嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。本中期报告已经由全部独立董事签字同意。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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 9

§4 管理人报告 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
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 13

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13

§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 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 43

7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
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 44
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 48

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 48
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 49
7.12 投资组合报告附注 49

§8 基金份额持有人信息 50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50
8.2 盈利投资者数量占比 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 51

§9 开放式基金份额变动 51

§10 重大事件揭示 52

10.1 基金份额持有人大会决议 52
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 52
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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 53
10.8 其他重大事件 54

§11 影响投资者决策的其他重要信息 54

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 54

§12 备查文件目录 54

12.1 备查文件目录 54
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实兴锐优选一年持有期混合	
基金主代码	011841	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 6 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	387,610,867.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	011841	011842
报告期末下属分级基金的份额总额	294,315,537.85 份	93,295,329.15 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，通过对优质企业的研究和精选，实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将采用行业配置和个股精选相结合的方法进行股票投资。同时，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。具体投资策略包括： （一）资产配置策略（二）股票投资策略（三）债券投资策略（四）衍生品投资策略（五）资产支持证券投资策略（六）融资策略（七）风险管理策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+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，低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	冯萌
	联系电话	(010)65215588	021-52629999-213310
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fengmeng@cib.com.cn

客户服务电话	400-600-8800	95561
传真	(010)65215588	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100020	200120
法定代表人	经雷	吕家进

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C
本期已实现收益	137,201,428.65	46,338,026.50
本期利润	117,377,096.26	38,674,328.04
加权平均基金份额本期利润	0.2512	0.2353
本期加权平均净值利润率	25.19%	24.22%
本期基金份额净值增长率	29.19%	28.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利	31,114,002.96	7,034,025.84

润		
期末可供分配基金份额利润	0.1057	0.0754
期末基金资产净值	344,291,889.57	106,184,669.75
期末基金份额净值	1.1698	1.1382
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	16.98%	13.82%

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

嘉实兴锐优选一年持有期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	26.31%	1.70%	6.69%	0.96%	19.62%	0.74%
过去六个月	29.19%	1.60%	4.79%	0.92%	24.40%	0.68%
过去一年	59.09%	1.36%	18.39%	0.83%	40.70%	0.53%
过去三年	53.78%	1.29%	29.42%	0.91%	24.36%	0.38%
自基金合同生效起至今	16.98%	1.23%	9.99%	0.93%	6.99%	0.30%

嘉实兴锐优选一年持有期混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	26.13%	1.70%	6.69%	0.96%	19.44%	0.74%
过去六个月	28.81%	1.60%	4.79%	0.92%	24.02%	0.68%
过去一年	58.15%	1.36%	18.39%	0.83%	39.76%	0.53%

过去三年	51.04%	1.29%	29.42%	0.91%	21.62%	0.38%
自基金合同生效起至今	13.82%	1.23%	9.99%	0.93%	3.83%	0.30%

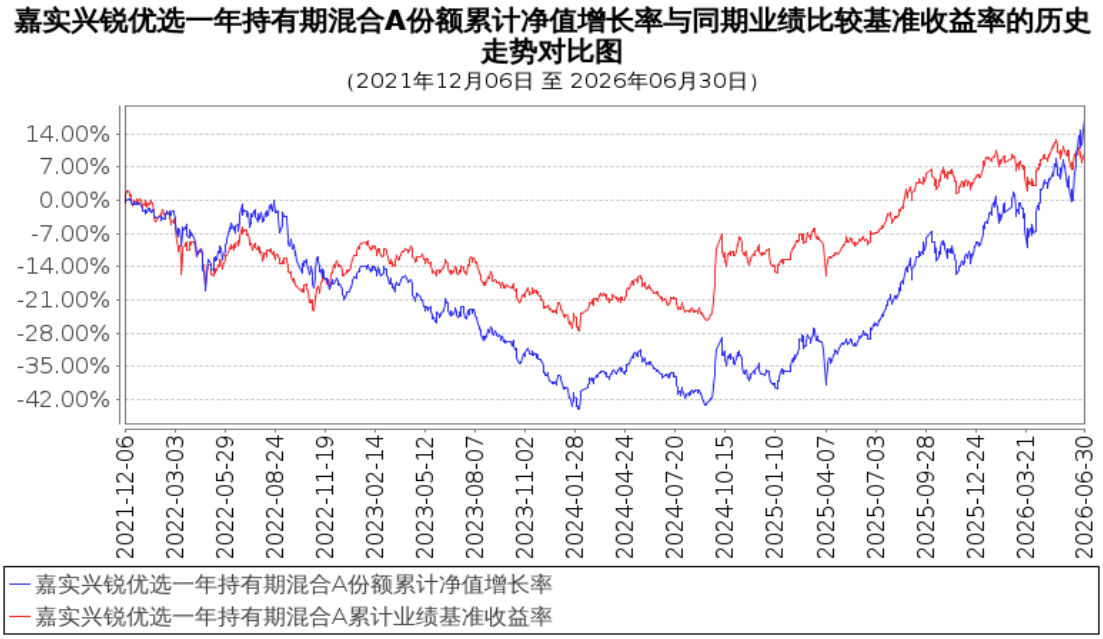
注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

