

嘉实科技创新混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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，并由代董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 28 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 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46

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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
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	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	55
§ 11 备查文件目录	55
11.1 备查文件目录	55
11.2 存放地点	55
11.3 查阅方式	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实科技创新混合型证券投资基金
基金简称	嘉实科技创新混合
基金主代码	007343
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年5月7日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	647,190,626.06份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过精选个股和严格的风险控制，追求基金长期资产增值。
投资策略	<p>本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素四方面指标，在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略。本基金主要投资于科技创新企业，科技创新企业是指符合国家战略、突破关键核心技术、市场认可度高的科技创新企业；属于新一代信息技术、高端装备、新材料、新能源、节能环保以及生物医药等高新技术产业和战略性新兴产业的科技创新企业；互联网、大数据、云计算、人工智能和制造业深度融合的科技创新企业。本基金首先根据科技创新企业范畴选出备选股票池，并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。</p> <p>具体策略包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。</p>
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×65% + 恒生指数收益率×15% + 中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	400-61-95555
传真	(010)65215588	0755-83195201
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号 北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100020	518040
法定代表人	经雷	缪建民

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-147,364,851.57
本期利润	-70,067,960.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1077
本期加权平均净值利润率	-6.15%
本期基金份额净值增长率	-5.67%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	444,285,352.67
期末可供分配基金份额利润	0.6865
期末基金资产净值	1,141,017,243.92
期末基金份额净值	1.7630
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	76.30%

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	-1.06%	1.03%	-2.78%	0.63%	1.72%	0.40%
过去三个月	1.23%	1.42%	-2.74%	0.84%	3.97%	0.58%
过去六个月	-5.67%	1.76%	-4.84%	1.07%	-0.83%	0.69%
过去一年	-9.50%	1.65%	-18.00%	0.98%	8.50%	0.67%
过去三年	-30.77%	1.63%	-45.22%	1.08%	14.45%	0.55%
自基金合同生效起至今	76.30%	1.67%	-3.73%	1.14%	80.03%	0.53%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

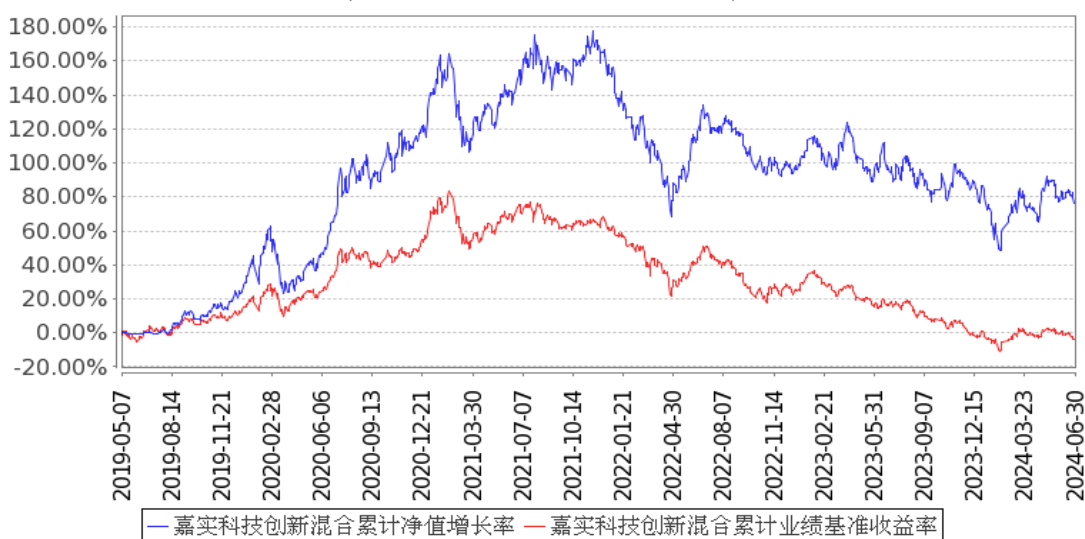
$$\text{Return}(t) = 65\% * (\text{中国战略新兴产业成份指数}(t) / \text{中国战略新兴产业成份指数}(t-1) - 1) + 15\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$$

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

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

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

嘉实科技创新混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势图
(2019年05月07日至2024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2024年6月30日，基金管理人共管理351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		
王贵重	本基金、嘉实文体娱乐股票、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实前沿创新混合、嘉实创新先锋混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实港股互联网产业核心资产混合基金经理	2019年5月7日	-	9年	曾任上海重阳投资管理股份有限公司 TMT 行业研究员。2015年7月加入嘉实基金管理有限公司，历任 TMT 行业研究员、科技组组长，现任大科技研究总监。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

(2) 证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 9 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

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

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

2024 年上半年，市场先是由于流动性的问题，出现了快速下跌，然后二月份开始以 AI 算力为主产生了反弹，5 月份之后又开始随着消费数据的走弱从而进入调整。市场表现上呈现极大的分化，这与我们年初的预期有较大的偏差，一方面由于债券收益率的持续走低，红利类资产大幅上涨，科技制造类资产中与北美算力相关的表现一直独秀，其他无论是半导体、新能源、创新药都出现了较大幅度的下跌。我们在二季度抓住了一些互联网龙头公司、教育的机会，但确实错过

