

嘉实润泽量化一年定期开放混合型证券投资
基金
2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 07 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 04 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	嘉实润泽量化定期混合
基金主代码	005167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
报告期末基金份额总额	17,224,466.44 份
投资目标	本基金通过量化选股和主动债券投资相结合的投资策略，在严格控制投资组合风险的前提下，追求资产净值的长期稳健增值。
投资策略	（一）封闭期投资策略：本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充足的宏观形势判断和策略分析的基础上，采用动态调整策略，在市场上涨阶段中，适当增加权益类资产配置比例，在市场下行周期中，适当降低权益类资产配置比例，力求实现基金财产的长期稳定增值，从而有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略。 （二）开放期投资策略：开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债总财富（总值）指数收益率×70%+中证 500 指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市

	场基金，低于股票型基金，属于中高风险、中高收益的品种。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日）
1. 本期已实现收益	2,029,754.89
2. 本期利润	4,576,733.57
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2323
4. 期末基金资产净值	24,738,589.07
5. 期末基金份额净值	1.4362

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。

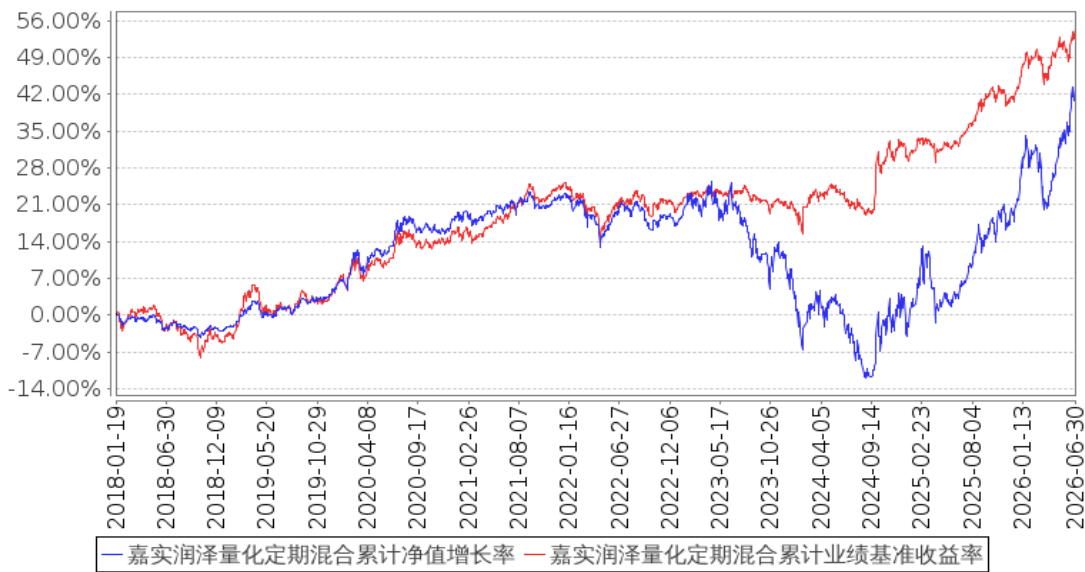
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	19.31%	0.78%	6.28%	0.50%	13.03%	0.28%
过去六个月	17.96%	1.03%	7.70%	0.50%	10.26%	0.53%
过去一年	35.08%	0.89%	15.20%	0.43%	19.88%	0.46%
过去三年	18.69%	1.04%	25.23%	0.43%	-6.54%	0.61%
过去五年	18.64%	0.86%	29.56%	0.40%	-10.92%	0.46%
过去七年	42.17%	0.75%	52.15%	0.40%	-9.98%	0.35%
自基金合同 生效起至今	43.62%	0.69%	54.34%	0.41%	-10.72%	0.28%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

嘉实润泽量化定期混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2018年01月19日至2026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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赖礼辉	本基金、嘉实新起点混合、嘉实新趋势混合、嘉实安益混合、嘉实稳宏债券、嘉实新添丰定期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实多盈债券、嘉实	2025 年 1 月 3 日	-	19 年	曾任长城证券有限责任公司金融研究所股票行业研究员、瑞银证券有限责任公司财富管理部证券分析师，2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司固定收益部，历任信用研究员、投资经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	稳健添翼 一年持有 混合、嘉 实稳健增 利 6 个月 持有混合 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、《嘉实润泽量化一年定期开放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 公平交易专项说明

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 2 次，其中 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度海外地缘冲突开始缓和，国内内需偏弱，AI 叙事一枝独秀，权益资产极度分化，债券略显平淡。组合根据市场状态调整了投资策略，二季度权益以科技板块为主，债券低仓位，整体