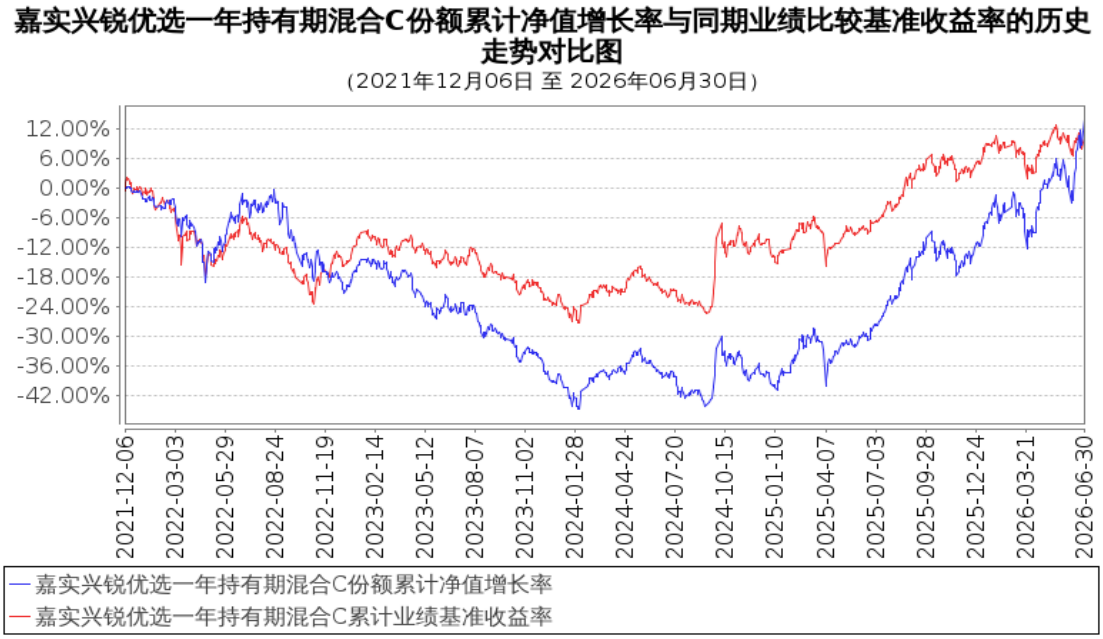
Return(t)=60%*(中证 800 指数(t)/中证 800 指数(t-1)-1)+20%*(恒生指数(t)/恒生指数(t-1)-1)+20%*(中债综合财富指数(t)/中债综合财富指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return(t))×（1+Benchmark(t-1)）-1

其中，t =1，2，3，…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





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金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。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 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 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、不动产基金等不同类别。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		
刘斌	本基金、嘉实优质	2024 年 12 月 14	-	20 年	曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金

	精选混合、嘉实中证半导体指数增强发起式、嘉实上证科创板 50 指数增强发起式、嘉实中证 A500 指数增强基金经理	日			融工程与量化投资部总监等职务。2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作，曾任增强风格投资总监，现任指数与量化投资首席投资官。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。

4.1.3 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
刘斌	公募基金	5	11,784,778,881.05	2022 年 4 月 22 日
	私募资产管理计划	1	283,453,718.70	2025 年 2 月 6 日
	其他组合	4	26,768,871,347.99	2017 年 3 月 13 日
	合计	10	38,837,103,947.74	-

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遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实兴锐优选一年持有期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 3 次，其中 2 次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，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，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

2026 年上半年 A 股市场整体上涨，但指数、行业与风格表现呈现显著分化。上证指数上半年上涨 3.16%，沪深 300 上涨 7.55%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 大涨 64.25%，科技成长指数明显领先大盘宽基指数。宏观层面，国内经济延续弱复苏态势，外需相对较强而内需仍显不足，PMI 在荣枯线附近波动，经济修复呈现一定的结构性特征。