了 AI 算力相关的光模块、PCB 机会，业绩表现一般。

我们始终是中国经济的乐观派，核心逻辑在于中国在制造业上的优势并未消失，中国不仅维持了传统劳动密集型行业的优势，在半导体、智能电动车领域也有显著的突破。我们依然对中国高质量增长的转型充满信心，虽然地产的调整幅度以及对经济的负向拉动超过我们的预期。

行业上，我们在目前位置更加看好中国硬科技中的龙头公司，无论是新能源车、半导体以及一些细分高端制造。另外，CXO 这个板块也酝酿着大机会，由于美国法案的压制，估值和业绩都处于历史底部，而我们认为中国 CXO 的全球优势，不会因为政策的变化消失。

我们对港股的长期乐观看法也没有改变，我们所管理的可投资港股的组合也都进行了超配。海外流动性放松的趋势已经比较确定，但是因为对国内经济的悲观以及地缘政治的扰动，外资持续流出。不过经历去年疫情政策调整后的反弹以及期间明显的外资回流，我们也认识到目前的核心矛盾并不是地缘政治而是宏观预期。互联网及其他港股科技行业经过 2023 年的超预期估值下杀，在宏观预期的反转之下会有更大的估值弹性。

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 1.7630 元；本报告期基金份额净值增长率为-5.67%，业绩比较基准收益率为-4.84%。

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，我们认为地产对中国宏观经济拖累最差的时间已经过去。随着宏观经济的逐步企稳，企业的盈利有望恢复，上半年极致悲观的宏观假设会出现变化，而在这个背景下，优质的成长股龙头会更占优。结构上，我们更加均衡，增加半导体、新能源车、CXO 等中国高端制造业龙头公司的配置。我们相信，中国参与更深的“再全球化”会为中国企业带来新的增长空间，而这些具备全球竞争力的公司很多只有 10X 倍静态 PE，明显低估，酝酿着巨大的潜在回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实科技创新混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,082,753.18	6,660,412.40
结算备付金		543,977.30	266.55
存出保证金		81,660.75	41,775.91
交易性金融资产	6.4.7.2	1,136,816,338.12	1,224,325,601.41
其中：股票投资		1,076,502,359.27	1,163,697,532.59

基金投资		-	-
债券投资		60,313,978.85	60,628,068.82
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		-	-
应收股利		72.80	-
应收申购款		246,828.89	216,854.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,143,771,631.04	1,231,244,910.39
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		120.60	3,031.78
应付赎回款		693,792.78	1,598,091.90
应付管理人报酬		1,152,071.93	1,238,165.00
应付托管费		192,011.98	206,360.82
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	716,389.83	412,072.38
负债合计		2,754,387.12	3,457,721.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	647,190,626.06	656,917,260.32
未分配利润	6.4.7.12	493,826,617.86	570,869,928.19
净资产合计		1,141,017,243.92	1,227,787,188.51
负债和净资产总计		1,143,771,631.04	1,231,244,910.39

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.7630 元，基金份额总额 647,190,626.06

份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实科技创新混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-62,013,023.35	26,157,353.81
1. 利息收入		46,372.38	255,533.33
其中：存款利息收入	6.4.7.13	46,372.38	255,533.33
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-139,431,826.15	67,963,472.05
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-148,863,019.00	63,362,856.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	435,075.68	38,801.25
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	8,996,117.17	4,561,814.69
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	77,296,890.81	-42,479,808.13
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	75,539.61	418,156.56
减：二、营业总支出		8,054,937.41	12,415,562.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,783,613.17	10,512,559.59
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,130,602.11	1,752,093.25
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产		-	-

支出			
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	140, 722. 13	150, 909. 61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-70, 067, 960. 76	13, 741, 791. 36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-70, 067, 960. 76	13, 741, 791. 36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-70, 067, 960. 76	13, 741, 791. 36

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实科技创新混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	656, 917, 260. 32	-	570, 869, 928. 19	1, 227, 787, 188. 51
二、本期期初净资产	656, 917, 260. 32	-	570, 869, 928. 19	1, 227, 787, 188. 51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9, 726, 634. 26	-	-77, 043, 310. 33	-86, 769, 944. 59
（一）、综合收益总额	-	-	-70, 067, 960. 76	-70, 067, 960. 76
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-9, 726, 634. 26	-	-6, 975, 349. 57	-16, 701, 983. 83
其中：1. 基金申购款	42, 561, 786. 09	-	31, 183, 387. 08	73, 745, 173. 17
2. 基金赎回款	-52, 288, 420. 35	-	-38, 158, 736. 65	-90, 447, 157. 00
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
四、本期期末净资产	647,190,626.06	-	493,826,617.86	1,141,017,243.92
项目	上年度可比期间 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	769,495,093.38	-	737,181,445.53	1,506,676,538.91
二、本期期初净资产	769,495,093.38	-	737,181,445.53	1,506,676,538.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-100,676,934.87	-	-103,103,185.46	-203,780,120.33
(一)、综合收益总额	-	-	13,741,791.36	13,741,791.36
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-100,676,934.87	-	-116,844,976.82	-217,521,911.69
其中：1. 基金申购款	117,540,945.82	-	122,462,236.86	240,003,182.68
2. 基金赎回款	-218,217,880.69	-	-239,307,213.68	-457,525,094.37
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	668,818,158.51	-	634,078,260.07	1,302,896,418.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实科技创新混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]640号《关于准予嘉实科技创新混合型证券投资基金注册的批复》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《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》于2019年5月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为988,672,545.69份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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》、《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