收益相对较好。

美伊战争导致原油价格大涨，体现在 4 月份的通胀数据上，全球通胀上行，欧洲和日本央行加息，美联储加息预期上升。在海外无风险利率纷纷上行时，国内利率非常稳定，10 年国债利率小幅上行后再次回落，一方面由于国内央行维持宽松的金融市场流动性，另一方面由于二季度内需走弱，经济基本面承压。二季度债券市场收益率曲线小幅平坦化下移，中短端收益率一度创新低，超长端利率相对较克制，主要反映国内长期通胀的修复。本组合二季度债券仍低配，我们低估了 5-10 年信用债的下行空间，主要是对低位的长端信用债利率是否合理定价国内经济转型期名义增速存在顾虑。

4 月之后国内权益市场的最大变化是 AI 相关的科技板块一枝独秀，特别是 5 月以来，其他大部分行业单边下跌。这种分化从景气投资的角度来说有其合理性：AI 硬件投资短期确实体现在了算力、存储，以及相关上游的半导体、设备、各种材料等行业景气度上升，部分环节因供不应求出现了价格大涨，相关公司中短期盈利有望大幅增长。而主要与内需相关的其他很多传统行业因成本上行和需求低迷，业绩承压。但到了 6 月份市场极致演绎，部分透支了中长期市值空间，而对部分业绩增长不错的传统产业明显是错杀。本组合二季度权益资产主要增加了电子半导体、光纤光缆、小金属、电子化工品等科技相关板块配置，减持了化工、有色、电力设备等板块，在二季度后期由于担心市场过于乐观，适当降低了股票仓位。5 月份组合小幅加仓转债，虽然转债整体估值仍高位，但高价转债估值调整较为到位。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4362 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.31%，业绩比较基准收益率为 6.28%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

在迷你基金期间，由本基金管理人承担本基金信息披露费、审计费等费用。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,280,922.04	29.37
	其中：股票	7,280,922.04	29.37
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	9,150,391.25	36.91
	其中：债券	9,150,391.25	36.91
	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	7,000,000.00	28.24
	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	1,333,290.39	5.38
8	其他资产	25,188.59	0.10
9	合计	24,789,792.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	280,085.00	1.13
C	制造业	6,041,363.32	24.42
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	—	—
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	895,671.72	3.62
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	63,802.00	0.26
	合计	7,280,922.04	29.43

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688498	源杰科技	740	1,395,640.00	5.64
2	002281	光迅科技	5,000	1,284,700.00	5.19
3	603986	兆易创新	1,000	815,000.00	3.29
4	600498	烽火通信	7,000	515,200.00	2.08
5	688256	寒武纪	296	472,282.80	1.91
6	688002	睿创微纳	3,000	464,070.00	1.88
7	688008	澜起科技	1,295	401,320.50	1.62
8	688012	中微公司	738	345,753.00	1.40
9	300502	新易盛	560	339,920.00	1.37
10	688368	晶丰明源	1,051	227,562.52	0.92

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,005,550.14	4.06
2	央行票据	—	—
3	金融债券	4,084,549.91	16.51
	其中：政策性金融债	2,019,367.12	8.16
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）	4,060,291.20	16.41
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	9,150,391.25	36.99

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	242580034	25 成都银行永续债 01	20,000	2,065,182.79	8.35
2	09240202	24 国开清发 02	20,000	2,019,367.12	8.16
3	019761	24 国债 24	10,000	1,005,550.14	4.06
4	123224	宇邦转债	2,130	280,062.61	1.13
5	118053	正帆转债	790	172,079.42	0.70

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资

明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，国家开发银行、成都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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,068.58
2	应收证券清算款	17,120.01
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	25,188.59

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	123224	宇邦转债	280,062.61	1.13
2	118053	正帆转债	172,079.42	0.70
3	118058	微导转债	70,923.35	0.29
4	118061	茂莱转债	29,023.20	0.12
5	123213	天源转债	24,688.07	0.10
6	123258	胜蓝转 02	24,541.62	0.10
7	118011	银微转债	21,964.60	0.09
8	123176	精测转 2	21,491.11	0.09
9	123251	华医转债	21,119.79	0.09
10	123158	宙邦转债	20,859.58	0.08
11	123259	锦浪转 02	20,570.29	0.08
12	118051	皓元转债	20,481.89	0.08
13	118060	瑞可转债	20,233.63	0.08
14	111024	澳弘转债	20,128.74	0.08
15	123178	花园转债	19,889.36	0.08
16	113681	镇洋转债	19,633.89	0.08
17	127040	国泰转债	19,553.01	0.08
18	123124	晶瑞转 2	19,534.62	0.08
19	113625	江山转债	19,461.86	0.08
20	118031	天 23 转债	19,413.39	0.08
21	113667	春 23 转债	19,380.51	0.08
22	127055	精装转债	19,247.64	0.08
23	113649	丰山转债	19,096.13	0.08
24	110084	贵燃转债	19,095.57	0.08
25	127068	顺博转债	18,933.41	0.08
26	123092	天壕转债	18,870.38	0.08
27	127070	大中转债	18,828.77	0.08
28	118012	微芯转债	18,805.05	0.08