从市场节奏看，一季度 A 股在高位震荡后受地缘冲突影响出现调整，上证指数、深证成指、创业板指和科创 50 分别下跌 1.94%、0.35%、0.57%和 6.54%，能源、资源及防御板块相对占优，科技成长板块承压。进入二季度，随着外部地缘风险缓和、AI 算力需求释放以及部分上游产业价格回暖，市场风险偏好快速修复，科技成长成为主线，创业板指与科创 50 显著上涨。上半年电子和通信行业分别上涨 86.29%和 73.59%，而商贸零售、农林牧渔、食品饮料等传统消费行业明显下跌，31 个申万一级行业中仅 10 个实现上涨，结构分化较为极致。

资金面总体保持活跃，上半年 A 股日均成交额约 2.7 万亿元，两融余额由 2.5 万亿元左右升至 3.0 万亿元，杠杆资金持续流入。季度之间看，一季度日均成交额约 2.5 万亿元，二季度进一步升至约 2.8 万亿元，科技龙头的资金虹吸效应有所增强。除权益市场外，债券市场先抑后扬，二季度在资金面边际宽松背景下震荡上行；人民币汇率在年初大幅升值、地缘冲突后震荡，并在二季度整体升值后维持震荡，外部利率与美元走势仍是重要影响因素。

本基金通过深入的基本面研究与定量分析，优选具备核心竞争力且盈利能力持续稳定增长的优质企业，构建稳健的投资组合。与此同时，本基金不仅关注企业的基本面稳健和成长性，还注重估值的合理性，精选买入价格具备安全边际的资产。报告期内，本基金严格遵循基金合同规定的投资目标，针对市场环境的变化对组合风格进行调整，以更为均衡的配置策略应对市场波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实兴锐优选一年持有期混合 A 基金份额净值为 1.1698 元，本报告期基金份

额净值增长率为 29.19%；截至本报告期末嘉实兴锐优选一年持有期混合 C 基金份额净值为 1.1382 元，本报告期基金份额净值增长率为 28.81%；业绩比较基准收益率为 4.79%。

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 2026 年下半年，国内经济仍可能延续外需相对较强、内需修复偏缓的结构，企业盈利改善的速度取决于稳增长政策落地、居民与企业需求恢复以及外部贸易环境变化。与此同时，政策继续重视资本市场内在稳定性，流动性环境总体有望保持合理充裕。随着前期政策效果逐步显现，经济与企业盈利存在边际企稳的可能，但地缘政治、海外货币政策和外需波动仍可能对市场形成扰动。

权益市场的主要驱动力预计将逐步由流动性和估值扩张转向盈利兑现，行情仍可能表现为结构性慢牛。AI 产业趋势有望继续贯穿全年，算力、半导体设备与材料、国产算力等高景气方向仍具中长期产业逻辑，能源转型及具备稳定现金流的高股息资产也具有配置价值。考虑到上半年科技板块涨幅较大、行业估值与交易拥挤度有所提升，下半年需要更加重视业绩与估值的匹配，可在科技成长等进攻方向与高股息、低波动资产之间保持适度均衡。

本基金将继续坚持基本面研究与定量分析相结合，重点考察企业竞争优势、盈利质量、成长持续性与估值匹配程度。在科技成长主线较为集中的市场环境中，组合将兼顾景气度与安全边际，保持相对均衡的行业配置，并通过持续跟踪企业盈利兑现情况应对市场风格波动。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,305,510.46	25,488,873.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	449,002,978.09	707,835,197.77
其中：股票投资		424,598,704.03	676,427,098.97
基金投资		-	-
债券投资		24,404,274.06	31,408,098.80
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		305,005.71	-
应收申购款		1,209.82	207.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		457,614,704.08	733,324,278.42
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		6,471,635.56	2,940,401.78
应付管理人报酬		453,686.85	734,817.93
应付托管费		75,614.50	122,469.65
应付销售服务费		55,619.48	90,413.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	1.05
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	81,588.37	164,013.12
负债合计		7,138,144.76	4,052,117.31
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	387,610,867.00	810,325,749.89
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	62,865,692.32	-81,053,588.78
净资产合计		450,476,559.32	729,272,161.11
负债和净资产总计		457,614,704.08	733,324,278.42