所得税。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,082,753.18
等于：本金	6,081,272.08
加：应计利息	1,481.10
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	6,082,753.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,085,031,302.24	-	1,076,502,359.27	-8,528,942.97

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	59,489,698.00	751,308.85	60,313,978.85	72,972.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	59,489,698.00	751,308.85	60,313,978.85	72,972.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,144,521,000.24	751,308.85	1,136,816,338.12	-8,455,970.97

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	75.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	611,888.23
其中：交易所市场	611,888.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,426.14
合计	716,389.83

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	656,917,260.32	656,917,260.32
本期申购	42,561,786.09	42,561,786.09
本期赎回（以“-”号填列）	-52,288,420.35	-52,288,420.35
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	647,190,626.06	647,190,626.06

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	599,943,594.86	-29,073,666.67	570,869,928.19
本期期初	599,943,594.86	-29,073,666.67	570,869,928.19
本期利润	-147,364,851.57	77,296,890.81	-70,067,960.76
本期基金份额交易产生的变动数	-8,293,390.62	1,318,041.05	-6,975,349.57
其中：基金申购款	34,147,210.62	-2,963,823.54	31,183,387.08
基金赎回款	-42,440,601.24	4,281,864.59	-38,158,736.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	444,285,352.67	49,541,265.19	493,826,617.86

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	25,026.11
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	20,681.38
其他	664.89
合计	46,372.38

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-148,863,019.00
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	-148,863,019.00

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	719,124,873.48
减：卖出股票成本总额	866,023,906.16
减：交易费用	1,963,986.32

买卖股票差价收入	-148,863,019.00
----------	-----------------

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	459,635.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-24,560.00
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	435,075.68

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,505,620.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	25,024,560.00
减：应计利息总额	505,620.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-24,560.00

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,996,117.17
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	8,996,117.17

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	77,296,890.81
股票投资	77,213,905.81
债券投资	82,985.00
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	77,296,890.81

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	59,863.69
基金转出费收入	15,675.92
合计	75,539.61

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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	7,184.82
债券托管账户维护费	9,000.00
深港通证券组合费	19,823.52
存托服务费	287.65
合计	140,722.13

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人

招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人
--------------------	-------

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,783,613.17	10,512,559.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,083,584.05	3,460,736.99
应支付基金管理人的净管理费	4,700,029.12	7,051,822.60

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 1.20%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×1.20%/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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,130,602.11	1,752,093.25

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	4,412,426.64
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	4,412,426.64
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

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

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

招商银行股份有限公司_活期	6,082,753.18	25,026.11	60,509,201.01	186,770.99
---------------	--------------	-----------	---------------	------------

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（2024年1月1日至2024年6月30日），本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过精选个股和严格的风险控制，追求基金长期资产增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	60,313,978.85	60,628,068.82
合计	60,313,978.85	60,628,068.82

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

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,082,753.18	-	-	-	6,082,753.18
结算备付金	543,977.30	-	-	-	543,977.30
存出保证金	81,660.75	-	-	-	81,660.75
交易性金融资产	60,313,978.85	-	-	1,076,502,359.27	1,136,816,338.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	72.80	72.80
应收申购款	-	-	-	246,828.89	246,828.89
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	67,022,370.08	-	-	1,076,749,260.96	1,143,771,631.04
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	-	-	-	120.60	120.60
应付赎回款	-	-	-	693,792.78	693,792.78

应付管理人报酬	-	-	-	1,152,071.93	1,152,071.93
应付托管费	-	-	-	192,011.98	192,011.98
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	-	-	-	716,389.83	716,389.83
负债总计	-	-	-	2,754,387.12	2,754,387.12
利率敏感度缺口	67,022,370.08	-	-	1,073,994,873.84	1,141,017,243.92
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,660,412.40	-	-	-	6,660,412.40
结算备付金	266.55	-	-	-	266.55
存出保证金	41,775.91	-	-	-	41,775.91
交易性金融资产	60,628,068.82	-	-	1,163,697,532.59	1,224,325,601.41
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	216,854.12	216,854.12
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	67,330,523.68	-	-	1,163,914,386.71	1,231,244,910.39
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	-	-	-	3,031.78	3,031.78
应付赎回款	-	-	-	1,598,091.90	1,598,091.90
应付管理人报酬	-	-	-	1,238,165.00	1,238,165.00
应付托管费	-	-	-	206,360.82	206,360.82
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	-	-	-	412,072.38	412,072.38

负债总计	-	-	-	3,457,721.88	3,457,721.88
利率敏感度缺口	67,330,523.68	-	-	1,160,456,664.83	1,227,787,188.51

