

嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资
基金（QDII）
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
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
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	39
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	39
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	39
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	51

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	51
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	51
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	51
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	51
7.11 投资组合报告附注.....	52
§ 8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	53
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	53
§ 9 开放式基金份额变动.....	53
§ 10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	55
10.8 其他重大事件.....	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
§ 12 备查文件目录.....	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）
基金简称	嘉实全球产业精选混合发起式（QDII）
基金主代码	019075
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2023 年 11 月 13 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,079,188.41 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金份额含人民币份额(份额代码:019075)及美元现汇份额(份额代码:019076)。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过在严格控制投资组合风险的前提下，积极主动的资产管理，通过对优势产业和优势个股的研究与精选，力争获取长期资本增值。
投资策略	本基金主要投资策略包括：1、资产配置策略：强调自上而下的配置策略，依托大类资产配置方法，综合分析全球不同国家、不同地区的政经形势、经济结构特征、地区及产业竞争优势和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，基于股票市场、固定收益产品以及货币市场工具的相对比价策略动态配置组合资产，结合纪律性的风险管理策略，力争持续优化组合状态并持有性价比更高的资产。2、股票投资策略：基于宏观研究，行业中观研究和微观企业基本面研究相结合的系统化投资策略，通过对全球主要经济体在不同发展阶段的产业趋势变化的研究构建符合区域变迁和行业变迁趋势的股票组合。从全球宏观环境、各国经济周期、行业景气度、成长、营运质量、动量、流动性等多维度刻画股票特征，以实业投资的心态考量公司长期发展前景，核心策略是投资于具有中长期发展优势和商业模式优势的产业，同时选取具有核心竞争优势且能实现中长期可持续发展的优质企业。3、固定收益投资策略：采取“自上而下”的策略，通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，实施积极的债券投资组合管理。4、衍生品投资策略：为有利于基金资金的风险管理及流动性管理，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。5、资产支持证券投资策略：综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后的收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。6、

	融资策略：为更好地实现投资目标，在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与融资业务。
业绩比较基准	MSCI 全球指数（MSCI All Country World Index）收益率×35%+沪深 300 指数收益率×35%+中债综合指数收益率×25%+境内银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于混合型基金产品，预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资境外市场，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、国家/地区风险等境外投资面临的特有风险。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	郭松	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66596688
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-600-8800	95566
传真		(010)65215588	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		100020	100818
法定代表人		经雷	葛海蛟

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	—	JP Morgan Chase Bank, National Association
	中文	—	摩根大通银行
注册地址		—	1111 Polaris Parkway, Columbus, OH 43240, U.S.A.
办公地址		—	383 Madison Avenue, New York, NY 10179-0001, U.S.A.
邮政编码		—	10179

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写 字楼 12A 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,506,268.21
本期利润	7,151,846.75
加权平均基金份额本期利 润	0.3572
本期加权平均净值利润率	26.73%
本期基金份额净值增长率	29.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	5,619,359.96
期末可供分配基金份额利 润	0.2435
期末基金资产净值	35,532,185.37
期末基金份额净值	1.5396
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	53.96%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净 值增长 率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	25.84%	1.44%	9.50%	0.68%	16.34%	0.76%
过去六个月	29.63%	1.44%	6.96%	0.61%	22.67%	0.83%
过去一年	36.79%	1.31%	17.32%	0.51%	19.47%	0.80%
自基金合同生效 起至今	53.96%	1.29%	40.16%	0.55%	13.80%	0.74%

