嘉实核心成长混合型证券投资基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 24 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。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 9
3.3 其他指标 12
3.4 过去三年基金的利润分配情况 12

§4 管理人报告 12

4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 17
4.10 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 17

§5 托管人报告 17

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 18

§6 审计报告 18

6.1 审计报告基本信息 18
6.2 审计报告的基本内容 18

§7 年度财务报表 20

7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24

§8 投资组合报告 57
8.1 期末基金资产组合情况 57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 58
8.3 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 59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 63
8.6 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 63
8.7 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 63
8.8 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 63
8.9 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 63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 63
8.12 投资组合报告附注 64
§9 基金份额持有人信息 64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 65
9.3 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 65
§10 开放式基金份额变动 65
§11 重大事件揭示 66
11.1 基金份额持有人大会决议 66
11.2 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 66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
11.4 基金投资策略的改变 66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 67
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 67
11.8 其他重大事件 71
§12 备查文件目录 72
12.1 备查文件目录 72
12.2 存放地点 72
12.3 查阅方式 72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实核心成长混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实核心成长混合	
基金主代码	010186	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 10 月 28 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,078,721,846.37 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C
下属分级基金的交易代码	010186	010187
报告期末下属分级基金的份额总额	5,714,443,083.43 份	364,278,762.94 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过深入的基本面研究精选优质的长期潜力股并以合理价格买入，从而分享公司业绩持续增长带来的长期稳定回报，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金通过定性和定量相结合的方法对个股进行自下而上的选择，积极寻找长期业绩大幅超预期的优质公司,在具备合理安全边际时，作为组合的长线资产配置，同时结合行业配置情况适度进行均衡，构造和优化组合，谋求组合资产的长期稳定增值。具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率×10%+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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	郭松	任航
	联系电话	(010)65215588	010-66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599

传真	(010)65215588	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100020	100031
法定代表人	经雷	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东 2 座办公楼 8 层
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、基金净值表现及利润分配情况

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（2025 年 1 月 1 日-2025 年 12 月 31 日）		报告期（2024 年 1 月 1 日-2024 年 12 月 31 日）		报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C
本期已实现收益	159,799,123.21	8,620,114.59	-793,885,241.01	-53,752,277.88	-618,199,570.82	-43,188,443.46
本期	764,986,379.13	48,169,104.19	-55,733,460.94	-5,432,194.04	-1,375,272,545.66	-93,889,062.92

利润						
加权平均基金份额本期利润	0.1194	0.1147	-0.0075	-0.0109	-0.1696	-0.1696
本期加权平均净值利润率	18.52%	18.15%	-1.34%	-1.98%	-23.82%	-24.07%
本期基金份额净值增长率	20.03%	19.57%	-0.79%	-1.20%	-22.47%	-22.77%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	

期末可供分配利润	-1,680,370,496.83	-112,388,201.88	-2,878,371,651.91	-197,012,331.80	-3,163,368,302.82	-218,491,232.08
期末可供分配基金份额利润	-0.2941	-0.3085	-0.4119	-0.4217	-0.4072	-0.4147
期末基金资产净值	4,034,072,586.60	251,890,561.06	4,108,887,471.93	270,184,822.75	4,605,368,198.55	308,406,955.51
期末基金份额净值	0.7059	0.6915	0.5881	0.5783	0.5928	0.5853
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基	-29.41%	-30.85%	-41.19%	-42.17%	-40.72%	-41.47%

金份额累计净值增长率						

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

嘉实核心成长混合 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	-5.74%	1.12%	-0.46%	0.75%	-5.28%	0.37%
过去六个月	14.99%	1.05%	12.79%	0.70%	2.20%	0.35%
过去一年	20.03%	1.10%	15.37%	0.78%	4.66%	0.32%
过去三年	-7.68%	1.20%	20.62%	0.84%	-28.30%	0.36%
过去五年	-34.37%	1.32%	-2.67%	0.90%	-31.70%	0.42%
自基金合同生效起至今	-29.41%	1.30%	5.88%	0.90%	-35.29%	0.40%

嘉实核心成长混合 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	-5.83%	1.12%	-0.46%	0.75%	-5.37%	0.37%

过去六个月	14.77%	1.05%	12.79%	0.70%	1.98%	0.35%
过去一年	19.57%	1.10%	15.37%	0.78%	4.20%	0.32%
过去三年	-8.76%	1.20%	20.62%	0.84%	-29.38%	0.36%
过去五年	-35.66%	1.32%	-2.67%	0.90%	-32.99%	0.42%
自基金合同生效起至今	-30.85%	1.30%	5.88%	0.90%	-36.73%	0.40%

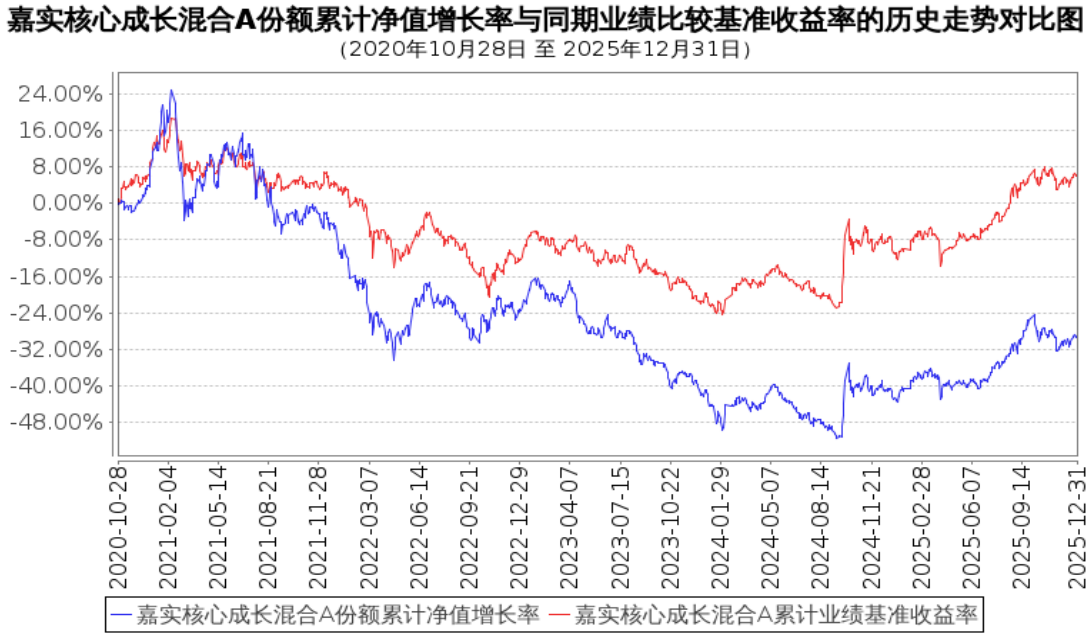
注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