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		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率上升25个基点	-41,930.93	-57,826.47
市场利率下降25个基点	42,035.86	57,976.61	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	523,820,717.11	-	523,820,717.11
衍生金融资产	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	523,820,717.11	-	523,820,717.11
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务 费	-	-	-	-
应付投资顾问 费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	523,820,717.11	-	523,820,717.11
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资 产	-	523,828,605.87	-	523,828,605.87
衍生金融资产	-	-	-	-

债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	523,828,605.87	-	523,828,605.87
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	523,828,605.87	-	523,828,605.87

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		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	所有外币相对人民币升值5%	26,191,035.86	26,191,430.29
	所有外币相对人民币贬值5%	-26,191,035.86	-26,191,430.29

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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,076,502,359.27	94.35	1,163,697,532.59	94.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,076,502,359.27	94.35	1,163,697,532.59	94.78

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		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	79,608,657.70	78,193,848.45
业绩比较基准下降5%	-79,608,657.70	-78,193,848.45	

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,076,502,359.27	1,161,252,348.42
第二层次	60,313,978.85	60,628,068.82
第三层次	-	2,445,184.17
合计	1,136,816,338.12	1,224,325,601.41

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,076,502,359.27	94.12
	其中：股票	1,076,502,359.27	94.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,313,978.85	5.27
	其中：债券	60,313,978.85	5.27
	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	6,626,730.48	0.58
8	其他各项资产	328,562.44	0.03
9	合计	1,143,771,631.04	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 523,820,717.11 元，占基金资产净值的比例为 45.91%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	312,765,236.81	27.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	456,084.77	0.04
E	建筑业	70,896.08	0.01
F	批发和零售业	1,466,311.66	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,744,421.46	8.30
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	59,248,553.11	5.19
N	水利、环境和公共设施管理业	253,938.37	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	83,181,560.00	7.29
Q	卫生和社会工作	176,595.90	0.02
R	文化、体育和娱乐业	318,044.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	552,681,642.16	48.44

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	111,429,162.34	9.77
非必需消费品	161,604,985.68	14.16
必需消费品	143,975.27	0.01
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	248,680,972.53	21.79
工业	1,049,034.39	0.09
信息技术	912,586.90	0.08
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	523,820,717.11	45.91

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	3690 HK	美团-W	1,060,620	107,545,540.10	9.43
2	700 HK	腾讯控股	296,900	100,910,975.30	8.84
3	300750	宁德时代	545,815	98,263,074.45	8.61
4	002415	海康威视	3,061,838	94,641,412.58	8.29
5	1801 HK	信达生物	2,722,000	91,422,790.53	8.01
6	000526	学大教育	1,350,350	83,181,560.00	7.29
7	603259	药明康德	1,493,564	58,532,773.16	5.13
8	2015 HK	理想汽车-W	841,900	54,017,486.03	4.73
9	9926 HK	康方生物	1,487,000	51,232,607.29	4.49
10	688052	纳芯微	474,066	48,724,503.48	4.27
11	1548 HK	金斯瑞生物科技	4,406,000	33,456,950.43	2.93
12	688368	晶丰明源	594,594	32,940,507.60	2.89
13	2269 HK	药明生物	2,897,000	30,512,151.90	2.67
14	2162 HK	康诺亚-B	892,500	27,491,632.88	2.41

15	002475	立讯精密	587,390	23,090,300.90	2.02
16	000333	美的集团	276,400	17,827,800.00	1.56
17	600563	法拉电子	222,600	16,957,668.00	1.49
18	300866	安克创新	227,290	16,185,320.90	1.42
19	3347 HK	泰格医药	578,200	14,564,839.50	1.28
20	300223	北京君正	178,600	9,901,584.00	0.87
21	6100 HK	同道猎聘	4,359,200	8,752,820.24	0.77
22	688083	中望软件	117,785	8,553,546.70	0.75
23	300661	圣邦股份	100,507	8,319,969.46	0.73
24	688036	传音控股	81,869	6,266,253.26	0.55
25	2057 HK	中通快递-W	7,000	1,049,034.39	0.09
26	301051	信濠光电	35,280	925,394.40	0.08
27	268 HK	金蝶国际	119,000	795,017.29	0.07
28	688279	峰昭科技	5,505	610,504.50	0.05
29	688472	阿特斯	56,203	572,146.54	0.05
30	9626 HK	哔哩哔哩-W	4,940	572,146.31	0.05
31	688188	柏楚电子	3,039	560,847.45	0.05
32	688387	信科移动	106,186	535,177.44	0.05
33	1024 HK	快手-W	12,100	509,654.20	0.04
34	3888 HK	金山软件	24,200	498,058.60	0.04
35	688563	航材股份	9,267	490,038.96	0.04
36	001286	陕西能源	37,667	434,300.51	0.04
37	688375	国博电子	6,110	431,610.40	0.04
38	301099	雅创电子	8,867	395,911.55	0.03
39	688084	晶品特装	8,508	371,799.60	0.03
40	688548	广钢气体	40,476	369,545.88	0.03
41	300769	德方纳米	11,500	324,300.00	0.03
42	300251	光线传媒	37,200	312,852.00	0.03
43	300496	中科创达	6,785	309,328.15	0.03
44	301498	乖宝宠物	5,531	297,567.80	0.03
45	688525	佰维存储	4,614	295,988.10	0.03
46	688549	中巨芯	42,933	289,797.75	0.03
47	600276	恒瑞医药	7,492	288,142.32	0.03
48	688522	纳睿雷达	6,019	282,170.72	0.02
49	601061	中信金属	40,154	275,857.98	0.02
50	688352	颀中科技	23,609	269,378.69	0.02
51	688639	华恒生物	3,338	254,989.82	0.02
52	688114	华大智造	5,336	252,979.76	0.02
53	688351	微电生理	10,946	241,249.84	0.02
54	001287	中电港	13,860	229,105.80	0.02
55	301286	侨源股份	7,839	224,273.79	0.02
56	688702	盛科通信	5,488	222,264.00	0.02
57	301187	欧圣电气	8,759	212,405.75	0.02

