

# 嘉实匠心回报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：中国工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。

基金托管人中国工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

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 5         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 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合规守信情况的说明              | 10        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 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        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 12        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>13</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 13        |
| 6.2 利润表                                 | 14        |
| 6.3 净资产变动表                              | 15        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>39</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 39        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 40        |
| 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       | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 42        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 43        |

|   |           |
|---|-----------|
| 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 .....    | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 ..... | 43        |
| 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 .....    | 43        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 43        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 43        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 44        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>44</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 44        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 45        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....      | 45        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>46</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>46</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 46        |
| 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 .....      | 46        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 46        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 46        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 46        |
| 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 .....         | 47        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 47        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 53        |
| <b>§ 11 备查文件目录 .....</b>                    | <b>53</b> |
| 11.1 备查文件目录 .....                           | 53        |
| 11.2 存放地点 .....                             | 54        |
| 11.3 查阅方式 .....                             | 54        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                  |                 |
|-----------------|------------------|-----------------|
| 基金名称            | 嘉实匠心回报混合型证券投资基金  |                 |
| 基金简称            | 嘉实匠心回报混合         |                 |
| 基金主代码           | 011626           |                 |
| 基金运作方式          | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日         | 2021 年 3 月 30 日  |                 |
| 基金管理人           | 嘉实基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人           | 中国工商银行股份有限公司     |                 |
| 报告期末基金份额总额      | 809,918,689.90 份 |                 |
| 基金合同存续期         | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称     | 嘉实匠心回报混合 A       | 嘉实匠心回报混合 C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 011626           | 011627          |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 768,435,512.58 份 | 41,483,177.32 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选具有核心竞争力的优质公司进行投资，力争实现基金资产的中长期稳健增值。  |
| 投资策略   | 本基金充分发挥基金管理人研究优势，在经济转型升级、以高质量发展为目标的大背景下，深入研究行业发展趋势及不同子行业景气度变化，积极挖掘国内国际双循环相互促进及发展过程中各类股票的投资机会，力争通过深入的基本面研究精选个股，以谋求超额收益。具体包括：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、融资策略、风险管理策略。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 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   | 中国工商银行股份有限公司      |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 胡勇钦               |
|         | 联系电话         | (010)65215588     |
|         | 电子邮箱         | service@jsfund.cn |
| 客户服务电话  | 400-600-8800 | 95588             |

|       |                                       |                   |
|-------|---------------------------------------|-------------------|
| 传真    | (010) 65215588                        | (010) 66105798    |
| 注册地址  | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 1806A 单元    | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址  | 北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码  | 100020                                | 100140            |
| 法定代表人 | 经雷                                    | 廖林                |

## 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 | <a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a> |
| 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<br>据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) |                |
|-------------------|-------------------------------------|----------------|
|                   | 嘉实匠心回报混合 A                          | 嘉实匠心回报混合 C     |
| 本期已实现收益           | -30,241,238.54                      | -1,733,956.88  |
| 本期利润              | -30,702,688.60                      | -1,693,359.26  |
| 加权平均基金份<br>额本期利润  | -0.0390                             | -0.0394        |
| 本期加权平均净<br>值利润率   | -5.70%                              | -5.91%         |
| 本期基金份额净<br>值增长率   | -5.62%                              | -5.98%         |
| 3.1.2 期末数<br>据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日)               |                |
| 期末可供分配利           | -265,383,721.26                     | -15,025,047.77 |

|              |                  |               |
|--------------|------------------|---------------|
| 润            |                  |               |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.3454          | -0.3622       |
| 期末基金资产净值     | 503,051,791.32   | 26,458,129.55 |
| 期末基金份额净值     | 0.6546           | 0.6378        |
| 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  | -34.54%          | -36.22%       |

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

嘉实匠心回报混合 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月      | -7.10%   | 0.55%       | -2.27%     | 0.37%         | -4.83%  | 0.18% |
| 过去三个月      | -4.90%   | 0.88%       | 0.06%      | 0.60%         | -4.96%  | 0.28% |
| 过去六个月      | -5.62%   | 1.06%       | 2.10%      | 0.72%         | -7.72%  | 0.34% |
| 过去一年       | -14.69%  | 1.01%       | -6.07%     | 0.71%         | -8.62%  | 0.30% |
| 过去三年       | -35.43%  | 1.01%       | -25.81%    | 0.86%         | -9.62%  | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -34.54%  | 0.97%       | -23.69%    | 0.85%         | -10.85% | 0.12% |

嘉实匠心回报混合 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   |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | -7.15%   | 0.55%       | -2.27%     | 0.37%         | -4.88% | 0.18% |
| 过去三个月 | -5.08%   | 0.88%       | 0.06%      | 0.60%         | -5.14% | 0.28% |

|            |         |       |         |       |         |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|---------|-------|
| 过去六个月      | -5.98%  | 1.06% | 2.10%   | 0.72% | -8.08%  | 0.34% |
| 过去一年       | -15.36% | 1.01% | -6.07%  | 0.71% | -9.29%  | 0.30% |
| 过去三年       | -36.96% | 1.01% | -25.81% | 0.86% | -11.15% | 0.15% |
| 自基金合同生效起至今 | -36.22% | 0.97% | -23.69% | 0.85% | -12.53% | 0.12% |

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：

$$\text{Return}(t) = 65\% * (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) + 15\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