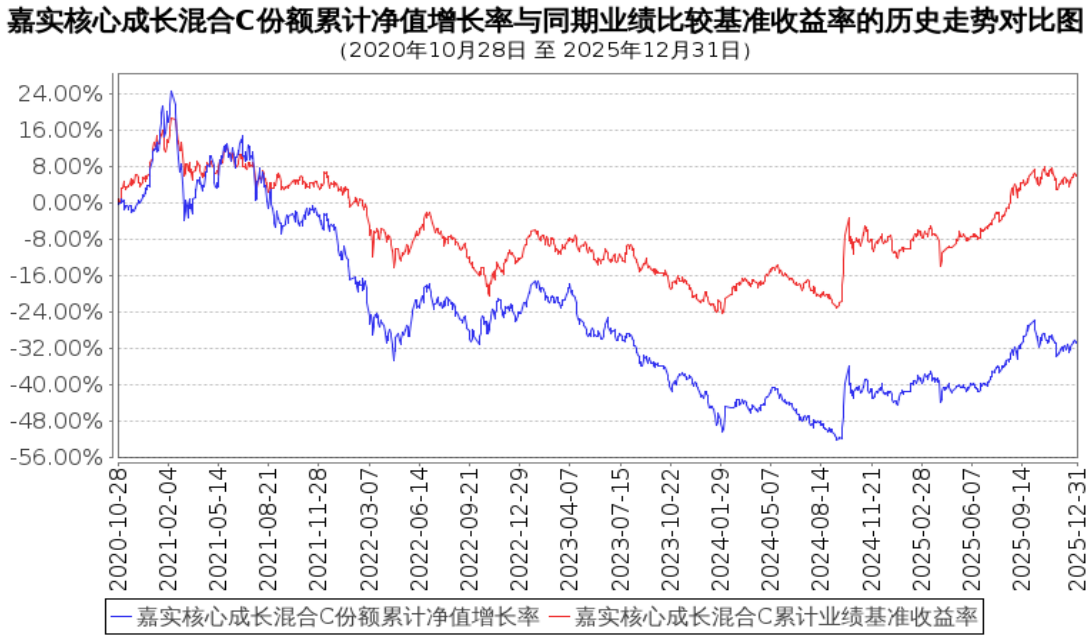
Return(t)=70%*(沪深 300 指数(t)/沪深 300 指数(t-1)-1)+20%*(中债综合财富指数(t)/中债综合财富指数(t-1)-1)+10%*(恒生指数(t)/恒生指数(t-1)-1)

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。

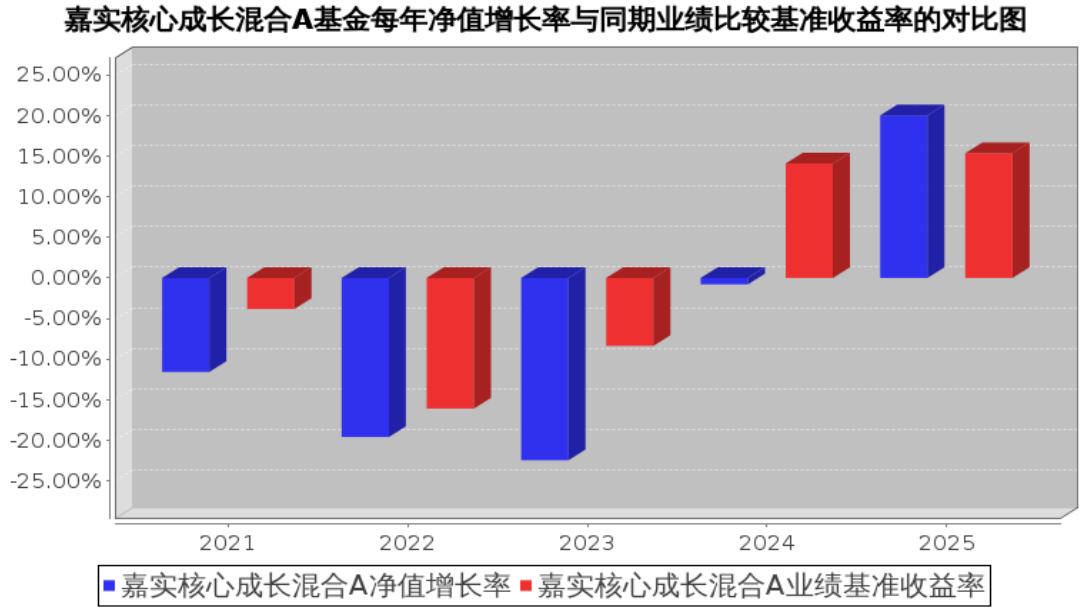
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