58	688631	莱斯信息	3,357	208,201.14	0.02
59	301162	国能日新	4,663	203,120.28	0.02
60	301330	熵基科技	9,018	202,724.64	0.02
61	688543	国科军工	4,913	201,776.91	0.02
62	688539	高华科技	7,468	200,963.88	0.02
63	301389	隆扬电子	12,690	200,502.00	0.02
64	688432	有研硅	20,044	194,226.36	0.02
65	688772	珠海冠宇	12,960	193,104.00	0.02
66	301559	中集环科	13,144	191,508.08	0.02
67	688306	均普智能	47,094	191,201.64	0.02
68	688629	华丰科技	7,073	186,444.28	0.02
69	301348	蓝箭电子	6,124	186,108.36	0.02
70	2400 HK	心动公司	10,800	185,507.69	0.02
71	688582	芯动联科	6,476	182,364.16	0.02
72	301339	通行宝	9,127	181,536.03	0.02
73	688570	天玛智控	8,837	180,186.43	0.02
74	301383	天键股份	6,895	180,097.40	0.02
75	301327	华宝新能	3,142	180,036.60	0.02
76	301371	敷尔佳	5,637	175,085.22	0.02
77	301303	真兰仪表	14,804	170,542.08	0.01
78	688392	骄成超声	3,843	163,096.92	0.01
79	688141	杰华特	9,946	160,727.36	0.01
80	301120	新特电气	15,466	160,691.74	0.01
81	688486	龙迅股份	2,793	160,038.90	0.01
82	688507	索辰科技	3,231	157,026.60	0.01
83	301262	海看股份	6,917	155,978.35	0.01
84	301368	丰立智能	3,368	155,197.44	0.01
85	688552	航天南湖	9,556	154,807.20	0.01
86	688151	华强科技	12,238	152,363.10	0.01
87	301391	卡莱特	3,458	151,391.24	0.01
88	301525	儒竞科技	2,660	149,704.80	0.01
89	603906	龙蟠科技	19,200	149,568.00	0.01
90	688037	芯源微	1,665	148,185.00	0.01
91	301195	北路智控	4,950	147,213.00	0.01
92	301171	易点天下	9,845	144,721.50	0.01
93	1797 HK	东方甄选	12,500	143,975.27	0.01
94	688381	帝奥微	7,362	143,411.76	0.01
95	301421	波长光电	3,315	143,307.45	0.01
96	688334	西高院	8,879	142,951.90	0.01
97	301356	天振股份	11,038	142,831.72	0.01
98	301362	民爆光电	4,191	142,745.46	0.01
99	688212	澳华内镜	3,496	139,874.96	0.01
100	301468	博盈特焊	5,979	138,294.27	0.01

101	301310	鑫宏业	5,725	137,972.50	0.01
102	688576	西山科技	2,395	137,377.20	0.01
103	301509	金凯生科	3,720	135,333.60	0.01
104	301377	鼎泰高科	7,695	135,047.25	0.01
105	301370	国科恒泰	12,395	134,733.65	0.01
106	301150	中一科技	7,328	131,684.16	0.01
107	301381	赛维时代	5,710	129,788.30	0.01
108	301363	美好医疗	4,447	128,963.00	0.01
109	301172	君逸数码	4,376	128,566.88	0.01
110	300834	星辉环材	6,349	126,980.00	0.01
111	301246	宏源药业	9,303	125,218.38	0.01
112	301550	斯菱股份	2,600	124,566.00	0.01
113	301101	明月镜片	5,554	124,076.36	0.01
114	688105	诺唯赞	6,180	123,661.80	0.01
115	688046	药康生物	12,070	123,355.40	0.01
116	301558	三态股份	14,578	122,309.42	0.01
117	300904	威力传动	3,037	121,388.89	0.01
118	301302	华如科技	6,976	120,336.00	0.01
119	301439	泓淋电力	9,486	120,187.62	0.01
120	301223	中荣股份	8,148	119,857.08	0.01
121	301141	中科磁业	3,664	118,164.00	0.01
122	688290	景业智能	3,648	117,100.80	0.01
123	688612	威迈斯	4,218	112,072.26	0.01
124	688581	安杰思	2,281	111,609.33	0.01
125	688562	航天软件	7,254	110,768.58	0.01
126	301251	威尔高	3,207	110,417.01	0.01
127	301393	昊帆生物	2,597	110,294.59	0.01
128	688535	华海诚科	1,607	110,111.64	0.01
129	301510	固高科技	3,957	109,806.75	0.01
130	301103	何氏眼科	5,065	108,694.90	0.01
131	301317	鑫磊股份	6,936	107,785.44	0.01
132	301507	民生健康	8,509	107,383.58	0.01
133	301121	紫建电子	2,896	106,949.28	0.01
134	301456	盘古智能	4,061	105,951.49	0.01
135	301328	维峰电子	2,865	105,747.15	0.01
136	301152	天力锂能	4,326	104,213.34	0.01
137	301548	崇德科技	1,959	103,983.72	0.01
138	688627	精智达	2,212	102,681.04	0.01
139	688249	晶合集成	6,997	102,645.99	0.01
140	300973	立高食品	3,593	100,927.37	0.01
141	688623	双元科技	1,776	99,864.48	0.01
142	301268	铭利达	6,407	99,628.85	0.01
143	301517	陕西华达	1,841	99,414.00	0.01