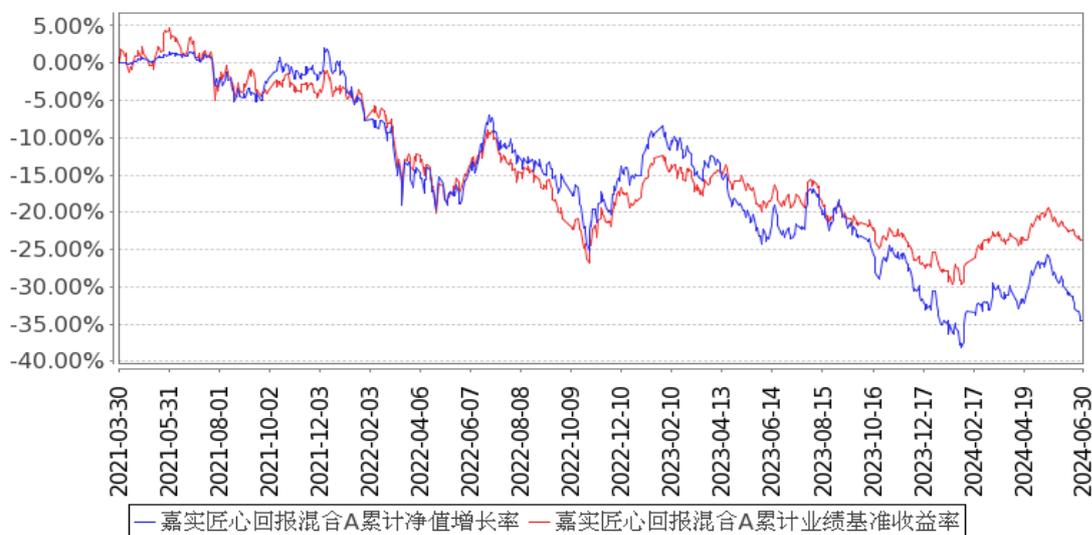
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

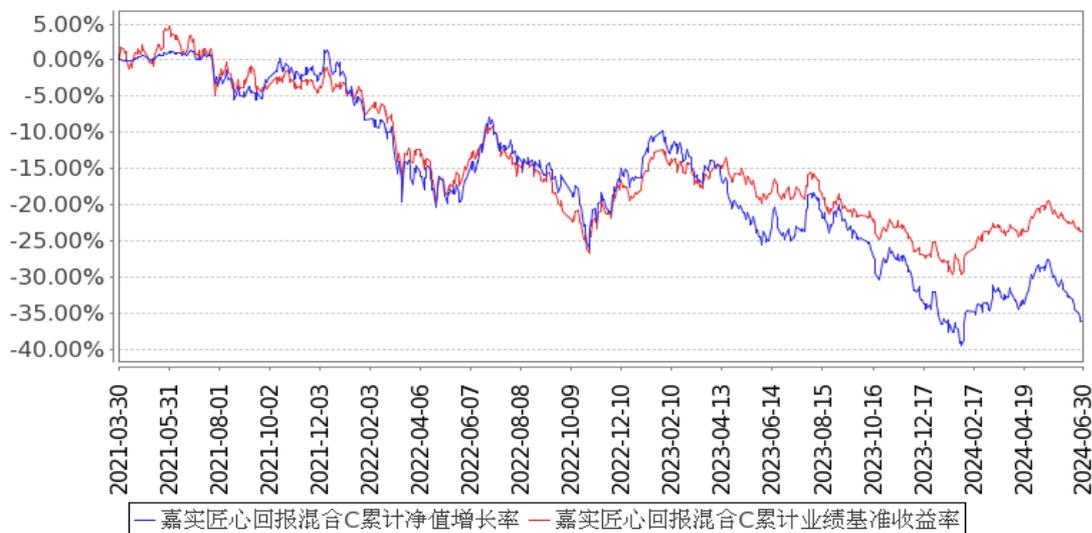
嘉实匠心回报混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年03月30日至2024年06月30日)



### 嘉实匠心回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年03月30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 |        |  |
| 常蓁 | 本基金、嘉实服务 | 2021年3月30日      | -    | 17年    | 曾任建信基金管理公司行业研究员。2010年加入嘉实基金管理有限公司，先后担任 |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | 增值行业混合、嘉实回报混合、嘉实优化红利混合、嘉实回报精选股票、嘉实品质回报混合基金经理 |  |  |  | 行业研究员及基金经理，现任平衡风格投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
|--|--|--|--|--|--|

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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、《嘉实匠心回报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

回顾上半年，国内经济增长在一季度好于市场预期后，二季度的数据显示修复过程仍有波折，整体复苏情况偏弱。叠加人民币汇率压力以及海外不确定性抬升对风险偏好的影响，虽然国内政

策暖风频吹，但投资者信心修复仍面临挑战。在这样的背景下，A 股市场在上半年走势较为震荡，上证指数最低时接近 2600 点，最高时接近 3200 点。上半年万得全 A 整体下跌 8%，上证 50 上涨 2.95%，沪深 300 上涨 0.9%，创业板指下跌 11%。行业分化明显，银行、公用事业为代表的稳定价值、高股息板块领涨。成长方向除了通信以外普遍下跌。整体来看，风格对结构的影响要远大于细分行业的差异。

这种极致分化的行情对于基金投资选股提出了更高的要求，也对于我们坚守长期优质资产的框架提出了极大的挑战。如何在持仓上平衡短期与长期之间的关系，如何在控制好回撤幅度的情况下做好获得长期回报的准备，如何不忘初心，在市场不乐观的情绪环境下坚守信念，也是我们需要持续思考的方向。

本基金上半年维持中等仓位，持仓仍然主要集中在长期竞争壁垒突出，能够看到长期成长性和确定性的优质个股上。我们仍然坚信，要坚持做长期正确的事情，才能经过时间的考验获得好的结果。希望广大持有人在此时刻能够同舟共济，我们必不忘初心，持续努力，为持有人争取创造长期稳定的复合回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实匠心回报混合 A 基金份额净值为 0.6546 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.62%；截至本报告期末嘉实匠心回报混合 C 基金份额净值为 0.6378 元，本报告期基金份额净值增长率为-5.98%；业绩比较基准收益率为 2.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为预期最为悲观时期可能已经过去，宏观层面看，国内经济逐步复苏的趋势不变，下半年稳增长政策加码结合当前资本市场政策红利下制度不断完善，以及中长期改革推进。中微观层面，市场对于宏观环境悲观预期导致很多优质标的经历长期的大幅调整后，估值普遍已经达到历史低位，仅考虑股息回报也很有吸引力。因此我们认为市场当前位置中期机会大于风险。我们也会坚持在继续努力挖掘战略性投资机会的同时，避免风格漂移，坚守投资理念，杜绝扎堆热门板块，注重防范风险。