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：

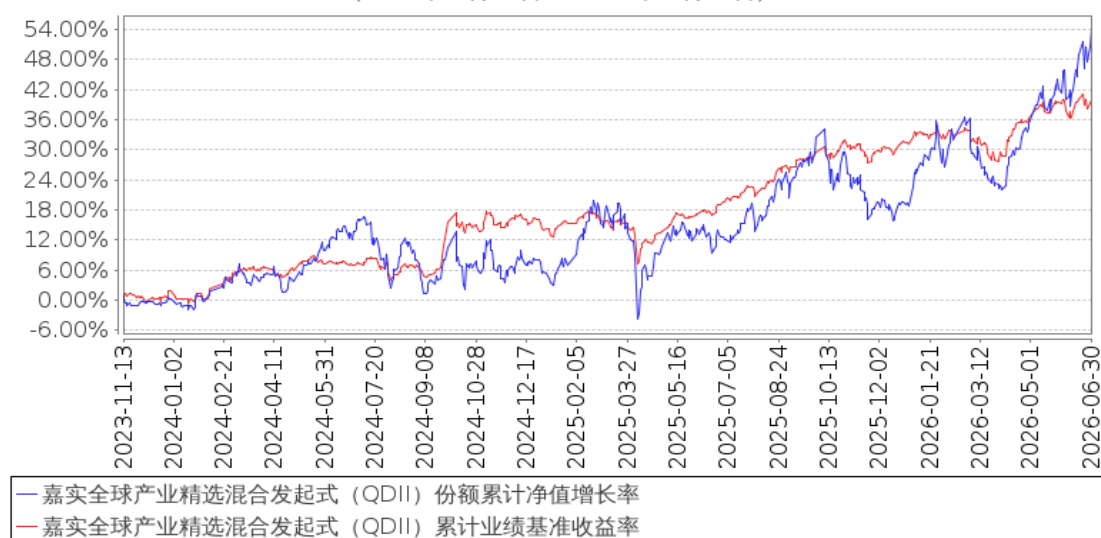
$$\text{Return}(t) = (\text{MSCI 全球指数}(t) / \text{MSCI 全球指数}(t-1) - 1) \times 35\% + (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) \times 35\% + (\text{中债综合指数}(t) / \text{中债综合指数}(t-1) - 1) \times 25\% + ((1 + \text{境内银行活期存款利率(税后)})^{(1/365)} - 1) \times 5\%$$

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

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

嘉实全球产业精选混合发起式（QDII）份额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
(2023年11月13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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1999]5 号文批准，于 1999 年 3 月 25 日成立。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务等资格。

截止 2026 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 385 只公募基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF、不动产基金等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张琴	本基金、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实全球价值股票（QDII）基金经理	2023 年 11 月 13 日	-	18 年	曾任职于摩根大通、苏格兰皇家银行、东方汇理证券（亚洲）股票研究部，覆盖科技、电信、中小盘等行业。2014 年 6 月至 2022 年 7 月任瑞士百达资产管理公司绝对收益部资深投资经理。2022 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司多策略解决方案战队。硕士研究生，具有基金从业资格。中国香港籍。
韩同利	本基金基金经理	2023 年 11 月 13 日	2026 年 2 月 25 日	25 年	曾任中国银行总行和香港分行交易员、组合投资经理，PIMCO 美国基金经理，复星集团固定收益首席投资官、复星国际资产管理公司 CEO，深蓝全球资产管理有限公司首席投资官等职。2021 年 8 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任公司多策略解决方案战队负责人，多策略（Total Return Strategy）CIO。现任嘉实国际资产管理有限公司首席执行官兼首席投资官。纽约大学斯特恩商学院工商管理硕士，CFA，具有基金从业资格。中国香港籍。

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、《嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 3 次，其中 2 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，1 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金立足以实业投资的心态考量行业和企业长期发展前景。深入分析企业核心竞争力，注重标的独特和稀缺性。关注企业估值的合理性，要求买入价格具有一定的安全边际。考虑到流动性、地缘政治、治理结构等因素，本基金重点投资的区域为以中美为主的资本市场活跃的大经济体。本基金重点参与的结构趋势：1) 科技革命和产业变革加速演进；尤其作为核心资源的能源和算力呈现相互支撑、协同发展之势。2) 全球供应链多元化驱动全球资本重新配置。3) 中国经济进入高质量发展阶段，致力于产业升级，建设开放型世界经济。本基金自 2024 年第四季度起以中国股票为主，美国股票为辅；2026 年上半年保持了这一区域配置。从行业配置角度，2026 年六月末前五大行业配置在信息技术、能源、通信服务、原材料和工业。

本基金为偏股混合型基金，债券配置比例在建仓完成后至今均低于中枢水平。在坚持主线投资的同时，本基金将择机对股债配置比例进行动态调整。同时基于控制风险、锁定收益、套期保值等目的，本基金将择机合理利用衍生工具谨慎进行投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.5396 元；本报告期基金份额净值增长率为 29.63%，业绩比较基准收益率为 6.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