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实兴锐优选一年持有期混合 A 基金份额净值 1.1698 元，基金份额总额 294,315,537.85 份，嘉实兴锐优选一年持有期混合 C 基金份额净值 1.1382 元，基金份额总额 93,295,329.15 份，基金份额总额合计为 387,610,867.00 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		160,997,251.57	105,284,717.60
1.利息收入		12,442.59	24,488.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	12,442.59	24,488.34
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		188,472,839.83	31,052,851.63
其中：股票投资收益	6.4.7.14	185,325,985.91	24,705,056.54
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	502,889.20	89,337.56
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	2,643,964.72	6,258,457.53
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	-27,488,030.85	74,207,377.63
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		4,945,827.27	5,083,240.34
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	3,743,010.75	3,855,505.92
2．托管费	6.4.10.2.2	623,835.14	642,584.32
3．销售服务费	6.4.10.2.3	477,600.21	481,969.82
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		0.24	0.13

8. 其他费用	6.4.7.23	101,380.93	103,180.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		156,051,424.30	100,201,477.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		156,051,424.30	100,201,477.26
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		156,051,424.30	100,201,477.26

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	810,325,749.89	-	-81,053,588.78	729,272,161.11
二、本期期初净资产	810,325,749.89	-	-81,053,588.78	729,272,161.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-422,714,882.89	-	143,919,281.10	-278,795,601.79
（一）、综合收益总额	-	-	156,051,424.30	156,051,424.30
（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）	-422,714,882.89	-	-12,132,143.20	-434,847,026.09
其中：1.基金申购款	3,067,534.42	-	-10,476.17	3,057,058.25
2.基金赎回款	-425,782,417.31	-	-12,121,667.03	-437,904,084.34
（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	387,610,867.00	-	62,865,692.32	450,476,559.32

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	997,973,400.20	-	-372,430,312.08	625,543,088.12
二、本期期初净资产	997,973,400.20	-	-372,430,312.08	625,543,088.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-79,360,147.62	-	125,612,872.13	46,252,724.51
（一）、综合收益总额	-	-	100,201,477.26	100,201,477.26
（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）	-79,360,147.62	-	25,411,394.87	-53,948,752.75
其中：1.基金申购款	2,030,152.40	-	-647,606.12	1,382,546.28
2.基金赎回款	-81,390,300.02	-	26,059,000.99	-55,331,299.03
（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	918,613,252.58	-	-246,817,439.95	671,795,812.63

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	梁凯	李袁
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

嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管

理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]691 号《关于准予嘉实兴锐优选一年持有期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于 2021 年 9 月 3 日至 2021 年 12 月 2 日向社会公开募集，基金合同于 2021 年 12 月 6 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为 1,690,442,190.90 份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

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

（1）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部，税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部，税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；存款利息收入不征收增值税；

根据财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财政部，税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财税[2017]90 号《财政部、国家税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品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，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财税[2004]第 78 号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财税[2008]1 号《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》的规定，

对证券投资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，股权的股息、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。

（4）个人所得税

根据财税[2008]132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财税[2012]85 号《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》的规定，对个人持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利，按照本通知规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息红利继续暂减按 50%计入应纳税所得额，适用 20%的税率计征个人所得税。

前款所称限售股，是指财税[2009]167 号文件和财税[2010]70 号文件规定的限售股。根据财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、中国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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	6,053,145.90
等于：本金	6,052,416.56
加：应计利息	729.34
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	2,252,364.56
等于：本金	2,252,089.00
加：应计利息	275.56
减：坏账准备	-
合计	8,305,510.46

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		366,744,672.38	-	424,598,704.03	57,854,031.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	24,108,671.52	299,454.06	24,404,274.06	-3,851.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	24,108,671.52	299,454.06	24,404,274.06	-3,851.52
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		390,853,343.90	299,454.06	449,002,978.09	57,850,180.13

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 2026 年 6 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	81,326.92
其他	261.45

合计	81,588.37

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实兴锐优选一年持有期混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	606,765,237.06	606,765,237.06
本期申购	2,192,172.48	2,192,172.48
本期赎回（以“-”号填列）	-314,641,871.69	-314,641,871.69
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	294,315,537.85	294,315,537.85

嘉实兴锐优选一年持有期混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,560,512.83	203,560,512.83
本期申购	875,361.94	875,361.94
本期赎回（以“-”号填列）	-111,140,545.62	-111,140,545.62
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	93,295,329.15	93,295,329.15

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

嘉实兴锐优选一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-114,377,965.50	57,020,367.41	-57,357,598.09
本期期初	-114,377,965.50	57,020,367.41	-57,357,598.09
本期利润	137,201,428.65	-19,824,332.39	117,377,096.26
本期基金份额交易产生的变动数	8,290,539.81	-18,333,686.26	-10,043,146.45
其中：基金申购款	-93,847.21	87,732.49	-6,114.72
基金赎回款	8,384,387.02	-18,421,418.75	-10,037,031.73