我们主要从长期角度，把握下面的几类机会：1) 长期发展逻辑较好，竞争壁垒较高的以高端白酒、医药为代表的消费类优质个股；2) 在国际上具有竞争优势的制造业龙头；3) 商业模式稳定、长期空间较大、竞争优势明显、估值有吸引力的，符合经济转型需要的科技创新型企业。我们认为，以合理的价格买入优质公司并长期持有是持续获得超额回报的有效途径，希望从最本质的规律出发，在不确定的未来中寻找更确定的机会，继续优化组合，力求赢得长期稳定的回报。

#### 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

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

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

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：嘉实匠心回报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<br>2024 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 49,736,875.72                  | 19,425,714.59                    |
| 结算备付金         |            | 442.57                         | 438.38                           |
| 存出保证金         |            | 6,525.22                       | 9,942.58                         |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 477,567,231.41                 | 570,342,967.76                   |
| 其中：股票投资       |            | 477,165,428.09                 | 543,616,114.92                   |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | 401,803.32                     | 26,726,852.84                    |
| 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         |            | 3,262,795.92                   | 6,243,523.94                     |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 7,394.80                       | 4,193.65                         |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 530,581,265.64                 | 596,026,780.90                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |
| 短期借款          |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债       |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债        | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款     |            | -                              | -                                |
| 应付清算款         |            | -                              | -                                |
| 应付赎回款         |            | 212,044.45                     | 2,146,145.83                     |

|             |          |                 |                 |
|-------------|----------|-----------------|-----------------|
| 应付管理人报酬     |          | 550,111.89      | 605,790.14      |
| 应付托管费       |          | 91,685.31       | 100,965.03      |
| 应付销售服务费     |          | 18,285.18       | 20,439.42       |
| 应付投资顾问费     |          | -               | -               |
| 应交税费        |          | 4.03            | 4.16            |
| 应付利润        |          | -               | -               |
| 递延所得税负债     |          | -               | -               |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 199,213.91      | 218,027.90      |
| 负债合计        |          | 1,071,344.77    | 3,091,372.48    |
| <b>净资产：</b> |          |                 |                 |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 809,918,689.90  | 855,860,947.11  |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -280,408,769.03 | -262,925,538.69 |
| 净资产合计       |          | 529,509,920.87  | 592,935,408.42  |
| 负债和净资产总计    |          | 530,581,265.64  | 596,026,780.90  |

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，嘉实匠心回报混合 A 基金份额净值 0.6546 元，基金份额总额 768,435,512.58 份，嘉实匠心回报混合 C 基金份额净值 0.6378 元，基金份额总额 41,483,177.32 份，基金份额总额合计为 809,918,689.90 份。

## 6.2 利润表

会计主体：嘉实匠心回报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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023<br>年 6 月 30 日 |
|-------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>    |          | -28,228,906.56                           | -68,803,063.41                                |
| 1. 利息收入           |          | 65,202.96                                | 208,711.28                                    |
| 其中：存款利息收入         | 6.4.7.13 | 65,202.96                                | 104,091.00                                    |
| 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        |          | -  | 104,620.28                                    |
| 其他利息收入            |          | -  | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | -27,884,852.48                           | 5,219,316.84                                  |
| 其中：股票投资收益         | 6.4.7.14 | -33,959,343.97                           | -2,840,562.61                                 |
| 基金投资收益            |          | -  | -   |
| 债券投资收益            | 6.4.7.15 | 97,225.70                                | 265,959.21                                    |
| 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   | 5,977,265.79          | 7,793,920.24          |
| 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   | -420,852.44           | -74,234,199.00        |
| 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   | 11,595.40             | 3,107.47              |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | <b>4,167,141.30</b>   | <b>7,137,430.42</b>   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 3,385,562.41          | 5,892,055.66          |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -                     | -                     |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 564,260.41            | 982,009.33            |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 114,101.36            | 159,373.05            |
| 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                   |            | 2.59                  | 1.52                  |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 103,214.53            | 103,990.86            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>-32,396,047.86</b> | <b>-75,940,493.83</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>-32,396,047.86</b> | <b>-75,940,493.83</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | <b>-32,396,047.86</b> | <b>-75,940,493.83</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实匠心回报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<br>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 | 855,860,947.11                        | -      | -262,925,538.69 | 592,935,408.42 |
| 二、本期期初净资产 | 855,860,947.11                        | -      | -262,925,538.69 | 592,935,408.42 |

|  |                      |        |                 |                 |
|--|----------------------|--------|-----------------|-----------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -45,942,257.21       | -      | -17,483,230.34  | -63,425,487.55  |
| (一)、综合收益总额                               | -                    | -      | -32,396,047.86  | -32,396,047.86  |
| (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)      | -45,942,257.21       | -      | 14,912,817.52   | -31,029,439.69  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 5,727,085.04         | -      | -1,774,520.07   | 3,952,564.97    |
| 2. 基金赎回款                                 | -51,669,342.25       | -      | 16,687,337.59   | -34,982,004.66  |
| (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                                | 809,918,689.90       | -      | -280,408,769.03 | 529,509,920.87  |
| 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                                | 960,829,502.92       | -      | -145,123,141.46 | 815,706,361.46  |
| 二、本期期初净资产                                | 960,829,502.92       | -      | -145,123,141.46 | 815,706,361.46  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -46,673,917.26       | -      | -68,307,017.14  | -114,980,934.40 |
| (一)、综合收益总额                               | -                    | -      | -75,940,493.83  | -75,940,493.83  |
| (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)      | -46,673,917.26       | -      | 7,633,476.69    | -39,040,440.57  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 9,438,287.70         | -      | -1,704,667.27   | 7,733,620.43    |

|  |                |   |                 |                |
|--|----------------|---|-----------------|----------------|
| 2. 基金赎回款                                 | -56,112,204.96 | - | 9,338,143.96    | -46,774,061.00 |
| (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                                | 914,155,585.66 | - | -213,430,158.60 | 700,725,427.06 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

|           |           |           |
|-----------|-----------|-----------|
| <u>经雷</u> | <u>梁凯</u> | <u>李袁</u> |
| 基金管理人负责人  | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人   |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

