0.02
214	300756	金马游乐	400	7,648.00	0.02
215	603392	万泰生物	63	4,206.51	0.01
216	600748	上实发展	500	1,975.00	0.01
217	002881	美格智能	40	1,366.00	0.00
218	300709	精研科技	40	986.80	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	601899	紫金矿业	1,369,438.00	4.30
2	600104	上汽集团	1,169,839.00	3.68
3	601166	兴业银行	1,156,884.00	3.64
4	002709	天赐材料	1,106,133.00	3.48
5	603659	璞泰来	1,096,663.00	3.45
6	601006	大秦铁路	1,060,795.00	3.33
7	002415	海康威视	1,015,780.00	3.19
8	002459	晶澳科技	995,110.00	3.13
9	600919	江苏银行	920,346.00	2.89
10	002001	新和成	888,543.00	2.79
11	002736	国信证券	883,270.00	2.78
12	002410	广联达	881,297.00	2.77
13	002180	纳思达	859,064.00	2.70
14	601211	国泰君安	841,230.00	2.64
15	002812	恩捷股份	817,665.00	2.57
16	002049	紫光国微	769,033.00	2.42
17	600999	招商证券	767,979.00	2.41
18	601688	华泰证券	727,613.00	2.29
19	600115	中国东航	724,413.00	2.28
20	002938	鹏鼎控股	681,364.00	2.14
21	688599	天合光能	669,822.07	2.11
22	600795	国电电力	650,236.00	2.04
23	002129	TCL中环	649,609.00	2.04

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	600104	上汽集团	1,405,958.00	4.42
2	603659	璞泰来	1,349,428.80	4.24
3	002709	天赐材料	1,233,994.00	3.88
4	601211	国泰君安	1,129,153.00	3.55
5	603259	药明康德	1,042,212.00	3.28
6	601006	大秦铁路	1,016,059.00	3.19
7	002736	国信证券	966,718.00	3.04
8	002410	广联达	927,299.00	2.91
9	601899	紫金矿业	920,941.00	2.89
10	002129	TCL中环	899,137.00	2.83
11	600436	片仔癀	881,976.00	2.77
12	002049	紫光国微	878,961.00	2.76
13	600276	恒瑞医药	866,436.00	2.72
14	002415	海康威视	857,711.00	2.70
15	601012	隆基绿能	839,272.32	2.64
16	601318	中国平安	817,470.00	2.57
17	601398	工商银行	785,475.00	2.47
18	000568	泸州老窖	779,364.00	2.45
19	600438	通威股份	776,656.31	2.44
20	601390	中国中铁	771,184.00	2.42
21	002304	洋河股份	768,145.00	2.41
22	002812	恩捷股份	767,657.00	2.41
23	600115	中国东航	766,513.00	2.41
24	002001	新和成	753,378.00	2.37
25	600837	海通证券	753,283.00	2.37
26	600048	保利发展	739,795.00	2.33
27	600795	国电电力	738,512.00	2.32
28	600089	特变电工	720,375.00	2.26

29	002600	领益智造	714,738.00	2.25
30	600905	三峡能源	712,636.00	2.24
31	000425	徐工机械	706,737.00	2.22
32	300498	温氏股份	704,008.00	2.21
33	600809	山西汾酒	702,836.00	2.21
34	600886	国投电力	680,849.00	2.14
35	600016	民生银行	680,238.00	2.14
36	000938	紫光股份	677,162.00	2.13
37	600919	江苏银行	675,165.00	2.12
38	688599	天合光能	674,433.48	2.12
39	601138	工业富联	665,628.46	2.09
40	000651	格力电器	640,990.00	2.01
41	600406	国电南瑞	640,339.56	2.01
42	601601	中国太保	639,327.00	2.01

注：1、卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计卖出金额"按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	76,340,197.52
卖出股票收入（成交）总额	74,486,019.56

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票，卖出包括基金二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、"买入股票成本（成交）总额"、"卖出股票收入（成交）总额"均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

#### 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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会（现国家金融监督管理总局）或其派出机构的处罚。

注：本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

##### 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	7,802.40

2	应收清算款	-
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	7,802.40

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §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
399	52,558.64	20,302,410.96	96.81%	668,487.02	3.19%

### 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	86,972.37	0.41%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研  
究部门负责人持有本  
基金份额总量在0~10万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理持有本基金份额总量在0~10万份(含)之间。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年04月16日)基金份额总额	201,405,428.71
本报告期期初基金份额总额	21,070,843.08
本报告期基金总申购份额	10,498.66
减：本报告期基金总赎回份额	110,443.76
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,970,897.98

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本报告期内本基金管理人发生以下重大人事变动：

自2023年3月6日起，金川先生代任公司董事长职务，周健男先生不再担任公司董  
事长职务。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动情况。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	74,467,211.58	49.37%	54,120.23	49.33%	-
兴业证券	2	76,359,005.50	50.63%	55,599.33	50.67%	-

注：1、本基金本报告期内新增川财证券交易单元2个,新增财通证券交易单元2个,退租国盛证券交易单元1个。

2、本基金的基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易席位供旗下基金买卖证券专用，本着安全、高效、低成本，能够为基金提供高质量增值研究服务的原则，对证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

### 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	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2022年第四季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2023-01-20
2	嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金2022年第四季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-01-20
3	嘉合基金管理有限公司关于高级管理人员（董事长）变更的公告	《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-07
4	嘉合基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2023-03-31
5	嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金2022年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
6	嘉合基金管理有限公司旗下基金2023年第一季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2023-04-24
7	嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金2023年第一季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24

## §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	20230101 - 20230630	4,690,724.51	0.00	0.00	4,690,724.51	22.37%
	2	20230101 - 20230630	5,142,619.21	0.00	0.00	5,142,619.21	24.52%
	3	20230101 - 20230630	4,220,678.01	0.00	0.00	4,220,678.01	20.13%
	4	20230101 - 20230630	6,248,330.14	0.00	0.00	6,248,330.14	29.80%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极							

端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金募集注册的文件
- 二、《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（[www.haoamc.com](http://www.haoamc.com)）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日