总体而言，全球流动性风险仍在可控范围内。美联储今年加息的可能性较低。美国核心通胀

已见顶，其同比增速预计将从第三季度开始逐步回落。不过美联储取消前瞻性指引将推高市场波动率及美国国债期限溢价；此外美元走强可能会使非美市场面临阶段性压力。

人工智能技术革命的势头依然强劲。尽管存在短期波动，但在 2026 年之前发生人工智能“泡沫破裂”的可能性依然较低。底层算力、标准化推理词元正在走向大宗商品化，投资者目前正热议哪些人工智能服务将走向全球市场。美国和中国在前沿模型、硬件及全球科技治理领域占据主导地位，是该领域的两大巨头。其他国家也在积极开辟关键的细分市场，并构建稳健的本土人工智能生态系统。

美国经济的运行依赖于投资，尤其是对科技领域的投资。中国通过系统的战略规划旨在将中国的科技实力提升至新高度，并迈入高收入国家行列。这取决于两大关键因素：产业升级与历史遗留债务的化解。这种从旧增长引擎向新增长引擎的转型，为行业领军企业的涌现以及跨行业的结构性投资机遇创造了空间。外资在中国二级市场的配置水平目前处于历史偏低区间，我们注意到外资正积极调整其在内地与香港市场的资产配置——即从受宏观因素驱动的焦虑情绪，转向关注具有个股或特定行业特征的自下而上投资机会。人民币国际化及其可兑换性的提升，正为中国资产（涵盖股票与债券）在全球长期投资组合中占据更大份额铺平道路。

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

本基金为发起式基金，基金合同生效未满三年，不适用。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、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：嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,416,005.42	1,445,001.77
结算备付金		34,066.48	20,158.57
存出保证金		4,110.91	3,266.68
交易性金融资产	6.4.7.2	30,898,597.27	19,833,401.22
其中：股票投资		29,538,219.98	18,330,266.61
基金投资		1,360,377.29	1,503,134.61
债券投资		—	—
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		-	473,150.98
应收股利		31,415.86	60,336.22
应收申购款		586,438.91	36,196.90
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,156,049.59
资产总计		35,970,634.85	23,027,561.93
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		372,766.83	13,542.34
应付管理人报酬		31,157.71	22,153.85
应付托管费		5,192.94	3,692.30
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	29,332.00	1,190,246.11
负债合计		438,449.48	1,229,634.60
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	23,079,188.41	18,353,352.45
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	12,452,996.96	3,444,574.88
净资产合计		35,532,185.37	21,797,927.33
负债和净资产总计		35,970,634.85	23,027,561.93

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5396 元，基金份额总额 23,079,188.41 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		7,352,203.98	1,054,726.53
1. 利息收入		4,777.02	5,623.80
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,777.02	5,623.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		2,770,737.84	2,340.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,663,962.35	-18,881.57
基金投资收益	6.4.7.15	-49,620.17	-93,582.28
债券投资收益	6.4.7.16	-1,066.70	-
资产支持证券投 资收益	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	157,462.36	114,804.49
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.21	4,645,578.54	1,090,256.46
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-88,596.47	-49,139.07
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.22	19,707.05	5,644.70
减：二、营业总支出		200,357.23	154,008.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	158,748.69	118,365.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,458.15	19,727.63
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资 产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-	-
7. 税金及附加		42.11	-
8. 其他费用	6.4.7.24	15,108.28	15,915.82

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,151,846.75	900,717.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,151,846.75	900,717.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,151,846.75	900,717.79