嘉实匠心回报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]323号《关于准予嘉实匠心回报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3月15日至2021年3月26日向社会公开募集，基金合同于2021年3月30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1,303,838,917.71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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 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于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本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

##### 6.4.6.1 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。

##### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金

融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《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费附加，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。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《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。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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，自 2013 年 1 月 1 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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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。

#### 6.4.6.5 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<br>2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 49,736,875.72          |
| 等于：本金          | 49,732,437.62          |
| 加：应计利息         | 4,438.10               |
| 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             | 49,736,875.72          |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |      |                |                 |
|----|------------------------|------|----------------|-----------------|
|    | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动          |
| 股票 | 693,504,151.87         | -    | 477,165,428.09 | -216,338,723.78 |

|               |       |                |          |                |                 |
|---------------|-------|----------------|----------|----------------|-----------------|
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -              | -        | -              | -               |
| 债券            | 交易所市场 | 372,000.00     | 1,345.32 | 401,803.32     | 28,458.00       |
|               | 银行间市场 | -              | -        | -              | -               |
|               | 合计    | 372,000.00     | 1,345.32 | 401,803.32     | 28,458.00       |
| 资产支持证券        |       | -              | -        | -              | -               |
| 基金            |       | -              | -        | -              | -               |
| 其他            |       | -              | -        | -              | -               |
| 合计            |       | 693,876,151.87 | 1,345.32 | 477,567,231.41 | -216,310,265.78 |

#### 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<br>2024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      | 19,760.01         |
| 其中：交易所市场    | 19,760.01         |
| 银行间市场       | -                 |
| 应付利息        | -                 |
| 预提费用        | 179,453.90        |
| 合计          | 199,213.91        |

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 嘉实匠心回报混合 A

| 项目            | 本期<br>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          | 811,607,541.39             | 811,607,541.39 |
| 本期申购          | 1,660,907.00               | 1,660,907.00   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -44,832,935.81             | -44,832,935.81 |
| 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           | 768,435,512.58             | 768,435,512.58 |

## 嘉实匠心回报混合 C

| 项目 | 本期<br>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          | 44,253,405.72 | 44,253,405.72 |
| 本期申购          | 4,066,178.04  | 4,066,178.04  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,836,406.44 | -6,836,406.44 |
| 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           | 41,483,177.32 | 41,483,177.32 |

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

嘉实匠心回报混合 A

| 项目             | 已实现部分          | 未实现部分           | 未分配利润合计         |
|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| 上年度末           | -73,499,418.25 | -175,195,599.13 | -248,695,017.38 |
| 本期期初           | -73,499,418.25 | -175,195,599.13 | -248,695,017.38 |
| 本期利润           | -30,241,238.54 | -461,450.06     | -30,702,688.60  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 5,089,738.59   | 8,924,246.13    | 14,013,984.72   |
| 其中：基金申购款       | -194,298.43    | -352,040.13     | -546,338.56     |
| 基金赎回款          | 5,284,037.02   | 9,276,286.26    | 14,560,323.28   |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | -98,650,918.20 | -166,732,803.06 | -265,383,721.26 |

嘉实匠心回报混合 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计        |
|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 上年度末           | -4,792,798.28 | -9,437,723.03 | -14,230,521.31 |
| 本期期初           | -4,792,798.28 | -9,437,723.03 | -14,230,521.31 |
| 本期利润           | -1,733,956.88 | 40,597.62     | -1,693,359.26  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 390,681.23    | 508,151.57    | 898,832.80     |
| 其中：基金申购款       | -593,185.57   | -634,995.94   | -1,228,181.51  |
| 基金赎回款          | 983,866.80    | 1,143,147.51  | 2,127,014.31   |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -              |
| 本期末            | -6,136,073.93 | -8,888,973.84 | -15,025,047.77 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 63,787.95                  |

|           |           |
|-----------|-----------|
| 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 | 1,363.08  |
| 其他        | 51.93     |
| 合计        | 65,202.96 |

#### 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<br>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 | -33,959,343.97             |
| 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               | -33,959,343.97             |

##### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 50,088,640.12              |
| 减：卖出股票成本总额 | 83,958,669.56              |
| 减：交易费用     | 89,314.53                  |
| 买卖股票差价收入   | -33,959,343.97             |

##### 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 165,624.70                 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -68,399.00                 |
| 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                           | 97,225.70                  |

##### 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<br>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   | 39,590,240.00              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 38,868,399.00              |
| 减：应计利息总额               | 790,240.00                 |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | -68,399.00                 |

#### 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   | 5,977,265.79         |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                    |
| 基金投资产生的股利收益   | -                    |
| 合计            | 5,977,265.79         |

## 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             | -420,852.44          |
| 股票投资                   | -493,273.04          |
| 债券投资                   | 72,420.60            |
| 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                     | -420,852.44          |

## 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 | 11,581.68            |
| 基金转出费收入 | 13.72                |
| 合计      | 11,595.40            |

## 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<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 39,781.56                  |
| 信息披露费    | 59,672.34                  |
| 证券出借违约金  | -                          |
| 银行划款手续费  | 2,234.28                   |
| 深港通证券组合费 | 1,526.35                   |
| 合计       | 103,214.53                 |

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 6.4.8.1 或有事项

无。

## 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

## 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                  | 与本基金的关系     |
|------------------------|-------------|
| 嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）     | 基金管理人       |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人       |
| 嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）     | 基金管理人的控股子公司 |