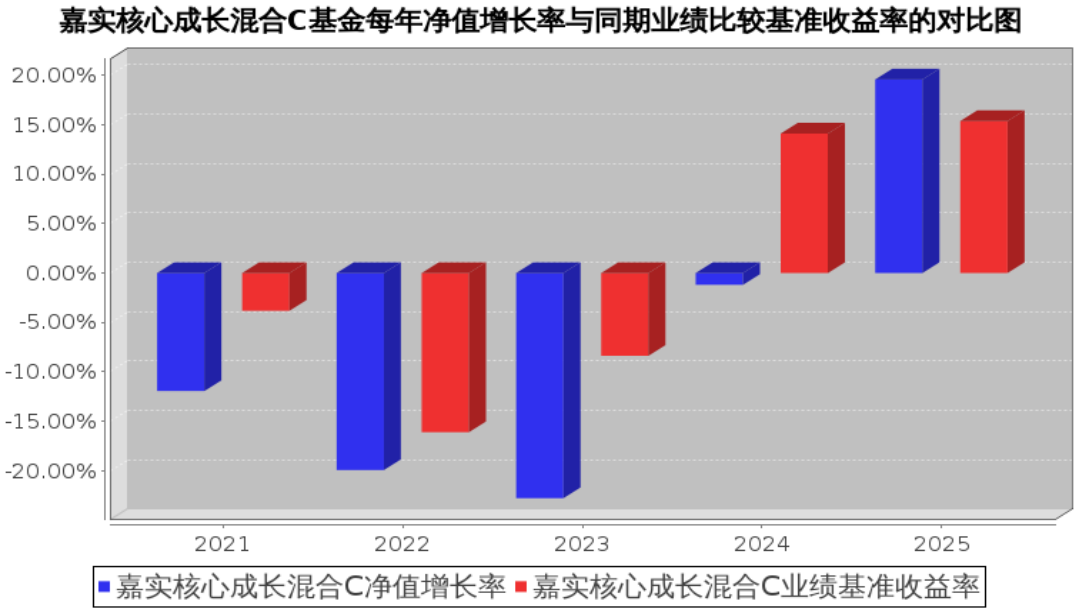




注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

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。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 2025 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 380 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		
归凯	本基金、	2020 年	-	19 年	曾任国都证券研究所研究员、投资经理。

	嘉实增长混合、嘉实泰和混合、嘉实新兴产业股票、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实远见精选两年持有期混合基金经理	10 月 28 日			2014 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监，现任成长风格投资总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
陈涛	本基金、嘉实新兴产业股票、嘉实企业变革股票、嘉实成长增强混合、嘉实策略精选混合基金经理	2025 年 5 月 6 日	-	10 年	曾任巴塞罗那德勤会计师事务所审计师，2015 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司研究部任行业研究员。硕士研究生，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。中国国籍。
孟夏	本基金、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实优势成长混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实多元动力混合、嘉实制造升级股票发起式、嘉实成长驱动混合、嘉实成长共享混合	2025 年 5 月 6 日	-	11 年	2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司研究部从事行业研究工作，历任机械行业研究员、制造组组长等。硕士研究生，CFA，具有基金从业资格。中国国籍。

	基金经理				

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、《嘉实核心成长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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易、境外投资以及投资管理过程中各个相关环节应当符合公平交易的监管要求，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司严格执行《公平交易管理制度》，各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部门集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 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 8 次，其中 2 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，另 6 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，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

2025 年，外部关税冲击与内部结构调整交织叠加，宏观经济运行面临复杂挑战。在此背景下，宏观政策以“适度宽松”与“超常规逆周期调节”协同发力，5 月降准 50bp 并小幅降息、结构性工具扩容，公开市场国债买卖恢复，流动性保持充裕、融资成本下行，为稳增长托底提供了充分条件。经济运行呈“前高后低”，全年实际 GDP 增长约 5%，四季度同比 4.5%；工业生产保持韧性，服务业回升，出口全年增长约 5.5%，但内需偏弱，全年社会消费品零售总额增长 3.7%，固定资产投资累计同比-3.8%。物价方面，全年 CPI 总体低位徘徊、PPI 仍在负值区间，但四季度制造业景气度回升，PMI 于 12 月重返荣枯线之上至 50.1。房地产层面，“去库存+稳预期”政策持续推进，销售当月同比降幅自四季度起连续收窄，核心城市成交有所改善，但投资与新开工仍弱，行业企稳仍需时间沉淀和政策持续发力。

市场层面，政策组合拳发力、流动性环境改善与企业盈利逐步修复形成共振，A 股延续“指数牛”格局，全年上证指数累计上涨约 18%，个股上涨家数占比约 79%，成长风格全年大幅领跑。“稳市场、稳预期”一揽子金融政策落地后，市场风险偏好持续回升：年初“Deepseek 时刻”引爆科技行情，随后贸易摩擦升级一度将市场推到几乎危机模式，后续伴随贸易摩擦缓和及 AI 产业趋势驱动，市场迎来强势反弹，四季度则进入震荡整固与风格再平衡阶段。行业表现呈现明显分化：有色、通信、电子、电力设备等板块受益于新质生产力培育与企业资本开支扩张，表现尤为突出，科技产业链业绩展现较强韧性；而食品饮料、美妆护理等内需消费板块，房地产、建筑装饰等地产产业链，以及煤炭、公用事业、交通运输、银行等高股息板块，全年表现相对滞后。

投资运作上，报告期内的全年看本基金增持科技和有色金属，减持医药和金融。截至报告期末，本基金的行业配置依次为科技、制造、医药、消费和有色金属。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实核心成长混合 A 基金份额净值为 0.7059 元，本报告期基金份额净值增长

率为 20.03%；截至本报告期末嘉实核心成长混合 C 基金份额净值为 0.6915 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.57%；业绩比较基准收益率为 15.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 2026 年 AH 资本市场整体表现仍持相对乐观态度，市场有望呈现“震荡运行、中枢缓慢抬升”的格局。资金层面，海内外流动性将持续保持相对宽松；基本面端，上市公司整体盈利拐点正逐步临近，市场驱动逻辑有望从单一估值驱动，转向估值与业绩双轮驱动。

产业层面，AI 超级周期驱动的全球产业升级持续推进，除算力、存力、运力外，更带动材料、金属、电力等领域掀起基础设施建设浪潮，其持续周期将突破以往既定的三年产业周期规律。

板块维度来看，前期的三大核心主线——1）强产业趋势下的科技 AI+、2）宏观中期趋势支撑下的资源与出海、3）反内卷与自主可控——在全年维度仍将孕育较多结构性机会；展望后续，前期具备困境反转属性的内需品种亦有望迎来业绩修复，进一步增强行情的持续性。

在当前环境下，基金经理将持续以高质量成长作为核心投资策略，不断学习迭代，聚焦代表中国经济转型升级、且契合产业趋势发展阶段的优质标的，力争为投资者实现长期可持续回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资交易、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持新业务开展，对新产品、新投资工具等进行合规性判断。在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，合规风控设置，建立禁限投库，合规培训，合规承诺书签署等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、提供处理建议并督促改正。优化和升级合规风控系统，不断提高自动化　监控能力，保障各类组合合规运作，保护投资者利益。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应合规检查报告及其后续改进跟踪。同时聘请并配合外部审计机构完成公司及基金的审计、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等项目。