本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,114,002.96	18,862,348.76	49,976,351.72

嘉实兴锐优选一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-42,406,537.67	18,710,546.98	-23,695,990.69
本期期初	-42,406,537.67	18,710,546.98	-23,695,990.69
本期利润	46,338,026.50	-7,663,698.46	38,674,328.04
本期基金份额交易产生的变动数	3,102,537.01	-5,191,533.76	-2,088,996.75
其中：基金申购款	-25,569.90	21,208.45	-4,361.45
基金赎回款	3,128,106.91	-5,212,742.21	-2,084,635.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,034,025.84	5,855,314.76	12,889,340.60

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,556.65
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,885.31
结算备付金利息收入	-
其他	0.63
合计	12,442.59

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	185,325,985.91
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	185,325,985.91

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,374,324,027.59
减：卖出股票成本总额	1,186,998,440.84
减：交易费用	1,999,600.84

买卖股票差价收入	185,325,985.91

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	182,180.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	320,708.92
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	502,889.20

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	25,065,326.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,461,561.48
减：应计利息总额	283,007.96
减：交易费用	48.23
买卖债券差价收入	320,708.92

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,643,964.72
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	2,643,964.72

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-27,488,030.85
股票投资	-27,221,562.57
债券投资	-266,468.28
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	-27,488,030.85

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	21,819.55
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	6,578.67
债券托管账户维护费	9,000.00
深港通证券组合费	4,475.34
合计	101,380.93

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、关联关系

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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,743,010.75	3,855,505.92
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,857,013.30	1,911,475.63
应支付基金管理人的净管理费	1,885,997.45	1,944,030.29

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	623,835.14	642,584.32

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	2,903.74	2,903.74
兴业银行	-	455,908.07	455,908.07
合计	-	458,811.81	458,811.81
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	2,210.40	2,210.40
兴业银行	-	461,802.95	461,802.95
合计	-	464,013.35	464,013.35

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费＝C 类基金份额前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
兴业银行股份有限公司_活期	6,053,145.90	8,556.65	2,866,969.03	2,406.08

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(2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	274	14,593.24	16,094.76	-
001248	华润新能	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	15,974	161,497.14	161,497.14	-

	源									
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内(含)	新发未上市	10.11	10.11	6,846	69,213.06	69,213.06	-
001257	盛龙股份	2026年3月24日	6个月	新股锁定	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026年4月14日	6个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026年5月11日	6个月	新股锁定	27.19	31.31	680	18,489.20	21,290.80	-
301666	大普微	2026年4月8日	6个月	新股锁定	46.08	463.33	1,037	47,784.96	480,473.21	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定	69.66	160.06	643	44,791.38	102,918.58	-
301683	慧谷新材	2026年3月24日	6个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026年1月21日	6个月	新股锁定	11.18	17.59	709	7,926.62	12,471.31	-
603293	埃泰	2026年4	6个月	新股	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-

	克	月 9 日		锁定						
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股锁定	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688765	禾元生物	2025 年 10 月 16 日	9 个月	新股锁定	29.06	48.56	13,744	399,400.64	667,408.64	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股锁定	8.62	57.42	33,401	287,916.62	1,917,885.42	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688790	昂瑞	2025 年 12	9 个月	新股	83.06	126.45	2,174	180,572.44	274,902.30	-

	微	月 9 日		锁定						
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	2,756	314,955.68	1,865,646.64	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	186	8,288.16	87,172.62	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	997	19,620.96	141,065.53	-

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	14,500	6,795,317.84	12,753,185.00	-

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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，还有董事会合规与风险控制委员会、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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均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。

本基金在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，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末

	2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	24,404,274.06	30,890,278.79
合计	24,404,274.06	30,890,278.79

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	517,820.01
未评级	-	-
合计	-	517,820.01

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。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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监

控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人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，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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 2026 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	8,305,510.46	-	-	-	8,305,510.46
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	24,404,274.06	-	-	424,598,704.03	449,002,978.09
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	-	-	-	305,005.71	305,005.71
应收申购款	-	-	-	1,209.82	1,209.82