## 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                              | 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 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 3,385,562.41                    | 5,892,055.66                    |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,595,354.57                    | 2,758,937.44                    |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,790,207.84                    | 3,133,118.22                    |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%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                              | 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 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 564,260.41                      | 982,009.33                      |

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                              |            |           |
|----------------|---------------------------------|------------|-----------|
|                | 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |            |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|                | 嘉实匠心回报混合 A                      | 嘉实匠心回报混合 C | 合计        |
| 嘉实基金管理有限公司     | -                               | 36,112.08  | 36,112.08 |
| 中国工商银行         | -                               | 25,595.25  | 25,595.25 |
| 嘉实财富           | -                               | 39.77      | 39.77     |
| 合计             | -                               | 61,747.10  | 61,747.10 |
| 获得销售服务费的各关联方   | 上年度可比期间                         |            |           |

| 方名称        | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |            |           |
|------------|---------------------------------|------------|-----------|
|            | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |            |           |
|            | 嘉实匠心回报混合 A                      | 嘉实匠心回报混合 C | 合计        |
| 嘉实基金管理有限公司 | -                               | 48,588.46  | 48,588.46 |
| 中国工商银行     | -                               | 34,826.75  | 34,826.75 |
| 嘉实财富       | -                               | 181.32     | 181.32    |
| 合计         | -                               | 83,596.53  | 83,596.53 |

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，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×0.80%/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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |           | 上年度可比期间<br>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     |
| 中国工商银行股份有限公司_活期 | 49,736,875.72                         | 63,787.95 | 42,366,588.71                              | 100,377.69 |

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 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | 26,335,199.01       |
| 合计     | -                 | 26,335,199.01       |

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<br>2024年6月30日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | -                   |
| AAA 以下 | 401,803.32        | 391,653.83          |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 401,803.32        | 391,653.83          |

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同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<br>2024年6月30日           | 1年以内                 | 1-5年              | 5年以上        | 不计息                    | 合计                    |
|-----------------------------|----------------------|-------------------|-------------|------------------------|-----------------------|
| <b>资产</b>                   |                      |                   |             |                        |                       |
| 货币资金                        | 49,736,875.72        | -                 | -           | -                      | 49,736,875.72         |
| 结算备付金                       | 442.57               | -                 | -           | -                      | 442.57                |
| 存出保证金                       | 6,525.22             | -                 | -           | -                      | 6,525.22              |
| 交易性金融资产                     | -                    | 401,803.32        | -           | -477,165,428.09        | 477,567,231.41        |
| 衍生金融资产                      | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 买入返售金融资产                    | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 应收清算款                       | -                    | -                 | -           | 3,262,795.92           | 3,262,795.92          |
| 债权投资                        | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 应收股利                        | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 应收申购款                       | -                    | -                 | -           | 7,394.80               | 7,394.80              |
| 递延所得税资产                     | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 其他资产                        | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| <b>资产总计</b>                 | <b>49,743,843.51</b> | <b>401,803.32</b> | <b>-</b>    | <b>-480,435,618.81</b> | <b>530,581,265.64</b> |
| <b>负债</b>                   |                      |                   |             |                        |                       |
| 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                       | -                    | -                 | -           | 212,044.45             | 212,044.45            |
| 应付管理人报酬                     | -                    | -                 | -           | 550,111.89             | 550,111.89            |
| 应付托管费                       | -                    | -                 | -           | 91,685.31              | 91,685.31             |
| 应付销售服务费                     | -                    | -                 | -           | 18,285.18              | 18,285.18             |
| 应付投资顾问费                     | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 应交税费                        | -                    | -                 | -           | 4.03                   | 4.03                  |
| 应付利润                        | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 递延所得税负债                     | -                    | -                 | -           | -                      | -                     |
| 其他负债                        | -                    | -                 | -           | 199,213.91             | 199,213.91            |
| <b>负债总计</b>                 | <b>-</b>             | <b>-</b>          | <b>-</b>    | <b>1,071,344.77</b>    | <b>1,071,344.77</b>   |
| <b>利率敏感度缺口</b>              | <b>49,743,843.51</b> | <b>401,803.32</b> | <b>-</b>    | <b>-479,364,274.04</b> | <b>529,509,920.87</b> |
| <b>上年度末<br/>2023年12月31日</b> | <b>1年以内</b>          | <b>1-5年</b>       | <b>5年以上</b> | <b>不计息</b>             | <b>合计</b>             |

|           |               |            |                 |              |                |
|-----------|---------------|------------|-----------------|--------------|----------------|
| 资产        |               |            |                 |              |                |
| 货币资金      | 19,425,714.59 | -          | -               | -            | 19,425,714.59  |
| 结算备付金     | 438.38        | -          | -               | -            | 438.38         |
| 存出保证金     | 9,942.58      | -          | -               | -            | 9,942.58       |
| 交易性金融资产   | 26,335,199.01 | 391,653.83 | -543,616,114.92 |              | 570,342,967.76 |
| 衍生金融资产    | -             | -          | -               | -            | -              |
| 买入返售金融资产  | -             | -          | -               | -            | -              |
| 应收清算款     | -             | -          | -               | 6,243,523.94 | 6,243,523.94   |
| 债权投资      | -             | -          | -               | -            | -              |
| 应收股利      | -             | -          | -               | -            | -              |
| 应收申购款     | -             | -          | -               | 4,193.65     | 4,193.65       |
| 递延所得税资产   | -             | -          | -               | -            | -              |
| 其他资产      | -             | -          | -               | -            | -              |
| 资产总计      | 45,771,294.56 | 391,653.83 | -549,863,832.51 |              | 596,026,780.90 |
| 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     | -             | -          | -               | 2,146,145.83 | 2,146,145.83   |
| 应付管理人报酬   | -             | -          | -               | 605,790.14   | 605,790.14     |
| 应付托管费     | -             | -          | -               | 100,965.03   | 100,965.03     |
| 应付销售服务费   | -             | -          | -               | 20,439.42    | 20,439.42      |
| 应付投资顾问费   | -             | -          | -               | -            | -              |
| 应交税费      | -             | -          | -               | 4.16         | 4.16           |
| 应付利润      | -             | -          | -               | -            | -              |
| 递延所得税负债   | -             | -          | -               | -            | -              |
| 其他负债      | -             | -          | -               | 218,027.90   | 218,027.90     |
| 负债总计      | -             | -          | -               | 3,091,372.48 | 3,091,372.48   |
| 利率敏感度缺口   | 45,771,294.56 | 391,653.83 | -546,772,460.03 |              | 592,935,408.42 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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          | -3,934.35                   | -16,310.86        |