（4）基金法务工作。包括合同、协议审查，主动发现并解决各项法律文件以及实务运作中存在的潜在法律风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理，持续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识

别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

4.7 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。

4.8 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“7.4.11　利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2600878 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实核心成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的嘉实核心成长混合型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	该基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不

	对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评

	价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	左艳霞	管祎铭
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼	
审计报告日期	2026 年 3 月 26 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实核心成长混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	402,879,231.34	127,292,216.73
结算备付金		29,670,911.23	59,735,366.46
存出保证金		1,199,005.40	497,906.22
交易性金融资产	7.4.7.2	3,895,605,406.87	4,071,015,796.71
其中：股票投资		3,877,496,864.40	3,933,771,761.75
基金投资		-	-
债券投资		18,108,542.47	137,244,034.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	51,416,000.00	131,613,480.81
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	14,761,795.80
应收股利		391,214.94	-
应收申购款		158,448.46	477,396.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		4,381,320,218.24	4,405,393,959.60
负债和净资产	**附注号**	**本期末**	**上年度末**

		2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		77,939,187.52	12,333,097.48
应付赎回款		10,870,653.38	7,583,317.64
应付管理人报酬		4,361,061.77	4,531,200.75
应付托管费		726,843.61	755,200.14
应付销售服务费		85,798.52	93,139.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		23.18	102.95
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,373,502.60	1,025,606.77
负债合计		95,357,070.58	26,321,664.92
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	6,078,721,846.37	7,454,456,278.39
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-1,792,758,698.71	-3,075,383,983.71
净资产合计		4,285,963,147.66	4,379,072,294.68
负债和净资产总计		4,381,320,218.24	4,405,393,959.60

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，嘉实核心成长混合 A 基金份额净值 0.7059 元，基金份额总额 5,714,443,083.43 份，嘉实核心成长混合 C 基金份额净值 0.6915 元，基金份额总额 364,278,762.94 份，基金份额总额合计为 6,078,721,846.37 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实核心成长混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		876,182,583.00	2,353,537.58
1.利息收入		1,999,227.14	7,343,496.41
其中：存款利息收入	7.4.7.13	1,288,092.24	1,841,217.32
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		711,134.90	5,502,279.09

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		229,323,128.19	-791,586,768.02
其中：股票投资收益	7.4.7.14	172,670,107.51	-889,426,530.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-244,939.34	2,413,988.35
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	56,897,960.02	95,425,774.08
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	644,736,245.52	786,471,863.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	123,982.15	124,945.28
减：二、营业总支出		63,027,099.68	63,519,192.56
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	52,839,347.11	53,291,880.77
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	7.4.10.2.2	8,806,557.83	8,881,980.06
3．销售服务费	7.4.10.2.3	1,063,771.53	1,098,625.75
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	7.4.7.22	-	-
7．税金及附加		26.05	185.21
8．其他费用	7.4.7.23	317,397.16	246,520.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		813,155,483.32	-61,165,654.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		813,155,483.32	-61,165,654.98
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		813,155,483.32	-61,165,654.98

7.3 净资产变动表

会计主体：嘉实核心成长混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	7,454,456,278.39	-	-3,075,383,983.71	4,379,072,294.68
二、本期期初净资产	7,454,456,278.39	-	-3,075,383,983.71	4,379,072,294.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,375,734,432.02	-	1,282,625,285.00	-93,109,147.02
（一）、综合收益总额	-	-	813,155,483.32	813,155,483.32
（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）	-1,375,734,432.02	-	469,469,801.68	-906,264,630.34
其中：1.基金申购款	152,320,512.96	-	-51,292,759.05	101,027,753.91
2.基金赎回款	-1,528,054,944.98	-	520,762,560.73	-1,007,292,384.25
（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	6,078,721,846.37	-	-1,792,758,698.71	4,285,963,147.66
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	8,295,634,688.96	-	-3,381,859,534.90	4,913,775,154.06
二、本期期初净资产	8,295,634,688.96	-	-3,381,859,534.90	4,913,775,154.06
三、本期增减变动额（减少以“-”	-841,178,410.5	-	306,475,551.19	-534,702,859.38

号填列）	7			
（一）、综合收益总额	-	-	-61,165,654.98	-61,165,654.98
（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）	-841,178,410.57	-	367,641,206.17	-473,537,204.40
其中：1.基金申购款	243,976,297.26	-	-103,413,275.25	140,563,022.01
2.基金赎回款	-1,085,154,707.83	-	471,054,481.42	-614,100,226.41
（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	7,454,456,278.39	-	-3,075,383,983.71	4,379,072,294.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实核心成长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[2020]2029 号《关于准予嘉实核心成长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 2020 年 10 月 26 日向社会公开募集，基金合同于 2020 年 10 月 28 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 14,837,490,427.36 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

7.4.2 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。

7.4.3 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其

继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具

体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益 ，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4)由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前按照《信息披露办法》的要求在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 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。

7.4.6.2 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征增值税试点的通知》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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；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。

7.4.6.3 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。

7.4.6.4 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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	402,879,231.34	127,292,216.73
等于：本金	402,837,580.49	127,263,416.93
加：应计利息	41,650.85	28,799.80
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	402,879,231.34	127,292,216.73

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		3,622,262,481.01	-	3,877,496,864.40	255,234,383.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,995,140.00	104,942.47	18,108,542.47	8,460.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,995,140.00	104,942.47	18,108,542.47	8,460.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,640,257,621.01	104,942.47	3,895,605,406.87	255,242,843.39
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,322,800,392.88	-	3,933,771,761.75	-389,028,631.13
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	135,229,451.00	2,479,354.96	137,244,034.96	-464,771.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	135,229,451.00	2,479,354.96	137,244,034.96	-464,771.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		4,458,029,843.88	2,479,354.96	4,071,015,796.71	-389,493,402.13

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	51,416,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	51,416,000.00	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	131,613,480.81	-
银行间市场	-	-
合计	131,613,480.81	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	517.03	327.23
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,317,985.57	865,279.54
其中：交易所市场	1,317,985.57	865,279.54
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	55,000.00	160,000.00
合计	1,373,502.60	1,025,606.77