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	18,353,352.45	-	3,444,574.88	21,797,927.33
二、本期期初净资产	18,353,352.45	-	3,444,574.88	21,797,927.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,725,835.96	-	9,008,422.08	13,734,258.04
（一）、综合收益总额	-	-	7,151,846.75	7,151,846.75
（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）	4,725,835.96	-	1,856,575.33	6,582,411.29
其中：1. 基金申购款	7,776,476.05	-	2,989,191.84	10,765,667.89
2. 基金赎回款	-3,050,640.09	-	-1,132,616.51	-4,183,256.60
（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	23,079,188.41	-	12,452,996.96	35,532,185.37
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	18,179,362.88	-	1,381,504.99	19,560,867.87
二、本期期初净资产	18,179,362.88	-	1,381,504.99	19,560,867.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-420,000.78	-	846,669.14	426,668.36
(一)、综合收益总额	-	-	900,717.79	900,717.79
(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)	-420,000.78	-	-54,048.65	-474,049.43
其中：1. 基金申购款	1,096,306.25	-	118,742.56	1,215,048.81
2. 基金赎回款	-1,516,307.03	-	-172,791.21	-1,689,098.24
(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	17,759,362.10	-	2,228,174.13	19,987,536.23

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

嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金(QDII)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1724号《关于准予嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金(QDII)注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金(QDII)基金合同》负责公

开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》于 2023 年 11 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,003,238.37 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2021]33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2024]8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财

税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自2026年1月1日至2027年12月31日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；

(2)对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后(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；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在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；

(3)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税；

(4)对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，解禁后取得的股息红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。对基金通过港股通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过港股通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税；

(5)对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；对于基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税；

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

用比例计算缴纳；

(7) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税；基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,416,005.42
等于：本金	4,415,811.55
加：应计利息	193.87
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	4,416,005.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,829,945.23	-	29,538,219.98	5,708,274.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	1,438,446.81	-	1,360,377.29	-78,069.52
其他	-	-	-	-

合计	25,268,392.04	-	30,898,597.27	5,630,205.23
----	---------------	---	---------------	--------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	90.26
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	15,357.23
其中：交易所市场	15,357.23
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用	13,884.51
合计	29,332.00

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,353,352.45	18,353,352.45
本期申购	7,776,476.05	7,776,476.05
本期赎回（以“-”号填列）	-3,050,640.09	-3,050,640.09
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	23,079,188.41	23,079,188.41

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,150,745.77	1,293,829.11	3,444,574.88
本期期初	2,150,745.77	1,293,829.11	3,444,574.88
本期利润	2,506,268.21	4,645,578.54	7,151,846.75
本期基金份额交易产生的变动数	962,345.98	894,229.35	1,856,575.33

其中：基金申购款	1,593,589.71	1,395,602.13	2,989,191.84
基金赎回款	-631,243.73	-501,372.78	-1,132,616.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,619,359.96	6,833,637.00	12,452,996.96

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,639.35
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	63.47
其他	74.20
合计	4,777.02

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,663,962.35
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	2,663,962.35

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	57,472,286.86
减：卖出股票成本总额	54,641,029.60
减：交易费用	167,294.91
买卖股票差价收入	2,663,962.35

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	6,048,274.07
减：卖出/赎回基金成本总额	6,089,266.21
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	1,820.01
减：交易费用	6,808.02
基金投资收益	-49,620.17

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,066.70
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	-1,066.70

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	681,500.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	682,566.70
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,066.70

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	144,037.32
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	13,425.04
合计	157,462.36

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,645,578.54
股票投资	4,505,735.43
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	139,843.11

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	4,645,578.54

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	19,707.05
合计	19,707.05

6.4.7.23 信用减值损失

无。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	13,884.51
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	796.75
其他	422.50
深港通证券组合费	4.52
合计	15,108.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
JPMorgan Chase Bank, National Association（“摩根大通银行”）	境外资产托管人
德意志银行香港分行	基金管理人股东的关联方

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 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	158,748.69	118,365.29
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,697.77	3,397.24
应支付基金管理人的净管理费	149,050.92	114,968.05

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,458.15	19,727.63

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	10,002,250.22	10,002,250.22
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,002,250.22	10,002,250.22
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	43.34%	56.32%

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

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	3,186,402.65	2,821.85	493,944.33	826.87
摩根大通银行_活期	1,229,602.77	1,817.50	1,073,485.69	4,760.72

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

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
德意志银行香港分行	1768 HK	鸣鸣很忙	新股发行	847	179,546.56
德意志银行香港分行	7666 HK	剂泰科技	新股发行	73	670.44
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述