|  |               |          |           |
|--|---------------|----------|-----------|
|  | 基点            |          |           |
|  | 市场利率下降 25 个基点 | 3,983.59 | 16,386.69 |

#### 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<br>2024年6月30日 |               |               |               |
|----------|-------------------|---------------|---------------|---------------|
|          | 美元<br>折合人民币       | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>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  | -                 | 40,315,891.22 | -             | 40,315,891.22 |
| 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     | -                 | 40,315,891.22 | -             | 40,315,891.22 |
| 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 | -                        | 40,315,891.22 | -             | 40,315,891.22 |
| 项目            | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |               |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币              | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>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       | -                        | 40,666,146.75 | -             | 40,666,146.75 |
| 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          | -                        | 40,666,146.75 | -             | 40,666,146.75 |
| 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 | - | 40,666,146.75 | - | 40,666,146.75 |

#### 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%   | 2,015,794.56                | 2,033,307.34      |
|    | 所有外币相对人民币贬值 5%   | -2,015,794.56               | -2,033,307.34     |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 |                   | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|------------------------|-------------------|--------------------------|-------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例 (%) | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 477,165,428.09         | 90.11             | 543,616,114.92           | 91.68             |
| 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            | 477,165,428.09         | 90.11             | 543,616,114.92           | 91.68             |

#### 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%        | 34,090,441.83               | 33,943,676.37          |
|    | 业绩比较基准下降 5%        | -34,090,441.83              | -33,943,676.37         |

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 477,567,231.41         | 542,341,597.92           |
| 第二层次          | -                      | 26,335,199.01            |
| 第三层次          | -                      | 1,666,170.83             |
| 合计            | 477,567,231.41         | 570,342,967.76           |

#### 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     | 477,165,428.09 | 89.93         |
|    | 其中：股票    | 477,165,428.09 | 89.93         |
| 2  | 基金投资     | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资   | 401,803.32     | 0.08          |
|    | 其中：债券    | 401,803.32     | 0.08          |
|    | 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      | 49,737,318.29  | 9.37   |
| 8 | 其他各项资产            | 3,276,715.94   | 0.62   |
| 9 | 合计                | 530,581,265.64 | 100.00 |

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 40,315,891.22 元，占基金资产净值的比例为 7.61%。

## 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         | 12,460,880.00  | 2.35         |
| B  | 采矿业              | -              | -            |
| C  | 制造业              | 352,980,561.16 | 66.66        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -              | -            |
| E  | 建筑业              | -              | -            |
| F  | 批发和零售业           | 9,855,572.40   | 1.86         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -              | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | 6,457,380.00   | 1.22         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,059,630.00   | 0.20         |
| J  | 金融业              | 24,893,784.90  | 4.70         |
| K  | 房地产业             | 19,321,932.00  | 3.65         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 2,124,660.00   | 0.40         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,693,578.09   | 1.45         |
| 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          | 1,558.32       | 0.00         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | -              | -            |
|    | 合计               | 436,849,536.87 | 82.50        |

### 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   | 20,358,933.72 | 3.84         |
| 非必需消费品 | 16,059,266.29 | 3.03         |
| 必需消费品  | 3,897,691.21  | 0.74         |
| 能源     | -             | -            |
| 金融     | -             | -            |

|      |               |      |
|------|---------------|------|
| 医疗保健 | -             | -    |
| 工业   | -             | -    |
| 信息技术 | -             | -    |
| 原材料  | -             | -    |
| 房地产  | -             | -    |
| 公用事业 | -             | -    |
| 合计   | 40,315,891.22 | 7.61 |