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实核心成长混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,987,259,123.84	6,987,259,123.84
本期申购	127,146,384.18	127,146,384.18
本期赎回（以“-”号填列）	-1,399,962,424.59	-1,399,962,424.59
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	5,714,443,083.43	5,714,443,083.43

嘉实核心成长混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	467,197,154.55	467,197,154.55
本期申购	25,174,128.78	25,174,128.78
本期赎回（以“-”号填列）	-128,092,520.39	-128,092,520.39
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	364,278,762.94	364,278,762.94

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实核心成长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,202,554,761.32	-675,816,890.59	-2,878,371,651.91
本期期初	-2,202,554,761.32	-675,816,890.59	-2,878,371,651.91
本期利润	159,799,123.21	605,187,255.92	764,986,379.13
本期基金份额交易产生的变动数	419,705,522.36	13,309,253.59	433,014,775.95
其中：基金申购款	-41,939,681.48	-633,732.44	-42,573,413.92
基金赎回款	461,645,203.84	13,942,986.03	475,588,189.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,623,050,115.75	-57,320,381.08	-1,680,370,496.83

嘉实核心成长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-151,919,286.64	-45,093,045.16	-197,012,331.80
本期期初	-151,919,286.64	-45,093,045.16	-197,012,331.80
本期利润	8,620,114.59	39,548,989.60	48,169,104.19
本期基金份额交易产生的变动数	35,038,021.64	1,417,004.09	36,455,025.73
其中：基金申购款	-8,506,150.04	-213,195.09	-8,719,345.13
基金赎回款	43,544,171.68	1,630,199.18	45,174,370.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-108,261,150.41	-4,127,051.47	-112,388,201.88

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,215,345.80	1,264,281.65
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	69,347.10	571,705.83
其他	3,399.34	5,229.84
合计	1,288,092.24	1,841,217.32

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	172,670,107.51	-889,426,530.45
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	172,670,107.51	-889,426,530.45

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,880,527,507.84	3,538,259,871.49
减：卖出股票成本总额	6,694,559,192.26	4,421,211,922.59
减：交易费用	13,298,208.07	6,474,479.35
买卖股票差价收入	172,670,107.51	-889,426,530.45

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	391,897.66	1,963,826.35
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-636,837.00	450,162.00

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	-244,939.34	2,413,988.35

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	155,594,560.00	98,600,500.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	153,236,837.00	96,549,838.00
减：应计利息总额	2,994,560.00	1,600,500.00
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-636,837.00	450,162.00

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	56,897,960.02	95,425,774.08
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	56,897,960.02	95,425,774.08

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	644,736,245.52	786,471,863.91
股票投资	644,263,014.52	787,192,796.91
债券投资	473,231.00	-720,933.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3.其他	-	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	644,736,245.52	786,471,863.91

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	102,395.70	119,400.47
基金转出费收入	21,586.45	5,544.81
合计	123,982.15	124,945.28

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	55,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	59,564.95	40,779.99
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
深港通证券组合费	64,600.43	7,740.78
存托服务费	231.78	-
合计	317,397.16	246,520.77

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东

嘉实资本管理有限公司（“嘉实资本”）	基金管理人的控股子公司
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

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,839,347.11	53,291,880.77
其中：应支付销售机构的客户维护费	24,398,981.31	24,542,778.73
应支付基金管理人的净管理费	28,440,365.80	28,749,102.04

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,806,557.83	8,881,980.06

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。

7.4.10.2.3 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	163,206.93	163,206.93
中国农业银行	-	228,085.95	228,085.95
嘉实财富	-	16,121.44	16,121.44
合计	-	407,414.32	407,414.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	171,064.40	171,064.40
中国农业银行	-	221,965.26	221,965.26
嘉实财富	-	16,009.30	16,009.30
合计	-	409,038.96	409,038.96

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，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×0.40%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司_活期	402,879,231.34	1,215,345.80	127,292,216.73	1,264,281.65

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001280	中国铀业	2025 年 11 月 25 日	6 个月	新股锁定	17.89	45.36	2,277	40,735.53	103,284.72	-
001285	瑞立科	2025 年 9 月 23	6 个月	新股锁	42.28	56.08	137	5,792.36	7,682.96	-

	密	日		定						
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	6.85	12.89	897	6,144.45	11,562.33	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	42.94	94	1,543.48	4,036.36	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
301491	汉桑科技	2025 年 7 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.91	55.11	245	7,082.95	13,501.95	-
301563	云汉芯城	2025 年 9 月 23 日	6 个月	新股锁定	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	5.69	14.21	2,322	13,212.18	32,995.62	-
301656	联合动力	2025 年 9 月 17 日	6 个月	新股锁定	12.48	25.46	7,395	92,289.60	188,276.70	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
301668	昊创瑞通	2025 年 9 月 15 日	6 个月	新股锁定	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
603092	德力佳	2025 年 10 月 30	6 个月	新股锁	46.68	55.66	146	6,815.28	8,126.36	-

		日		定						
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股锁定	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603262	技源集团	2025 年 7 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.88	28.10	155	1,686.40	4,355.50	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股锁定	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
603370	华新精科	2025 年 8 月 27 日	6 个月	新股锁定	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股锁定	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603406	天富龙	2025 年 7 月 30 日	6 个月	新股锁定	23.60	40.16	153	3,610.80	6,144.48	-
603418	友升股份	2025 年 9 月 16 日	6 个月	新股锁定	46.36	59.06	139	6,444.04	8,209.34	-
688727	恒坤新材	2025 年 11 月 11 日	6 个月	新股锁定	14.99	34.87	563	8,439.37	19,631.81	-
688729	屹唐股份	2025 年 7 月 1 日	6 个月	新股锁定	8.45	24.28	3,505	29,617.25	85,101.40	-
688795	摩尔线	2025 年 11 月 26	9 个月	新股锁	114.28	416.02	10,828	1,237,423.84	4,504,664.56	-

	程	日		定						
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 2 日	6 个月	新股锁定	26.68	42.25	423	11,285.64	17,871.75	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股锁定	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
688807	优迅股份	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股锁定	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-
688809	强一股份	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股锁定	85.09	203.31	259	22,038.31	52,657.29	-

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。

7.4.12.2 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
688012	中微公司	2025 年 12 月 19 日	重大事项停牌	283.75	2026 年 1 月 5 日	278.00	657,592	134,691,141.34	186,591,730.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	18,108,542.47	106,599,034.96
合计	18,108,542.47	106,599,034.96