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	32,709,784.52	-	-	424,904,919.56	457,614,704.08
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,471,635.56	6,471,635.56
应付管理人报酬	-	-	-	453,686.85	453,686.85
应付托管费	-	-	-	75,614.50	75,614.50
应付销售服务费	-	-	-	55,619.48	55,619.48
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	-	-	-	81,588.37	81,588.37
负债总计	-	-	-	7,138,144.76	7,138,144.76
利率敏感度缺口	32,709,784.52	-	-	417,766,774.80	450,476,559.32
上年度末 2025 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	25,488,873.60	-	-	-	25,488,873.60
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	30,890,278.79	-	517,820.01	676,427,098.97	707,835,197.77
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	-	-	-	207.05	207.05
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	56,379,152.39	-	517,820.01	676,427,306.02	733,324,278.42
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	2,940,401.78	2,940,401.78
应付管理人报酬	-	-	-	734,817.93	734,817.93

应付托管费	-	-	-	122,469.65	122,469.65
应付销售服务费	-	-	-	90,413.78	90,413.78
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1.05	1.05
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	164,013.12	164,013.12
负债总计	-	-	-	4,052,117.31	4,052,117.31
利率敏感度缺口	56,379,152.39	-	517,820.01	672,375,188.71	729,272,161.11

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率下降 25 个基点	4,509.52	25,552.51
	市场利率上升 25 个基点	-4,507.86	-25,370.63

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	-	37,347,825.47	-	37,347,825.47
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	-	37,347,825.47	-	37,347,825.47
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	-	37,347,825.47	-	37,347,825.47

项目	上年度末 2025 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	-	191,053,208.57	-	191,053,208.57
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	-	191,053,208.57	-	191,053,208.57
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	-	191,053,208.57	-	191,053,208.57

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民	1,867,391.27	9,552,660.43

	币升值 5%		
	所有外币相对人民币贬值 5%	-1,867,391.27	-9,552,660.43

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	424,598,704.03	94.26	676,427,098.97	92.75
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	424,598,704.03	94.26	676,427,098.97	92.75

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升	35,619,412.68	53,629,293.29

	5%		
	业绩比较基准下降 5%	-35,619,412.68	-53,629,293.29

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	405,161,066.15	673,631,236.00
第二层次	37,388,169.26	30,890,278.79
第三层次	6,453,742.68	3,313,682.98
合计	449,002,978.09	707,835,197.77

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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	424,598,704.03	92.79
	其中：股票	424,598,704.03	92.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	24,404,274.06	5.33
	其中：债券	24,404,274.06	5.33
	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	8,305,510.46	1.81
8	其他各项资产	306,215.53	0.07
9	合计	457,614,704.08	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 37,347,825.47 元，占基金资产净值的比例为 8.29%。

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	21,503,449.82	4.77
C	制造业	290,951,785.45	64.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	230,710.20	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	209,483.46	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,716,426.35	7.48
J	金融业	15,133,054.00	3.36
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	25,505,969.28	5.66

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	387,250,878.56	85.96

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	597,284.46	0.13
非必需消费品	483,869.21	0.11
必需消费品	135,485.11	0.03
能源	-	-
金融	968,085.84	0.21
医疗保健	23,386,282.00	5.19
工业	-	-
信息技术	8,269,551.41	1.84
原材料	571,158.48	0.13
房地产	2,641,670.51	0.59
公用事业	294,438.45	0.07
合计	37,347,825.47	8.29

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	603986	兆易创新	21,300	17,359,500.00	3.85
2	00981	中芯国际	106,500	8,269,551.41	1.84
2	688981	中芯国际	50,900	8,083,938.00	1.79
3	600176	中国巨石	203,400	14,823,792.00	3.29
4	300054	鼎龙股份	132,700	14,062,219.00	3.12
5	300604	长川科技	40,300	13,759,226.00	3.05
6	688012	中微公司	28,757	13,472,654.50	2.99
7	300308	中际旭创	10,600	13,462,000.00	2.99
8	688072	拓荆科技	14,500	12,753,185.00	2.83
9	002463	沪电股份	81,700	12,483,760.00	2.77
10	688337	普源精电	139,778	10,473,565.54	2.32
11	002156	通富微电	128,500	9,749,295.00	2.16
12	002049	紫光国微	108,400	9,620,500.00	2.14
13	300750	宁德时代	24,000	9,432,240.00	2.09
14	301095	广立微	79,300	9,361,365.00	2.08
15	600150	中国船舶	275,000	9,292,250.00	2.06