比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,416,005.42	-	-	-	4,416,005.42
结算备付金	34,066.48	-	-	-	34,066.48
存出保证金	4,110.91	-	-	-	4,110.91
交易性金融资产	-	-	-	30,898,597.27	30,898,597.27
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	31,415.86	31,415.86

应收申购款	-	-	-	586,438.91	586,438.91
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,454,182.81	-	-	31,516,452.04	35,970,634.85
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	-	-	-	372,766.83	372,766.83
应付管理人报酬	-	-	-	31,157.71	31,157.71
应付托管费	-	-	-	5,192.94	5,192.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	29,332.00	29,332.00
负债总计	-	-	-	438,449.48	438,449.48
利率敏感度缺口	4,454,182.81	-	-	31,078,002.56	35,532,185.37
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,445,001.77	-	-	-	1,445,001.77
结算备付金	20,158.57	-	-	-	20,158.57
存出保证金	3,266.68	-	-	-	3,266.68
交易性金融资产	-	-	-	19,833,401.22	19,833,401.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	473,150.98	473,150.98
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	60,336.22	60,336.22
应收申购款	-	-	-	36,196.90	36,196.90
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,156,049.59	1,156,049.59
资产总计	1,468,427.02	-	-	21,559,134.91	23,027,561.93
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	-	-	-	13,542.34	13,542.34

应付管理人报酬	-	-	-	22,153.85	22,153.85
应付托管费	-	-	-	3,692.30	3,692.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,190,246.11	1,190,246.11
负债总计	-	-	-	1,229,634.60	1,229,634.60
利率敏感度缺口	1,468,427.02	-	-	20,329,500.31	21,797,927.33

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	-	-
	市场利率上升 25 个基点	-	-

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及负债，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币计价的资产进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	1,469,862	-	-	1,469,862.85

	.85			
结算备付金	—	—	—	—
存出保证金	—	—	—	—
交易性金融资产	9,584,188.48	5,454,343.74	500,166.48	15,538,698.70
衍生金融资产	—	—	—	—
债权投资	—	—	—	—
应收股利	2,711.90	28,703.96	—	31,415.86
应收申购款	170,556.92	—	—	170,556.92
应收清算款	—	—	—	—
其他资产	—	—	—	—
资产合计	11,227,320.15	5,483,047.70	500,166.48	17,210,534.33
以外币计价的负债				
应付清算款	—	—	—	—
衍生金融负债	—	—	—	—
应付赎回款	3,816.01	—	—	3,816.01
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	3.54	—	—	3.54
负债合计	3,819.55	—	—	3,819.55
资产负债表外汇风险敞口净额	11,223,500.60	5,483,047.70	500,166.48	17,206,714.78
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
货币资金	300,717.93	—	—	300,717.93
结算备付金	—	—	—	—
存出保证金	—	—	—	—
交易性金融资产	3,031,426.62	10,529,463.32	—	13,560,889.94
衍生金融资产	—	—	—	—
债权投资	—	—	—	—
应收股利	39,207.77	1,168.97	—	40,376.74
应收申购款	3,455.57	—	—	3,455.57
应收清算款	—	473,150.98	—	473,150.98
其他资产	814,212.75	341,836.84	—	1,156,049.59
资产合计	4,189,020.64	11,345,620.11	—	15,534,640.75
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	342,223.42	814,987.82	—	1,157,211.24

负债合计	342,223.42	814,987.82	-	1,157,211.24
资产负债表外 汇风险敞口净 额	3,846,797.22	10,530,632.29	-	14,377,429.51

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民币升值 5%	860,335.74	718,871.48
	所有外币相对人民币贬值 5%	-860,335.74	-718,871.48

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	29,538,219.98	83.13	18,330,266.61	84.09
交易性金融资产—基金投资	1,360,377.29	3.83	1,503,134.61	6.90
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产	-	-	-	-
一权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	30,898,597.27	86.96	19,833,401.22	90.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	3,386,903.80	2,501,341.45
	业绩比较基准下降 5%	-3,386,903.80	-2,501,341.45

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	30,898,597.27	19,833,401.22
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	30,898,597.27	19,833,401.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、