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	30,645,000.00
合计	-	30,645,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 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 7.4.12 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 7.4.12.3 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	402,879,231.34	-	-	-	402,879,231.34
结算备付金	29,670,911.23	-	-	-	29,670,911.23
存出保证金	1,199,005.40	-	-	-	1,199,005.40
交易性金融资产	18,108,542.47	-	-	3,877,496,864.40	3,895,605,406.87
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	51,416,000.00	-	-	-	51,416,000.00
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	391,214.94	391,214.94
应收申购款	-	-	-	158,448.46	158,448.46
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	503,273,690.44	-	-	3,878,046,527.80	4,381,320,218.24

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	-	-	-	77,939,187.52	77,939,187.52
应付赎回款	-	-	-	10,870,653.38	10,870,653.38
应付管理人报酬	-	-	-	4,361,061.77	4,361,061.77
应付托管费	-	-	-	726,843.61	726,843.61
应付销售服务费	-	-	-	85,798.52	85,798.52
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	23.18	23.18
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,373,502.60	1,373,502.60
负债总计	-	-	-	95,357,070.58	95,357,070.58
利率敏感度缺口	503,273,690.44	-	-	3,782,689,457.22	4,285,963,147.66
上年度末 2024 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	127,292,216.73	-	-	-	127,292,216.73
结算备付金	59,735,366.46	-	-	-	59,735,366.46
存出保证金	497,906.22	-	-	-	497,906.22
交易性金融资产	137,244,034.96	-	-	3,933,771,761.75	4,071,015,796.71
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	131,613,480.81	-	-	-	131,613,480.81
应收清算款	-	-	-	14,761,795.80	14,761,795.80
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	477,396.87	477,396.87
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	456,383,005.18	-	-	3,949,010,954.42	4,405,393,959.60
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	-	-	-	12,333,097.48	12,333,097.48
应付赎回款	-	-	-	7,583,317.64	7,583,317.64
应付管理人报酬	-	-	-	4,531,200.75	4,531,200.75

应付托管费	-	-	-	755,200.14	755,200.14
应付销售服务费	-	-	-	93,139.19	93,139.19
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	102.95	102.95
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,025,606.77	1,025,606.77
负债总计	-	-	-	26,321,664.92	26,321,664.92
利率敏感度缺口	456,383,005.18	-	-	3,922,689,289.50	4,379,072,294.68

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。

7.4.13.4.1.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上升 25 个基点	-25,573.78	-35,602.34
	市场利率下降 25 个基点	25,646.23	35,626.15

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 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	-	581,444,822.12	-	581,444,822.12
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	-	581,444,822.12	-	581,444,822.12
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	-	581,444,822.12	-	581,444,822.12
项目	上年度末 2024 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	-	379,263,955.67	-	379,263,955.67
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	-	379,263,955.67	-	379,263,955.67
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	-	379,263,955.67	-	379,263,955.67

7.4.13.4.2.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）

	所有外币相对人民币升值 5%	29,072,241.11	18,963,197.78
	所有外币相对人民币贬值 5%	-29,072,241.11	-18,963,197.78

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024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	3,877,496,864.40	90.47	3,933,771,761.75	89.83
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	3,877,496,864.40	90.47	3,933,771,761.75	89.83

7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末 （2024 年 12 月 31 日 ）

	业绩比较基准上升 5%	269,303,224.95	293,145,282.87
	业绩比较基准下降 5%	-269,303,224.95	-293,145,282.87

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	3,685,740,024.77	3,933,771,761.75
第二层次	204,700,272.47	137,244,034.96
第三层次	5,165,109.63	-
合计	3,895,605,406.87	4,071,015,796.71

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,534,688.61	1,534,688.61
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	3,630,421.02	3,630,421.02
其中：计入损益的利得或损失	-	3,630,421.02	3,630,421.02
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	5,165,109.63	5,165,109.63
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	3,630,421.02	3,630,421.02
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	3,383,270.11	3,383,270.11
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,732,917.82	2,732,917.82
当期利得或损失总额	-	-650,352.29	-650,352.29
其中：计入损益的利得或损失	-	-650,352.29	-650,352.29
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：1.本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

2.计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	5,165,109.63	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.00%-295.88%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	3,877,496,864.40	88.50
	其中：股票	3,877,496,864.40	88.50
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,108,542.47	0.41
	其中：债券	18,108,542.47	0.41
	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	51,416,000.00	1.17
	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	432,550,142.57	9.87
8	其他各项资产	1,748,668.80	0.04
9	合计	4,381,320,218.24	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 581,444,822.12 元，占基金资产净值的比例为 13.57%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	78,302,684.99	1.83
C	制造业	2,741,097,911.03	63.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	71,334,720.00	1.66
F	批发和零售业	37,963,933.34	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,528,909.52	5.64
J	金融业	14,747,407.52	0.34
K	房地产业	281.52	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	111,076,194.36	2.59
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	3,296,052,042.28	76.90

8.2.2 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	116,591,702.09	2.72
非必需消费品	283,034,753.38	6.60
必需消费品	56,352,988.70	1.31
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	115,595,066.56	2.70

工业	-	-
信息技术	9,870,311.39	0.23
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	581,444,822.12	13.57