16	002202	金风科技	364,500	8,711,550.00	1.93
17	300012	华测检测	616,500	8,544,690.00	1.90
18	603259	药明康德	68,328	8,507,519.28	1.89
19	688710	益诺思	125,800	8,453,760.00	1.88
20	002851	麦格米特	50,000	8,359,000.00	1.86
21	002415	海康威视	236,700	8,095,140.00	1.80
22	688256	寒武纪	4,917	7,845,319.35	1.74
23	000938	紫光股份	267,900	7,731,594.00	1.72
24	300033	同花顺	32,060	7,726,460.00	1.72
25	000426	兴业银锡	226,300	7,458,848.00	1.66
26	600030	中信证券	257,800	7,406,594.00	1.64
27	000988	华工科技	40,000	7,384,400.00	1.64
28	688008	澜起科技	22,300	6,910,770.00	1.53
29	000425	徐工机械	845,800	6,842,522.00	1.52
30	688002	睿创微纳	44,101	6,821,983.69	1.51
31	600535	天士力	510,280	6,751,004.40	1.50
32	688615	合合信息	58,200	6,582,420.00	1.46
33	300957	贝泰妮	204,400	6,440,644.00	1.43
34	002283	天润工业	617,300	5,956,945.00	1.32
35	600988	赤峰黄金	198,900	5,235,048.00	1.16
36	600845	宝信软件	309,400	5,145,322.00	1.14
37	600482	中国动力	156,500	5,133,200.00	1.14
38	002545	东方铁塔	311,000	5,044,420.00	1.12
39	002128	电投能源	214,500	4,959,240.00	1.10
40	002768	国恩股份	91,908	4,784,730.48	1.06
41	603171	税友股份	120,000	4,782,000.00	1.06
42	09969	诺诚健华	458,000	4,717,859.37	1.05
43	01801	信达生物	67,000	4,632,150.86	1.03
44	02162	康诺亚-B	75,000	4,608,743.44	1.02
45	002821	凯莱英	27,700	4,487,400.00	1.00
46	01093	石药集团	740,000	4,479,807.19	0.99
47	06990	科伦博泰生物	11,700	4,432,679.67	0.98
48	601899	紫金矿业	150,600	3,786,084.00	0.84
48	02899	紫金矿业	24,000	571,158.48	0.13
49	002317	众生药业	174,900	4,297,293.00	0.95
50	002487	大金重工	58,900	3,414,433.00	0.76
51	002008	大族激光	20,000	3,002,200.00	0.67
52	002460	赣锋锂业	39,200	2,563,680.00	0.57
53	02423	贝壳-W	66,200	2,159,625.26	0.48
54	688783	西安奕材	33,401	1,917,885.42	0.43
55	688795	摩尔线程	2,756	1,865,646.64	0.41
56	688766	普冉股份	900	689,940.00	0.15
57	688765	禾元生物	13,744	667,408.64	0.15

58	02318	中国平安	14,000	620,752.69	0.14
59	00700	腾讯控股	1,600	597,284.46	0.13
60	688498	源杰科技	268	505,448.00	0.11
61	09988	阿里巴巴-W	6,000	483,869.21	0.11
62	01109	华润置地	18,500	482,045.25	0.11
63	301666	大普微	1,037	480,473.21	0.11
64	03692	翰森制药	16,000	411,623.22	0.09
65	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.09
66	002979	雷赛智能	6,400	356,992.00	0.08
67	02628	中国人寿	15,000	347,333.15	0.08
68	00371	北控水务集团	150,000	294,438.45	0.07
69	688790	昂瑞微	2,174	274,902.30	0.06
70	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.06
71	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.06
72	300681	英搏尔	9,000	257,580.00	0.06
73	603799	华友钴业	5,300	255,778.00	0.06
74	001248	华润新能源	22,820	230,710.20	0.05
75	600233	圆通速递	13,200	207,900.00	0.05
76	300073	当升科技	4,300	206,572.00	0.05
77	000408	藏格矿业	2,400	166,368.00	0.04
78	688820	盛合晶微	997	141,065.53	0.03
79	688809	强一股份	222	138,306.00	0.03
80	06618	京东健康	4,750	135,485.11	0.03
81	01177	中国生物制药	27,000	103,418.25	0.02
82	301682	宏明电子	643	102,918.58	0.02
83	688797	臻宝科技	186	87,172.62	0.02
84	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
85	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
86	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
87	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
88	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
89	603993	洛阳钼业	1,600	28,080.00	0.01
90	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
91	001365	天海电子	680	21,290.80	0.00
92	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
93	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
94	001237	惠康科技	274	16,094.76	0.00
95	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
96	601112	振石股份	709	12,471.31	0.00
97	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
98	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
99	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
100	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00