29	118015	芯海转债	18,760.15	0.08
30	113680	丽岛转债	18,742.06	0.08
31	118062	天准转债	18,721.09	0.08
32	127031	洋丰转债	18,647.93	0.08
33	123122	富瀚转债	18,572.71	0.08
34	123165	回天转债	18,566.87	0.08
35	118005	天奈转债	18,526.73	0.07
36	110098	南药转债	18,503.08	0.07
37	118035	国力转债	18,480.30	0.07
38	118050	航宇转债	18,422.12	0.07
39	113636	甬金转债	18,410.82	0.07
40	127104	姚记转债	18,330.53	0.07
41	127089	晶澳转债	18,302.65	0.07
42	127038	国微转债	18,300.37	0.07
43	113658	密卫转债	18,295.79	0.07
44	127064	杭氧转债	18,274.76	0.07
45	123262	神宇转债	18,240.11	0.07
46	113627	太平转债	18,211.96	0.07
47	123150	九强转债	18,199.31	0.07
48	123195	蓝晓转 02	18,197.51	0.07
49	118024	冠宇转债	18,187.67	0.07
50	113661	福 22 转债	18,185.25	0.07
51	118040	宏微转债	18,161.81	0.07
52	113666	爱玛转债	18,100.62	0.07
53	123114	三角转债	18,084.26	0.07
54	123113	仙乐转债	18,073.60	0.07
55	113699	金 25 转债	18,040.10	0.07
56	123179	立高转债	18,021.21	0.07
57	123214	东宝转债	18,018.59	0.07
58	123172	漱玉转债	18,016.73	0.07
59	113652	伟 22 转债	18,002.73	0.07
60	127085	韵达转债	17,970.95	0.07
61	113679	芯能转债	17,955.53	0.07
62	118036	力合转债	17,941.28	0.07
63	113638	台 21 转债	17,934.89	0.07
64	123119	康泰转 2	17,921.22	0.07
65	123117	健帆转债	17,917.61	0.07
66	127105	龙星转债	17,892.42	0.07
67	113058	友发转债	17,884.57	0.07
68	123211	阳谷转债	17,879.30	0.07
69	123133	佩蒂转债	17,879.02	0.07
70	113059	福莱转债	17,870.35	0.07

71	123223	九典转 02	17,868.68	0.07
72	113695	华辰转债	17,866.76	0.07
73	111020	合顺转债	17,832.31	0.07
74	111009	盛泰转债	17,817.88	0.07
75	123250	嘉益转债	17,801.54	0.07
76	113650	博 22 转债	17,795.40	0.07
77	123194	百洋转债	17,785.10	0.07
78	113659	莱克转债	17,776.47	0.07
79	118037	上声转债	17,772.87	0.07
80	127102	浙建转债	17,771.58	0.07
81	113670	金 23 转债	17,760.99	0.07
82	111014	李子转债	17,760.92	0.07
83	127069	小熊转债	17,756.58	0.07
84	118052	浩瀚转债	17,730.24	0.07
85	113640	苏利转债	17,724.25	0.07
86	123160	泰福转债	17,691.18	0.07
87	113674	华设转债	17,681.46	0.07
88	123183	海顺转债	17,679.84	0.07
89	113686	泰瑞转债	17,675.87	0.07
90	113633	科沃转债	17,674.55	0.07
91	123229	艾录转债	17,654.02	0.07
92	113648	巨星转债	17,641.56	0.07
93	127046	百润转债	17,640.69	0.07
94	111002	特纸转债	17,633.04	0.07
95	123235	亿田转债	17,629.30	0.07
96	118022	锂科转债	17,625.70	0.07
97	123109	昌红转债	17,601.79	0.07
98	111003	聚合转债	17,572.83	0.07
99	127111	金威转债	17,562.87	0.07
100	123199	山河转债	17,550.32	0.07
101	123220	易瑞转债	17,545.76	0.07
102	113692	保隆转债	17,541.97	0.07
103	113671	武进转债	17,540.64	0.07
104	113655	欧 22 转债	17,526.74	0.07
105	123151	康医转债	17,503.50	0.07
106	123180	浙矿转债	17,500.67	0.07
107	123209	聚隆转债	17,456.52	0.07
108	127108	太能转债	17,445.86	0.07
109	123154	火星转债	17,445.74	0.07
110	123193	海能转债	17,424.36	0.07
111	110090	爱迪转债	17,420.09	0.07
112	127059	永东转 2	17,414.35	0.07