交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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	29,538,219.98	82.12
	其中：普通股	28,152,577.66	78.27
	存托凭证	1,385,642.32	3.85
	优先股	—	—
	房地产信托凭证	—	—
2	基金投资	1,360,377.29	3.78
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
	其中：远期	—	—
	期货	—	—
	期权	—	—
	权证	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	货币市场工具	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,450,071.90	12.37
8	其他各项资产	621,965.68	1.73
9	合计	35,970,634.85	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国	15,359,898.57	43.23
美国	8,723,977.67	24.55
中国香港	5,454,343.74	15.35
合计	29,538,219.98	83.13

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
通信服务	2,509,542.54	7.06
非必需消费品	409,252.08	1.15
必需消费品	—	—
能源	1,591,876.72	4.48
金融	1,958,588.38	5.51
医疗保健	742,089.12	2.09
工业	918,355.00	2.58
信息技术	18,998,878.64	53.47
原材料	2,117,023.00	5.96
房地产	292,614.50	0.82
公用事业	—	—
合计	29,538,219.98	83.13

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 （英文）	公司名称 （中文）	证券代 码	所在证 券市场	所属 国家 （地区）	数量 （股）	公允价值	占基 金资 产净 值比 例 （%）
1	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	中国香港	17,500	1,157,451.44	3.26
1	China Mobile Ltd	中国移动有限公司	600941 CH	上海证券交易所	中国	7,400	637,362.00	1.79
2	Anji Microelectronics Technology Shanghai	安集微电子科技(上海)股份有限公司	688019 CH	上海证券交易所	中国	4,549	1,544,203.54	4.35

	Co Ltd							
3	Micron Technology Inc	美光科技股份有限公司	MU UW	纳斯达克证券交易所	美国	181	1,422,977.43	4.00
4	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	台湾积体电路制造股份有限公司	TSM UN	纽约证券交易所	美国	426	1,385,642.32	3.90
5	KLA Corp	科磊公司	KLAC UW	纳斯达克证券交易所	美国	630	1,294,597.48	3.64
6	Zhongji Innolight Co Ltd	中际旭创股份有限公司	300308 CH	深圳证券交易所	中国	1,000	1,270,000.00	3.57
7	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港证券交易所	中国香港	21,000	731,770.75	2.06
7	China Shenhua Energy Co Ltd	中国神华能源股份有限公司	601088 CH	上海证券交易所	中国	8,300	324,032.00	0.91
8	Circuit Fabology Microelectronics Equipment Co Ltd	合肥芯碁微电子装备股份有限公司	688630 CH	上海证券交易所	中国	1,913	1,050,983.07	2.96
9	China Jushi Co Ltd	中国巨石股份有限公司	600176 CH	上海证券交易所	中国	12,000	874,560.00	2.46
10	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	潮州三环(集团)股份有限公司	300408 CH	深圳证券交易所	中国	5,200	867,880.00	2.44
11	Yuanjie Semiconductor Technology	陕西源杰半导体科技股份有限公司	688498 CH	上海证券交易所	中国	460	867,560.00	2.44

	y Co Ltd	有限公司						
12	BOE Technology Group Co Ltd	京东方科技集团股份有限公司	000725 CH	深圳证券交易所	中国	86,600	751,688.00	2.12
13	Alphabet Inc	Alphabet 股份有限公司	GOOG UW	纳斯达克证券交易所	美国	297	714,729.10	2.01
14	QUALCOMM Inc	高通公司	QCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	562	707,325.45	1.99
15	Teradyne Inc	泰瑞达	TER UW	纳斯达克证券交易所	美国	210	692,031.03	1.95
16	NVIDIA Corp	英伟达公司	NVDA UW	纳斯达克证券交易所	美国	490	667,768.56	1.88
17	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物技术有限公司	2269 HK	香港证券交易所	中国香港	21,000	631,088.43	1.78
18	Intel Corp	英特尔公司	INTC UW	纳斯达克证券交易所	美国	650	618,153.88	1.74
19	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	江苏恒立液压股份有限公司	601100 CH	上海证券交易所	中国	5,400	580,824.00	1.63
20	Advanced Micro-Fabrication Equipment Inc China	中微半导体设备(上海)股份有限公司	688012 CH	上海证券交易所	中国	1,219	571,101.50	1.61
21	China Construction Bank Corp	中国建设银行股份有限公司	601939 CH	上海证券交易所	中国	59,000	568,170.00	1.60
22	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	深圳新宙邦科技股份有限公司	300037 CH	深圳证券交易所	中国	5,700	529,245.00	1.49