### 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  | 300750  | 宁德时代 | 271,080   | 48,802,532.40 | 9.22         |
| 2  | 600519  | 贵州茅台 | 32,500    | 47,690,175.00 | 9.01         |
| 3  | 300760  | 迈瑞医疗 | 101,500   | 29,527,365.00 | 5.58         |
| 4  | 000858  | 五粮液  | 227,813   | 29,169,176.52 | 5.51         |
| 5  | 603179  | 新泉股份 | 737,100   | 28,923,804.00 | 5.46         |
| 6  | 002415  | 海康威视 | 897,600   | 27,744,816.00 | 5.24         |
| 7  | 002311  | 海大集团 | 552,000   | 25,971,600.00 | 4.90         |
| 8  | 603369  | 今世缘  | 548,020   | 25,318,524.00 | 4.78         |
| 9  | 600036  | 招商银行 | 668,510   | 22,856,356.90 | 4.32         |
| 10 | 700 HK  | 腾讯控股 | 59,900    | 20,358,933.72 | 3.84         |
| 11 | 600809  | 山西汾酒 | 94,220    | 19,869,113.60 | 3.75         |
| 12 | 300628  | 亿联网络 | 539,111   | 19,823,111.47 | 3.74         |
| 13 | 600048  | 保利发展 | 2,205,700 | 19,321,932.00 | 3.65         |
| 14 | 601799  | 星宇股份 | 171,164   | 19,177,214.56 | 3.62         |
| 15 | 3690 HK | 美团-W | 134,750   | 13,663,481.29 | 2.58         |
| 16 | 002714  | 牧原股份 | 285,800   | 12,460,880.00 | 2.35         |
| 17 | 002595  | 豪迈科技 | 232,100   | 8,859,257.00  | 1.67         |
| 18 | 603259  | 药明康德 | 187,620   | 7,352,827.80  | 1.39         |
| 19 | 600754  | 锦江酒店 | 281,000   | 6,457,380.00  | 1.22         |
| 20 | 600085  | 同仁堂  | 158,900   | 6,071,569.00  | 1.15         |
| 21 | 603833  | 欧派家居 | 113,300   | 6,068,348.00  | 1.15         |
| 22 | 000963  | 华东医药 | 207,800   | 5,778,918.00  | 1.09         |
| 23 | 001215  | 千味央厨 | 181,736   | 5,137,676.72  | 0.97         |
| 24 | 603883  | 老百姓  | 222,040   | 4,076,654.40  | 0.77         |
| 25 | 1579 HK | 颐海国际 | 326,000   | 3,897,691.21  | 0.74         |
| 26 | 600183  | 生益科技 | 154,600   | 3,255,876.00  | 0.61         |
| 27 | 2020 HK | 安踏体育 | 35,000    | 2,395,785.00  | 0.45         |
| 28 | 601888  | 中国中免 | 34,000    | 2,124,660.00  | 0.40         |
| 29 | 601288  | 农业银行 | 467,300   | 2,037,428.00  | 0.38         |
| 30 | 300413  | 芒果超媒 | 50,700    | 1,059,630.00  | 0.20         |
| 31 | 688347  | 华虹公司 | 19,495    | 698,895.75    | 0.13         |
| 32 | 688271  | 联影医疗 | 4,935     | 541,369.50    | 0.10         |
| 33 | 688105  | 诺唯赞  | 17,029    | 340,750.29    | 0.06         |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 34 | 688459 | 哈铁科技 | 17,259 | 141,696.39 | 0.03 |
| 35 | 301559 | 中集环科 | 6,724  | 97,968.68  | 0.02 |
| 36 | 688581 | 安杰思  | 1,849  | 90,471.57  | 0.02 |
| 37 | 300015 | 爱尔眼科 | 151    | 1,558.32   | 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  | 002714  | 牧原股份 | 11,067,554.00 | 1.87           |
| 2  | 1579 HK | 颐海国际 | 5,038,137.77  | 0.85           |
| 3  | 002595  | 豪迈科技 | 1,895,564.00  | 0.32           |

注：报告期内，本基金累计买入金额前 20 名的股票明细仅包括上述 3 只股票。

##### 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  | 600048 | 保利发展  | 12,585,376.00 | 2.12           |
| 2  | 000002 | 万科 A  | 9,945,737.00  | 1.68           |
| 3  | 002304 | 洋河股份  | 7,436,752.00  | 1.25           |
| 4  | 700 HK | 腾讯控股  | 5,771,054.56  | 0.97           |
| 5  | 388 HK | 香港交易所 | 4,995,889.85  | 0.84           |
| 6  | 600519 | 贵州茅台  | 2,265,241.00  | 0.38           |
| 7  | 600754 | 锦江酒店  | 2,022,090.00  | 0.34           |
| 8  | 291 HK | 华润啤酒  | 1,555,151.64  | 0.26           |
| 9  | 001286 | 陕西能源  | 433,119.18    | 0.07           |
| 10 | 688361 | 中科飞测  | 339,565.36    | 0.06           |
| 11 | 001287 | 中电港   | 198,164.40    | 0.03           |
| 12 | 601061 | 中信金属  | 181,939.05    | 0.03           |
| 13 | 688486 | 龙迅股份  | 160,145.86    | 0.03           |
| 14 | 301421 | 波长光电  | 144,255.15    | 0.02           |
| 15 | 301348 | 蓝箭电子  | 130,122.68    | 0.02           |
| 16 | 688105 | 诺唯赞   | 126,211.98    | 0.02           |
| 17 | 301362 | 民爆光电  | 124,306.63    | 0.02           |
| 18 | 688602 | 康鹏科技  | 82,763.78     | 0.01           |
| 19 | 601065 | 江盐集团  | 76,309.60     | 0.01           |
| 20 | 601133 | 柏诚股份  | 72,155.20     | 0.01           |

##### 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 | 18,001,255.77 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 50,088,640.12 |

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值       | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|------------|---------------|
| 1  | 国家债券      | -          | -             |
| 2  | 央行票据      | -          | -             |
| 3  | 金融债券      | -          | -             |
|    | 其中：政策性金融债 | -          | -             |
| 4  | 企业债券      | -          | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -          | -             |
| 6  | 中期票据      | -          | -             |
| 7  | 可转债（可交换债） | 401,803.32 | 0.08          |
| 8  | 同业存单      | -          | -             |
| 9  | 其他        | -          | -             |
| 10 | 合计        | 401,803.32 | 0.08          |

### 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  | 113655 | 欧 22 转债 | 3,720 | 401,803.32 | 0.08          |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

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

无。

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

无。

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

无。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | 6,525.22     |
| 2  | 应收清算款 | 3,262,795.92 |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 7,394.80     |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 3,276,715.94 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称    | 公允价值       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1  | 113655 | 欧 22 转债 | 401,803.32 | 0.08         |

### 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

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

|                   | (户)    |           | 持有份额         | 占总份<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
|-------------------|--------|-----------|--------------|-------------------|----------------|-----------------------|
| 嘉实匠心<br>回报混合<br>A | 7,938  | 96,804.68 | 494,363.65   | 0.06              | 767,941,148.93 | 99.94                 |
| 嘉实匠心<br>回报混合<br>C | 2,480  | 16,727.09 | 1,000,585.00 | 2.41              | 40,482,592.32  | 97.59                 |
| 合计                | 10,225 | 79,209.65 | 1,494,948.65 | 0.18              | 808,423,741.25 | 99.82                 |

注：(1) 嘉实匠心回报混合 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实匠心回报混合 A 份额占嘉实匠心回报混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实匠心回报混合 A 份额占嘉实匠心回报混合 A 总份额比例；