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

8.3 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	688617	惠泰医疗	915,016	222,595,942.32	5.19
2	688012	中微公司	657,592	186,591,730.00	4.35
3	600079	ST 人福	10,189,800	184,537,278.00	4.31
4	300750	宁德时代	491,300	180,434,838.00	4.21
5	002353	杰瑞股份	2,415,206	171,069,040.98	3.99
6	09988	阿里巴巴-W	1,317,500	169,930,907.58	3.96
7	002271	东方雨虹	11,219,349	152,470,952.91	3.56
8	688696	极米科技	1,327,071	147,941,875.08	3.45
9	002273	水晶光电	5,879,800	147,700,576.00	3.45
10	002738	中矿资源	1,803,540	141,668,067.00	3.31
11	002410	广联达	10,729,595	134,978,305.10	3.15
12	00700	腾讯控股	215,500	116,591,702.09	2.72
13	000423	东阿阿胶	2,363,364	115,993,905.12	2.71
14	300012	华测检测	8,195,647	111,051,016.85	2.59
15	06160	百济神州	654,500	105,994,537.96	2.47
16	688548	广钢气体	5,493,643	79,877,569.22	1.86
17	000425	徐工机械	6,687,900	77,445,882.00	1.81
18	601886	江河集团	8,742,000	71,334,720.00	1.66
19	00175	吉利汽车	4,299,000	69,504,675.76	1.62
20	603486	科沃斯	852,711	68,796,723.48	1.61
21	688361	中科飞测	447,009	68,387,906.91	1.60
22	603986	兆易创新	305,300	65,410,525.00	1.53
23	688484	南芯科技	1,304,755	53,051,338.30	1.24
24	600547	山东黄金	1,351,037	52,298,642.27	1.22
25	688123	聚辰股份	400,889	50,343,640.62	1.17
26	688041	海光信息	220,038	49,378,727.58	1.15
27	600487	亨通光电	1,893,600	46,828,728.00	1.09
28	300285	国瓷材料	1,666,224	45,671,199.84	1.07
29	605499	东鹏饮料	169,600	45,349,344.00	1.06
30	300836	佰奥智能	824,050	45,240,345.00	1.06
31	688630	芯碁微装	331,377	44,580,147.81	1.04

32	300772	运达股份	2,178,100	41,514,586.00	0.97
33	603939	益丰药房	1,747,202	37,949,227.44	0.89
34	688593	新相微	1,702,478	34,356,006.04	0.80
35	002240	盛新锂能	943,500	32,484,705.00	0.76
36	00179	德昌电机控股	1,137,500	30,534,706.93	0.71
37	300308	中际旭创	46,800	28,548,000.00	0.67
38	01318	毛戈平	373,600	27,569,092.45	0.64
39	300677	英科医疗	705,800	27,455,620.00	0.64
40	002126	银轮股份	724,000	27,367,200.00	0.64
41	000534	万泽股份	1,207,700	26,569,400.00	0.62
42	689009	九号公司	401,847	22,338,674.73	0.52
43	688766	普冉股份	158,649	20,181,739.29	0.47
44	688019	安集科技	91,789	20,002,658.88	0.47
45	06969	思摩尔国际	1,815,000	19,524,590.61	0.46
46	603019	中科曙光	201,400	17,247,896.00	0.40
47	000975	山金国际	689,400	16,773,102.00	0.39
48	688385	复旦微电	203,411	14,991,390.70	0.35
49	600036	招商银行	350,280	14,746,788.00	0.34
50	688775	影石创新	62,397	14,657,055.30	0.34
51	002475	立讯精密	252,400	14,313,604.00	0.33
52	000703	恒逸石化	1,302,900	14,032,233.00	0.33
53	00425	敏实集团	456,000	13,064,463.11	0.30
54	603816	顾家家居	420,128	12,914,734.72	0.30
55	01888	建滔积层板	828,500	9,870,311.39	0.23
56	688213	思特威	101,339	9,636,325.51	0.22
57	688256	寒武纪	6,989	9,473,938.95	0.22
58	300394	天孚通信	46,100	9,359,683.00	0.22
59	09858	优然牧业	2,018,000	9,259,305.64	0.22
60	601899	紫金矿业	264,800	9,127,656.00	0.21
61	688362	甬矽电子	240,683	7,800,536.03	0.18
62	01801	信达生物	104,000	7,162,534.60	0.17
63	688322	奥比中光	76,632	6,871,591.44	0.16
64	300395	菲利华	55,000	5,516,500.00	0.13
65	002463	沪电股份	73,300	5,356,031.00	0.12
66	688249	晶合集成	153,081	5,080,758.39	0.12
67	600522	中天科技	272,100	4,930,452.00	0.12
68	688795	摩尔线程	10,828	4,504,664.56	0.11
69	603799	华友钴业	64,500	4,402,770.00	0.10
70	688008	澜起科技	36,511	4,300,995.80	0.10
71	300870	欧陆通	14,703	3,249,363.00	0.08
72	603228	景旺电子	44,200	3,230,578.00	0.08
73	002938	鹏鼎控股	60,800	3,075,264.00	0.07
74	02162	康诺亚-B	50,500	2,437,994.00	0.06

75	301656	联合动力	7,395	188,276.70	0.00
76	001280	中国铀业	2,277	103,284.72	0.00
77	688729	屹唐股份	3,505	85,101.40	0.00
78	688809	强一股份	259	52,657.29	0.00
79	301638	南网数字	2,322	32,995.62	0.00
80	688727	恒坤新材	563	19,631.81	0.00
81	688796	百奥赛图	423	17,871.75	0.00
82	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
83	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.00
84	301491	汉桑科技	245	13,501.95	0.00
85	001369	双欣环保	897	11,562.33	0.00
86	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
87	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
88	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
89	603418	友升股份	139	8,209.34	0.00
90	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
91	603092	德力佳	146	8,126.36	0.00
92	001285	瑞立科密	137	7,682.96	0.00
93	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
94	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
95	603406	天富龙	153	6,144.48	0.00
96	603262	技源集团	155	4,355.50	0.00
97	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
98	001388	信通电子	94	4,036.36	0.00
99	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
100	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
101	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
102	601128	常熟银行	88	619.52	0.00
103	600383	金地集团	92	281.52	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	00700	腾讯控股	264,435,811.64	6.04
2	09988	阿里巴巴-W	248,552,744.27	5.68
3	300750	宁德时代	214,627,177.20	4.90
4	01810	小米集团-W	190,915,166.80	4.36
5	002410	广联达	189,033,901.95	4.32
6	688012	中微公司	184,947,975.20	4.22
7	02015	理想汽车-W	181,980,316.37	4.16
8	603486	科沃斯	168,347,402.48	3.84
9	688696	极米科技	162,640,913.61	3.71
10	688213	思特威	160,702,396.34	3.67

11	300274	阳光电源	147,798,786.34	3.38
12	002271	东方雨虹	146,821,184.73	3.35
13	03690	美团-W	144,572,356.15	3.30
14	002273	水晶光电	133,570,138.66	3.05
15	00981	中芯国际	130,740,321.64	2.99
16	002738	中矿资源	112,169,722.33	2.56
17	01347	华虹半导体	110,623,749.62	2.53
18	06160	百济神州	110,160,495.85	2.52
19	002444	巨星科技	88,631,356.00	2.02
20	00175	吉利汽车	87,037,953.88	1.99