23	Hubei Dinglong Co Ltd	湖北鼎龙控 股股份有 限公司	300054 CH	深圳证 券交易 所	中国	4,400	466,268.00	1.31
24	Luxshare Precision Industry Co Ltd	立讯精 密工业 股份有 限公司	002475 CH	深圳证 券交易 所	中国	6,100	429,440.00	1.21
25	Coherent Corp	相干公 司	COHR UN	纽约证 券交易 所	美国	156	419,124.53	1.18
26	SG Micro Corp	圣邦微 电子 (北京) 股份有 限公司	300661 CH	深圳证 券交易 所	中国	2,900	416,092.00	1.17
27	Apple Inc	苹果公 司	AAPL UW	纳斯达 克证券 交易所	美国	203	400,072.81	1.13
28	CITIC Securities Co Ltd	中信证 券股份 有限公 司	6030 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	16,500	390,665.10	1.10
29	Nantong Jianghai Capacitor Co Ltd	南通江 海电容 器股份 有限公 司	002484 CH	深圳证 券交易 所	中国	3,500	367,500.00	1.03
30	NAURA Technology Group Co Ltd	北方华 创科技 集团股 份有限 公司	002371 CH	深圳证 券交易 所	中国	400	353,824.00	1.00
31	TCL Technology Group Corp	TCL 科 技集团 股份有 限公司	000100 CH	深圳证 券交易 所	中国	59,500	346,290.00	0.97
32	Huatai Securities Co Ltd	华泰证 券股份 有限公 司	6886 HK	香港证 券交易 所	中国 香港	23,300	337,961.49	0.95
33	3peak Inc	思瑞浦 微电子 科技 (苏州)	688536 CH	上海证 券交易 所	中国	894	325,496.46	0.92

		股份有 限公司						
34	Jiangsu Pacific Quartz Co Ltd	江苏太 平洋石 英股份 有限公 司	603688 CH	上海证 券交易 所	中国	3,900	322,179.00	0.91
35	Suzhou Dongshan Precision Manufactu ring Co Ltd	苏州东 山精密 制造股 份有限 公司	002384 CH	深圳证 券交易 所	中国	1,200	314,820.00	0.89
36	Semicondu ctor Manufactu ring Internati onal Corp	中芯国 际集成 电路制 造有限 公司	981 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	4,000	310,593.48	0.87
37	Eoptolink Technolog y Inc Ltd	成都新 易盛通 信技术 股份有 限公司	300502 CH	深圳证 券交易 所	中国	500	303,500.00	0.85
38	Sun Hung Kai Propertie s Ltd	新鸿基 地产发 展有限 公司	16 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	3,000	292,614.50	0.82
39	BYD Co Ltd	比亚迪 股份有 限公司	1211 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	4,600	289,461.66	0.81
40	Skyverse Technolog y Co Ltd	深圳中 科飞测 科技股 份有限 公司	688361 CH	上海证 券交易 所	中国	658	282,940.00	0.80
41	Industria l & Commertia l Bank of China Ltd	中国工 商银行 股份有 限公司	601398 CH	上海证 券交易 所	中国	38,700	273,609.00	0.77
42	Yankuang Energy Group Co Ltd	兖矿能 源集团 股份有 限公司	1171 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	28,000	268,729.37	0.76