101	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
102	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
103	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
104	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	688615	合合信息	17,819,085.68	2.44
2	688981	中芯国际	16,754,646.60	2.30
3	603259	药明康德	16,494,270.80	2.26
4	300604	长川科技	16,360,108.00	2.24
5	002821	凯莱英	11,696,601.60	1.60
6	002517	恺英网络	11,067,637.00	1.52
7	002020	京新药业	11,009,927.00	1.51
8	300973	立高食品	10,526,837.00	1.44
9	603997	继峰股份	10,451,945.98	1.43
10	600150	中国船舶	10,401,587.58	1.43
11	603298	杭叉集团	10,389,794.40	1.42
12	002602	世纪华通	10,272,807.00	1.41
13	300750	宁德时代	10,245,887.00	1.40
14	002008	大族激光	10,125,303.00	1.39
15	300012	华测检测	10,076,284.00	1.38
16	600750	华润江中	10,064,690.93	1.38
17	300138	晨光生物	10,062,914.00	1.38
18	000100	TCL 科技	10,061,110.00	1.38
19	301580	爱迪特	10,055,556.78	1.38
20	000708	中信特钢	10,046,796.30	1.38

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	00981	中芯国际	26,145,503.64	3.59
1	688981	中芯国际	9,988,896.49	1.37
2	02899	紫金矿业	31,185,213.85	4.28
2	601899	紫金矿业	3,026,752.00	0.42
3	301377	鼎泰高科	21,666,039.00	2.97
4	605376	博迁新材	20,532,598.26	2.82
5	688270	ST 臻镭	20,408,904.27	2.80
6	603588	高能环境	19,938,898.40	2.73
7	300502	新易盛	19,452,176.82	2.67
8	688766	普冉股份	19,449,034.42	2.67
9	688025	杰普特	18,743,029.95	2.57

10	00700	腾讯控股	18,597,564.30	2.55
11	09988	阿里巴巴-W	18,529,539.35	2.54
12	300972	万辰集团	18,528,248.00	2.54
13	688308	欧科亿	18,233,107.11	2.50
14	002487	大金重工	18,138,580.00	2.49
15	603259	药明康德	17,537,421.00	2.40
16	002008	大族激光	15,631,262.00	2.14
17	02318	中国平安	15,575,735.29	2.14
18	301358	湖南裕能	15,522,067.51	2.13
19	301031	中熔电气	15,464,450.93	2.12
20	300850	新强联	14,915,227.25	2.05
21	002709	天赐材料	14,788,628.00	2.03

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	962,391,608.47
卖出股票收入（成交）总额	1,374,324,027.59

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	24,404,274.06	5.42
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	24,404,274.06	5.42

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	019785	25 国债 13	241,000	24,404,274.06	5.42

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	305,005.71
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,209.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	306,215.53

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	12,753,185.00	2.83	重大事项停牌

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

份额级别	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（%）
嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	3,244	90,726.12	1,041,614.50	0.35	293,273,923.35	99.65
嘉实兴锐优选一年持有期混合 C	1,487	62,740.64	1,000,135.00	1.07	92,295,194.15	98.93
合计	4,661	83,160.45	2,041,749.50	0.53	385,569,117.50	99.47

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	100.00

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区

间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	1.98	0.00
	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C	-	-
	合计	1.98	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	0
	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	0
	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实兴锐优选一年持有期混合 A	嘉实兴锐优选一年持有期混合 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 6 日）基金份额总额	1,279,414,239.15	411,027,951.75
本报告期期初基金份额总额	606,765,237.06	203,560,512.83
本报告期基金总申购份额	2,192,172.48	875,361.94
减：本报告期基金总赎回份额	314,641,871.69	111,140,545.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	294,315,537.85	93,295,329.15

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

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

2026 年 6 月 26 日本基金管理人发布公告，程剑先生离任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内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

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

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，会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	高级管理人员

受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 1 月 5 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	监管谈话
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《开放式证券投资基金销售费用管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从加强制度建设、完善流程机制、优化系统功能、加强人员培训等方面整改完毕，已通过整改验收。
其他	-

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
广发证券股份有限公司	3	2,334,677,558.09	100.00	1,030,786.55	100.00	-
兴业银行股份有限公司	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）合规风控能力较强；

（4）研究、交易等服务能力较强。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商

签订协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
广发证券股份有限公司	24,794,626.80	100.00	-	-	-	-
兴业银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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 2026 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	2026 年 3 月 20 日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§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兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复文件。

（2）《嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实兴锐优选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实兴锐优选一年持有期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）报告期内嘉实兴锐优选一年持有期混合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。

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日