144	301332	德尔玛	11,211	99,105.24	0.01
145	301320	豪江智能	6,416	96,368.32	0.01
146	301382	蜂助手	5,304	95,949.36	0.01
147	688593	新相微	9,584	95,840.00	0.01
148	301115	建科股份	6,850	95,078.00	0.01
149	301225	恒勃股份	3,324	94,401.60	0.01
150	688610	埃科光电	2,747	92,381.61	0.01
151	301168	通灵股份	3,281	91,146.18	0.01
152	301489	思泉新材	1,278	90,201.24	0.01
153	301269	华大九天	1,168	89,994.40	0.01
154	301408	华人健康	8,784	89,860.32	0.01
155	301376	致欧科技	4,192	88,744.64	0.01
156	301329	信音电子	4,577	88,473.41	0.01
157	688433	华曙高科	4,171	87,007.06	0.01
158	301357	北方长龙	2,660	85,864.80	0.01
159	688391	钜泉科技	2,938	85,701.46	0.01
160	301499	维科精密	3,709	84,305.57	0.01
161	688458	美芯晟	3,088	82,758.40	0.01
162	688620	安凯微	10,157	82,677.98	0.01
163	301202	朗威股份	3,060	81,885.60	0.01
164	301419	阿莱德	3,292	81,740.36	0.01
165	688602	康鹏科技	10,653	81,708.51	0.01
166	688523	航天环宇	4,717	81,368.25	0.01
167	301500	飞南资源	4,550	79,397.50	0.01
168	688489	三未信安	2,953	78,667.92	0.01
169	301386	未来电器	3,776	78,314.24	0.01
170	301395	仁信新材	7,274	77,686.32	0.01
171	301308	江波龙	819	77,592.06	0.01
172	688238	和元生物	16,687	77,260.81	0.01
173	601065	江盐集团	8,748	75,845.16	0.01
174	301296	新巨丰	10,411	75,063.31	0.01
175	301349	信德新材	2,697	74,545.08	0.01
176	301315	威士顿	2,253	73,425.27	0.01
177	301261	恒工精密	1,973	73,139.11	0.01
178	301519	舜禹股份	4,414	73,095.84	0.01
179	688603	天承科技	1,391	72,624.11	0.01
180	301323	新莱福	2,277	71,907.66	0.01
181	601133	柏诚股份	6,632	70,896.08	0.01
182	688719	爱科赛博	2,715	70,780.05	0.01
183	981 HK	中芯国际	4,500	70,312.87	0.01
184	688646	逸飞激光	2,190	68,349.90	0.01
185	301138	华研精机	2,849	68,062.61	0.01
186	301469	恒达新材	2,743	66,956.63	0.01

187	688665	四方光电	2,412	66,908.88	0.01
188	301518	长华化学	3,850	66,720.50	0.01
189	301272	英华特	1,729	66,704.82	0.01
190	301520	万邦医药	1,596	66,042.48	0.01
191	301428	世纪恒通	2,289	65,694.30	0.01
192	301170	锡南科技	2,496	65,020.80	0.01
193	301265	华新环保	8,181	64,711.71	0.01
194	301337	亚华电子	2,318	63,930.44	0.01
195	688693	锆威特	1,773	63,686.16	0.01
196	301358	湖南裕能	2,023	63,643.58	0.01
197	301203	国泰环保	2,243	63,499.33	0.01
198	301528	多浦乐	1,478	63,317.52	0.01
199	301373	凌玮科技	2,764	63,019.20	0.01
200	688225	亚信安全	5,534	62,700.22	0.01
201	301372	科净源	2,306	61,454.90	0.01
202	603039	泛微网络	1,932	61,360.32	0.01
203	688512	慧智微	7,209	61,204.41	0.01
204	688638	誉辰智能	1,961	61,202.81	0.01
205	688573	信宇人	2,844	60,804.72	0.01
206	301295	美硕科技	3,004	59,809.64	0.01
207	301529	福赛科技	1,816	59,582.96	0.01
208	688429	时创能源	3,452	58,476.88	0.01
209	301505	苏州规划	1,934	58,020.00	0.01
210	301360	荣旗科技	1,340	57,955.00	0.01
211	603275	众辰科技	1,929	57,870.00	0.01
212	301533	威马农机	2,243	57,622.67	0.01
213	688716	中研股份	2,668	56,561.60	0.00
214	603193	润本股份	3,022	55,574.58	0.00
215	688283	坤恒顺维	1,595	54,836.10	0.00
216	688469	芯联集成	13,800	54,648.00	0.00
217	688657	浩辰软件	1,472	54,405.12	0.00
218	688143	长盈通	2,519	53,956.98	0.00
219	301355	南王科技	5,624	53,934.16	0.00
220	688479	友车科技	3,318	52,723.02	0.00
221	688651	盛邦安全	1,778	52,006.50	0.00
222	603119	浙江荣泰	2,929	51,901.88	0.00
223	688307	中润光学	2,455	50,793.95	0.00
224	688420	美腾科技	2,408	49,797.44	0.00
225	300804	广康生化	2,257	49,202.60	0.00
226	301157	华塑科技	1,498	48,834.80	0.00
227	001380	华纬科技	2,406	46,772.64	0.00
228	688671	碧兴物联	2,253	46,704.69	0.00
229	301301	川宁生物	3,574	45,675.72	0.00