113	113693	志邦转债	17,406.76	0.07
114	113624	正川转债	17,384.50	0.07
115	113656	嘉诚转债	17,384.42	0.07
116	127067	恒逸转 2	17,346.51	0.07
117	113046	金田转债	17,339.76	0.07
118	113647	禾丰转债	17,337.92	0.07
119	127030	盛虹转债	17,322.41	0.07
120	127072	博实转债	17,310.43	0.07
121	123149	通裕转债	17,264.44	0.07
122	113634	珀莱转债	17,260.43	0.07
123	113682	益丰转债	17,234.12	0.07
124	123215	铭利转债	17,201.47	0.07
125	113643	风语转债	17,196.35	0.07
126	123168	惠云转债	17,188.26	0.07
127	127062	垒知转债	17,184.49	0.07
128	118034	晶能转债	17,179.01	0.07
129	123263	鼎捷转债	17,173.61	0.07
130	111021	奥锐转债	17,170.15	0.07
131	123192	科思转债	17,168.16	0.07
132	118032	建龙转债	17,166.53	0.07
133	127099	盛航转债	17,160.48	0.07
134	113694	清源转债	17,151.91	0.07
135	118010	洁特转债	17,120.86	0.07
136	110097	天润转债	17,107.22	0.07
137	118044	赛特转债	17,104.38	0.07
138	113631	皖天转债	17,077.73	0.07
139	113691	和邦转债	17,021.95	0.07
140	127054	双箭转债	17,021.53	0.07
141	118042	奥维转债	17,019.58	0.07
142	127060	湘佳转债	17,015.40	0.07
143	123237	佳禾转债	17,002.97	0.07
144	123252	银邦转债	16,974.41	0.07
145	111004	明新转债	16,945.54	0.07
146	123187	超达转债	16,919.95	0.07
147	113696	伯 25 转债	16,900.00	0.07
148	127095	广泰转债	16,895.87	0.07
149	111000	起帆转债	16,880.99	0.07
150	110099	福能转债	16,850.93	0.07
151	111018	华康转债	16,847.55	0.07
152	127082	亚科转债	16,812.22	0.07
153	123243	严牌转债	16,800.17	0.07
154	123261	普联转债	16,778.54	0.07

155	113660	寿 22 转债	16,776.62	0.07
156	123225	翔丰转债	16,774.85	0.07
157	111017	蓝天转债	16,749.79	0.07
158	113646	永吉转债	16,723.05	0.07
159	127044	蒙娜转债	16,722.79	0.07
160	110087	天业转债	16,691.02	0.07
161	127078	优彩转债	16,686.61	0.07
162	123155	中陆转债	16,615.86	0.07
163	113054	绿动转债	16,602.19	0.07
164	123216	科顺转债	16,590.01	0.07
165	111022	锡振转债	16,566.15	0.07
166	113698	凯众转债	16,560.03	0.07
167	118013	道通转债	16,536.70	0.07
168	123253	永贵转债	16,533.17	0.07
169	113678	中贝转债	16,496.78	0.07
170	127098	欧晶转债	16,465.96	0.07
171	113632	鹤 21 转债	16,441.39	0.07
172	127050	麒麟转债	16,436.59	0.07
173	113048	晶科转债	16,433.62	0.07
174	123222	博俊转债	16,267.76	0.07
175	123189	晓鸣转债	16,190.11	0.07
176	123257	安克转债	16,159.35	0.07
177	113688	国检转债	16,098.64	0.07
178	118039	煜邦转债	15,837.40	0.06
179	123131	奥飞转债	15,822.04	0.06
180	123247	万凯转债	15,762.57	0.06
181	113677	华懋转债	15,521.42	0.06
182	113673	岱美转债	15,506.62	0.06
183	123144	裕兴转债	15,404.36	0.06
184	127092	运机转债	15,360.02	0.06
185	123188	水羊转债	15,332.59	0.06
186	118030	睿创转债	15,285.65	0.06
187	127096	泰坦转债	14,544.12	0.06
188	123245	集智转债	14,472.09	0.06
189	123241	欧通转债	12,519.97	0.05
190	123118	惠城转债	12,330.14	0.05
191	111012	福新转债	11,757.69	0.05

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	28,281,122.48
报告期期间基金总申购份额	338,296.56
减：报告期期间基金总赎回份额	11,394,952.60
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	17,224,466.44

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予嘉实润泽量化一年定期开放混合型证券投资基金注册的批复文件；
- （2）《嘉实润泽量化一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》；
- （3）《嘉实润泽量化一年定期开放混合型证券投资基金托管协议》；
- （4）《嘉实润泽量化一年定期开放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）报告期内嘉实润泽量化一年定期开放混合型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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
第 15 页 共 16 页

9.3 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 7 月 21 日