(2) 嘉实匠心回报混合 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实匠心回报混合 C 份额占嘉实匠心回报混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实匠心回报混合 C 份额占嘉实匠心回报混合 C 总份额比例。

## 8.2 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<br>理人所<br>有从业<br>人员持<br>有本基<br>金 | 嘉实匠心回报混合 A | 197,639.45 | 0.03         |
|                                      | 嘉实匠心回报混合 C | 79,281.29  | 0.19         |
|                                      | 合计         | 276,920.74 | 0.03         |

## 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                                       | 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、<br>基金投资和部门<br>负责人持有本开放式<br>基金 | 嘉实匠心回报混合 A | 0                  |
|  | 嘉实匠心回报混合 C | 0                  |
|  | 合计         | 0                  |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金                      | 嘉实匠心回报混合 A | 0                  |
|  | 嘉实匠心回报混合 C | 0                  |
|  | 合计         | 0                  |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                     | 嘉实匠心回报混合 A       | 嘉实匠心回报混合 C    |
|--|------------------|---------------|
| 基金合同生效日<br>(2021 年 3 月 30 日)<br>基金份额总额 | 1,226,807,047.30 | 77,031,870.41 |
| 本报告期期初基金份额总额                           | 811,607,541.39   | 44,253,405.72 |
| 本报告期基金总申购份额                            | 1,660,907.00     | 4,066,178.04  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                          | 44,832,935.81    | 6,836,406.44  |
| 本报告期基金拆分变动份额                           | -                | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                           | 768,435,512.58   | 41,483,177.32 |

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，会计师事务所为安永华明会计师事务所（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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 交易单元数量 | 股票交易          |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|--------------|--------|---------------|------------------|-----------|----------------|----|
|              |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 (%) |    |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 3      | 18,301,094.57 | 26.88            | 12,810.81 | 27.12          | -  |
| 中信证券股份有限公司   | 5      | 14,867,641.58 | 21.84            | 10,407.34 | 22.04          | -  |
| 广发证券股份有限公司   | 5      | 12,577,673.50 | 18.47            | 8,520.49  | 18.04          | -  |
| 华泰证券股份有限公司   | 3      | 5,952,993.85  | 8.74             | 4,115.35  | 8.71           | -  |
| 招商证券股份有限公司   | 2      | 5,864,878.00  | 8.61             | 4,105.40  | 8.69           | -  |
| 国盛证券有限责任公司   | 4      | 5,488,866.85  | 8.06             | 3,751.50  | 7.94           | -  |
| 中信建投证券股份有限公司 | 3      | 2,022,090.00  | 2.97             | 1,415.46  | 3.00           | -  |
| 中国国际金融股份有限公司 | 2      | 1,586,827.74  | 2.33             | 1,110.76  | 2.35           | -  |
| 开源证券股份有限公司   | 3      | 811,316.92    | 1.19             | 560.12    | 1.19           | -  |
| 国联证券股份有限公司   | 2      | 556,217.79    | 0.82             | 389.38    | 0.82           | -  |

|              |   |           |      |       |      |   |
|--------------|---|-----------|------|-------|------|---|
| 公司           |   |           |      |       |      |   |
| 国信证券股份有限公司   | 2 | 60,295.09 | 0.09 | 42.20 | 0.09 | - |
| 财通证券股份有限公司   | 2 | -         | -    | -     | -    | - |
| 长江证券股份有限公司   | 2 | -         | -    | -     | -    | - |
| 德邦证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 东方财富证券股份有限公司 | 2 | -         | -    | -     | -    | - |
| 东方证券股份有限公司   | 2 | -         | -    | -     | -    | - |
| 东吴证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 东兴证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 高盛高华证券有限责任公司 | 2 | -         | -    | -     | -    | - |
| 光大证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 国都证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 国金证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 国投证券股份有限公司   | 1 | -         | -    | -     | -    | - |
| 海通证券股份有限公司   | 3 | -         | -    | -     | -    | - |
| 华宝证券         | 2 | -         | -    | -     | -    | - |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限<br>公司           |   |   |   |   |   |   |
| 华福证券<br>有限责任<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 华金证券<br>股份有限<br>公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 华源证券<br>股份有限<br>公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源<br>证券有限<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券<br>股份有限<br>公司   | 4 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券<br>股份有限<br>公司   | 2 | - | - | - | - | - |
| 中国银河<br>证券股份<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国中金<br>财富证券<br>有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中泰证券<br>股份有限<br>公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际<br>证券股份<br>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 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：天风证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易          |                  | 债券回购交易 |                    | 权证交易 |                  |
|--------------|---------------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
|              | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信证券股份有限公司   | 12,902,800.00 | 100.00           | -      | -                  | -    | -                |
| 广发证券股份有限公司   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 华泰证券股份有限公司   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 招商证券股份有限公司   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 国盛证券有限责任公司   | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 中信建投证券       | -             | -                | -      | -                  | -    | -                |

|                          |   |   |   |   |   |   |
|--------------------------|---|---|---|---|---|---|
| 股份有<br>限公司               |   |   |   |   |   |   |
| 中国国<br>际金融<br>股份有<br>限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 国联证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 国信证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 财通证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 长江证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 东方财<br>富证券<br>股份有<br>限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证<br>券股份<br>有限公<br>司   | - | - | - | - | - | - |

| 司            |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 高盛高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国都证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司   | - | - | - | - | - | - |
| 华金证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 华源证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 司            |   |   |   |   |   |   |
| 申万宏源证券有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国中金财富证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司   | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式                      | 法定披露日期          |
|----|--|-----------------------------|-----------------|
| 1  | 嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 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匠心回报混合型证券投资基金注册的批复文件。

- (2) 《嘉实匠心回报混合型证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实匠心回报混合型证券投资基金托管协议》;
- (4) 《嘉实匠心回报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) 报告期内嘉实匠心回报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](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日