230	301515	港通医疗	2,294	43,907.16	0.00
231	000938	紫光股份	1,957	43,738.95	0.00
232	1765 HK	希教国际控股	254,000	41,959.55	0.00
233	688450	光格科技	1,662	40,453.08	0.00
234	301260	格力博	2,941	40,056.42	0.00
235	603125	常青科技	2,314	39,823.94	0.00
236	1810 HK	小米集团-W	2,600	39,106.51	0.00
237	301068	大地海洋	1,867	38,721.58	0.00
238	603270	金帝股份	1,943	38,549.12	0.00
239	688484	南芯科技	1,008	37,396.80	0.00
240	001328	登康口腔	1,445	36,558.50	0.00
241	603273	天元智能	1,772	32,516.20	0.00
242	301165	锐捷网络	1,077	32,137.68	0.00
243	603075	热威股份	1,812	31,981.80	0.00
244	301267	华夏眼科	1,509	31,266.48	0.00
245	301095	广立微	740	30,428.80	0.00
246	688146	中船特气	1,011	30,178.35	0.00
247	001282	三联锻造	1,045	28,956.95	0.00
248	301175	中科环保	6,370	27,964.30	0.00
249	688485	九州一轨	3,580	27,924.00	0.00
250	603276	恒兴新材	1,737	24,213.78	0.00
251	688071	华依科技	1,101	23,858.67	0.00
252	301127	天源环保	1,843	21,784.26	0.00
253	001360	南矿集团	1,762	21,654.98	0.00
254	301239	普瑞眼科	575	20,314.75	0.00
255	603172	万丰股份	1,220	19,715.20	0.00
256	301367	怡和嘉业	312	19,406.40	0.00
257	001367	海森药业	813	18,975.42	0.00
258	001324	长青科技	1,131	18,322.20	0.00
259	301132	满坤科技	468	17,872.92	0.00
260	301366	一博科技	482	16,407.28	0.00
261	301293	三博脑科	433	16,319.77	0.00
262	301311	昆船智能	832	15,292.16	0.00
263	301361	众智科技	517	15,044.70	0.00
264	301285	鸿日达	565	14,740.85	0.00
265	301176	逸豪新材	544	12,669.76	0.00
266	301139	元道通信	566	12,174.66	0.00
267	688478	晶升股份	402	11,706.24	0.00
268	301379	天山电子	629	11,598.76	0.00
269	301338	凯格精机	360	11,566.80	0.00
270	301318	维海德	402	11,042.94	0.00
271	301230	泓博医药	490	11,034.80	0.00
272	301398	星源卓镁	255	10,340.25	0.00

273	301282	金禄电子	434	10,320.52	0.00
274	301322	绿通科技	549	10,304.73	0.00
275	301306	西测测试	255	9,868.50	0.00
276	301335	天元宠物	588	9,343.32	0.00
277	301365	矩阵股份	774	8,506.26	0.00
278	301326	捷邦科技	227	7,386.58	0.00
279	301388	欣灵电气	292	7,215.32	0.00
280	301290	东星医疗	330	6,570.30	0.00
281	301276	嘉曼服饰	303	6,350.88	0.00
282	2013 HK	微盟集团	5,000	6,297.49	0.00
283	301233	盛帮股份	158	6,007.16	0.00
284	301309	万得凯	228	5,827.68	0.00
285	301161	唯万密封	346	5,373.38	0.00
286	301227	森鹰窗业	284	5,342.04	0.00
287	301316	慧博云通	359	5,270.12	0.00
288	301231	荣信文化	275	5,192.00	0.00
289	301313	凡拓数创	247	5,026.45	0.00
290	301319	唯特偶	167	5,015.01	0.00
291	301300	远翔新材	211	4,623.01	0.00
292	301273	瑞晨环保	277	4,312.89	0.00
293	909 HK	明源云	1,000	1,852.74	0.00
294	600760	中航沈飞	34	1,363.40	0.00
295	300002	神州泰岳	81	657.72	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	603259	药明康德	87,632,679.45	7.14
2	700 HK	腾讯控股	84,781,094.69	6.91
3	2015 HK	理想汽车-W	72,458,178.32	5.90
4	300750	宁德时代	50,324,575.40	4.10
5	688052	纳芯微	43,579,636.78	3.55
6	1548 HK	金斯瑞生物科技	37,318,319.24	3.04
7	2162 HK	康诺亚-B	31,870,929.01	2.60
8	2269 HK	药明生物	30,594,098.10	2.49
9	2057 HK	中通快递-W	30,297,027.30	2.47
10	300661	圣邦股份	29,900,180.60	2.44
11	688368	晶丰明源	24,223,521.82	1.97
12	600563	法拉电子	22,895,960.00	1.86
13	000333	美的集团	18,030,165.00	1.47
14	3347 HK	泰格医药	16,508,255.80	1.34