8.4.2 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	600036	招商银行	278,648,525.85	6.36
2	00981	中芯国际	272,917,607.28	6.23
3	01810	小米集团-W	233,136,625.98	5.32
4	688050	爱博医疗	214,494,571.40	4.90
5	300285	国瓷材料	202,135,004.64	4.62
6	000423	东阿阿胶	196,611,636.91	4.49
7	002475	立讯精密	195,342,333.63	4.46
8	300274	阳光电源	193,997,956.84	4.43
9	300012	华测检测	192,819,965.00	4.40
10	300124	汇川技术	185,494,735.35	4.24
11	603486	科沃斯	181,995,028.80	4.16
12	02015	理想汽车-W	180,331,125.99	4.12
13	603195	公牛集团	170,608,420.70	3.90
14	09988	阿里巴巴-W	163,349,502.06	3.73
15	00700	腾讯控股	161,889,549.00	3.70
16	688052	纳芯微	161,644,597.52	3.69
17	688213	思特威	161,342,158.56	3.68
18	300760	迈瑞医疗	154,642,735.60	3.53
19	300750	宁德时代	154,261,581.00	3.52
20	01347	华虹半导体	149,269,475.26	3.41
21	002353	杰瑞股份	128,136,097.53	2.93
22	00175	吉利汽车	121,114,869.21	2.77
23	03690	美团-W	120,982,671.42	2.76
24	002444	巨星科技	119,762,683.42	2.73
25	603920	世运电路	95,549,043.12	2.18
26	603939	益丰药房	95,469,112.21	2.18
27	002384	东山精密	90,635,018.09	2.07

8.4.3 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	5,994,021,280.39

卖出股票收入（成交）总额	6,880,527,507.84

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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。

8.5 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	18,108,542.47	0.42
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	18,108,542.47	0.42

8.6 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	180,000	18,108,542.47	0.42

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 只债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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，人福医药集团股份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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,199,005.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	391,214.94
4	应收利息	-
5	应收申购款	158,448.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,748,668.80

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 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	688012	中微公司	186,591,730.00	4.35	重大事项停牌

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
嘉实核心成长混合 A	142,395	40,130.93	12,150,566.18	0.21	5,702,292,517.25	99.79
嘉实核心成长混合 C	12,736	28,602.29	271,623.69	0.07	364,007,139.25	99.93
合计	153,444	39,615.25	12,422,189.87	0.20	6,066,299,656.50	99.80

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）。

9.2 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（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实核心成长混合 A	617,802.21	0.01
	嘉实核心成长混合 C	132,264.61	0.04
	合计	750,066.82	0.01

9.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实核心成长混合 A	10~50
	嘉实核心成长混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实核心成长混合 A	0
	嘉实核心成长混合 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实核心成长混合 A	嘉实核心成长混合 C
基金合同生效日（2020 年 10 月 28	14,148,927,621.88	688,562,805.48

日）基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	6,987,259,123.84	467,197,154.55
本报告期基金总申购份额	127,146,384.18	25,174,128.78
减：本报告期基金总赎回份额	1,399,962,424.59	128,092,520.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,714,443,083.43	364,278,762.94

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。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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

2025 年 5 月 22 日本基金管理人发布公告，刘伟先生任公司首席信息官、杨竞霜先生离任公司副总经理、首席信息官。

2025 年 7 月 5 日本基金管理人发布公告，李明先生离任财务负责人，经雷先生任财务负责人（兼）。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

2025 年 9 月，中国农业银行总行决定蔡崎峰任托管业务部总裁。

11.3 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、本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）更换为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费为 55,000.00 元，该审计机构第 1 年提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 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	2025 年 11 月 3 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京证监局
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	责令改正并暂停受理固定收益类公募基金产品注册 3 个月
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控、投资运作、公司治理
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运作管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货投资者适当性管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司子公司管理规定》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截至报告期末，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完成整改，并向北京证监局提交了整改完成情况报告。
其他	-

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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(%)	
申万宏源证券有限	2	3,725,977,752.05	28.95	1,791,337.38	30.56	-

公司						
国泰海通证券股份有限公司	4	2,692,265,664.72	20.92	1,193,792.04	20.37	-
开源证券股份有限公司	1	1,822,250,168.98	14.16	794,528.34	13.56	-
广发证券股份有限公司	2	1,811,677,987.71	14.08	844,158.12	14.40	-
中信证券股份有限公司	4	1,073,144,940.70	8.34	473,242.82	8.07	-
华泰证券股份有限公司	1	931,075,981.30	7.23	405,863.19	6.92	-
中信建投证券股份有限公司	2	368,089,209.71	2.86	160,443.03	2.74	-
长江证券股份有限公司	2	362,842,318.84	2.82	162,241.95	2.77	-
国盛证券股份有限公司	1	82,017,922.05	0.64	35,748.51	0.61	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-

股份有限公司						
上海证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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。

3.国泰君安证券股份有限公司于 2025 年 3 月 14 日完成吸收合并海通证券股份有限公司，并自 2025 年 4 月 3 日起更名为国泰海通证券股份有限公司。上表中列示的国泰海通证券股份有限公司相关数据包含了被合并后的海通证券股份有限公司相关数据。

11.7.2 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(%)
申万宏源证券有限公司	-	-	516,995,000.00	4.34	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	1,832,306,000.00	15.38	-	-

开源证券股份有限公司	-	-	5,526,411,000.00	46.38	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	554,155,000.00	4.65	-	-
中信证券股份有限公司	18,007,386.00	50.02	456,048,000.00	3.83	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	1,809,356,000.00	15.19	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	894,486,000.00	7.51	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	233,333,000.00	1.96	-	-
国盛证券股份有限公司	17,995,140.00	49.98	91,258,000.00	0.77	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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 2025 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 2 月 21 日
2	关于新增嘉实核心成长混合基金经理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 6 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 22 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 5 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 25 日

§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核心成长混合型证券投资基金注册的批复文件；

（2）《嘉实核心成长混合型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实核心成长混合型证券投资基金托管协议》；

（4）《嘉实核心成长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）报告期内嘉实核心成长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 3 月 30 日