15	689009	九号公司	16,106,565.39	1.31
16	300866	安克创新	15,997,567.00	1.30
17	1810 HK	小米集团-W	14,246,634.65	1.16
18	3690 HK	美团-W	12,039,541.88	0.98
19	688608	恒玄科技	10,557,621.14	0.86
20	300223	北京君正	10,539,334.00	0.86

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	1024 HK	快手-W	73,002,083.70	5.95
2	300002	神州泰岳	68,994,731.66	5.62
3	9626 HK	哔哩哔哩-W	62,631,802.12	5.10
4	000526	学大教育	55,732,369.62	4.54
5	300033	同花顺	52,330,307.62	4.26
6	268 HK	金蝶国际	47,829,802.24	3.90
7	2013 HK	微盟集团	35,890,293.78	2.92
8	600276	恒瑞医药	32,166,847.18	2.62
9	300661	圣邦股份	27,369,608.92	2.23
10	2057 HK	中通快递-W	26,212,299.62	2.13
11	603039	泛微网络	25,840,824.00	2.10
12	002315	焦点科技	21,528,108.53	1.75
13	002475	立讯精密	21,172,233.09	1.72
14	689009	九号公司	15,300,653.40	1.25
15	1810 HK	小米集团-W	14,875,601.29	1.21
16	300378	鼎捷软件	14,649,102.72	1.19
17	688266	泽璟制药	13,010,426.87	1.06
18	2015 HK	理想汽车-W	12,230,622.27	1.00
19	300750	宁德时代	12,094,039.00	0.99
20	9995 HK	荣昌生物	11,351,407.97	0.92

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	701,614,827.03
卖出股票收入（成交）总额	719,124,873.48

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	60,313,978.85	5.29
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,313,978.85	5.29

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	019709	23 国债 16	350,000	35,546,527.40	3.12
2	019733	24 国债 02	229,000	23,145,732.68	2.03
3	019727	23 国债 24	11,000	1,120,009.45	0.10
4	019740	24 国债 09	5,000	501,709.32	0.04

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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	81,660.75
2	应收清算款	-
3	应收股利	72.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	246,828.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	328,562.44

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

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 (%)
136,369	4,745.88	149,118,128.09	23.04	498,072,497.97	76.96

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	3,459,557.69	0.53

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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年5月7日）基金份额总额	988,672,545.69
本报告期期初基金份额总额	656,917,260.32
本报告期基金总申购份额	42,561,786.09
减：本报告期基金总赎回份额	52,288,420.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	647,190,626.06

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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动情况。

(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

本报告期内，基金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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 (%)	
华创证券有限责任公司	2	411,175,201.14	28.94	277,728.24	28.96	-
中信建投证券股份有限公司	2	302,813,193.73	21.31	201,287.68	20.99	-
中信证券股份有限公司	2	301,467,490.34	21.22	207,754.83	21.66	-
国盛证券有限责任公司	4	95,491,525.66	6.72	66,310.33	6.91	-
长江证券股份有限公司	2	86,189,882.61	6.07	55,733.09	5.81	-
方正证券股份有限公司	2	76,554,794.31	5.39	50,314.02	5.25	-
国投证券股份有限公司	2	69,648,367.14	4.90	48,080.46	5.01	-
中国中金财富证券有限公司	2	42,448,925.96	2.99	27,416.61	2.86	-
中国国际金融股份有限公司	1	33,221,994.02	2.34	23,255.40	2.42	-
海通证券股份有限公司	2	1,728,325.60	0.12	1,116.51	0.12	-
财通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华鑫证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
南京证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
首创证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
五矿证券有限公司	2	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
----------------------	---	---	---	---	---	---

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

3. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中国中金财富证券有限公司退租交易单元 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(%)
华创证券有限责任公司	15,553,182.00	63.30	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	5,710,346.00	23.24	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	3,308,217.00	13.46	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
大同证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国融证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国泰君 安证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
华鑫证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
民生证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
南京证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
上海证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券 有限公 司	-	-	-	-	-	-
首创证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
五矿证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-
西南证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

股份有 限公司						
------------	--	--	--	--	--	--

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2024 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务安排的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 19 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实科技创新混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实科技创新混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实科技创新混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实科技创新混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实科技创新混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日