43	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Ltd Co	长飞光纤光缆股份有限公司	6869 HK	香港证券交易所	中国香港	1,200	266,193.20	0.75
44	Jiangsu Yoke Technology Co Ltd	江苏雅克科技股份有限公司	002409 CH	深圳证券交易所	中国	1,100	246,950.00	0.70
45	Applied Materials Inc	应用材料公司	AMAT UW	纳斯达克证券交易所	美国	36	177,274.11	0.50
46	Sungrow Power Supply Co Ltd	阳光电源股份有限公司	300274 CH	深圳证券交易所	中国	1,100	174,922.00	0.49
47	XCMG Construction Machinery Co Ltd	徐工集团工程机械股份有限公司	000425 CH	深圳证券交易所	中国	20,100	162,609.00	0.46
48	CNOOC Ltd	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	中国香港	9,000	158,840.42	0.45
49	Guotai Haitong Securities Co Ltd	国泰海通证券股份有限公司	2611 HK	香港证券交易所	中国香港	11,000	141,877.64	0.40
50	China Life Insurance Co Ltd	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港证券交易所	中国香港	6,000	138,933.26	0.39
51	Anker Innovations Technology Co Ltd	安克创新科技股份有限公司	300866 CH	深圳证券交易所	中国	1,300	135,850.00	0.38
52	Zhejiang Leapmotor Technology Co Ltd	浙江零跑科技股份有限公司	9863 HK	香港证券交易所	中国香港	4,000	119,790.42	0.34
53	Broadcom	博通股	AVGO	纳斯达克	美国	45	115,776.79	0.33

	Inc	份有限 公司	UW	克证券 交易所				
54	BeOne Medicines Ltd	百济神 州有限 公司	6160 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	750	111,000.69	0.31
55	Occidenta l Petroleum Corp	西方石 油	OXY UN	纽约证 券交易 所	美国	328	108,504.18	0.31
56	Orient Securitie s Co Ltd/China	东方证 券股份 有限公 司	3958 HK	香港证 券交易 所	中 国 香港	22,600	107,371.89	0.30

注：本表所使用的证券代码为彭博代码。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净 值比例(%)
1	China Shenhua Energy Co Ltd	601088 CH	1,829,119.00	8.39
1	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	1,040,681.02	4.77
2	China Mobile Ltd	600941 CH	1,358,056.00	6.23
2	China Mobile Ltd	941 HK	1,269,403.19	5.82
3	CNOOC Ltd	883 HK	1,202,875.00	5.52
3	CNOOC Ltd	600938 CH	886,672.00	4.07
4	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	1,332,412.67	6.11
5	BYD Co Ltd	002594 CH	963,384.00	4.42
5	BYD Co Ltd	1211 HK	314,374.68	1.44
6	China Jushi Co Ltd	600176 CH	1,205,354.00	5.53
7	KLA Corp	KLAC UW	1,134,563.87	5.20
8	Anji Microelectronics Technology Shanghai Co Ltd	688019 CH	1,108,139.71	5.08
9	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	601100 CH	1,103,839.00	5.06
10	QUALCOMM Inc	QCOM UW	1,093,665.51	5.02

11	Micron Technology Inc	MU UW	1,001,416.86	4.59
12	Kweichow Moutai Co Ltd	600519 CH	998,904.00	4.58
13	Sunwoda Electronic Co Ltd	300207 CH	978,972.00	4.49
14	Henderson Land Development Co Ltd	12 HK	977,194.66	4.48
15	Monolithic Power Systems Inc	MPWR UW	938,900.52	4.31
16	Zhongji Innolight Co Ltd	300308 CH	917,659.00	4.21
17	XCMG Construction Machinery Co Ltd	000425 CH	911,864.00	4.18
18	Sun Hung Kai Properties Ltd	16 HK	897,233.02	4.12
19	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	1347 HK	874,674.93	4.01
20	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	300408 CH	873,902.00	4.01
21	Circuit Fabology Microelectronics Equipment Co Ltd	688630 CH	812,831.81	3.73
22	PetroChina Co Ltd	857 HK	793,909.27	3.64
23	Hubei Dinglong Co Ltd	300054 CH	784,043.00	3.60
24	Weichai Power Co Ltd	2338 HK	756,296.00	3.47
25	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	600426 CH	754,134.00	3.46
26	Teradyne Inc	TER UW	732,671.56	3.36
27	Lam Research Corp	LRCX UW	683,093.10	3.13
28	Luxshare Precision Industry Co Ltd	002475 CH	681,785.00	3.13
29	Wuxi Biologics Cayman Inc	2269 HK	651,103.04	2.99
30	BOE Technology Group Co Ltd	000725 CH	646,838.00	2.97
31	NVIDIA Corp	NVDA UW	641,929.72	2.94

32	China Construction Bank Corp	601939 CH	611,339.00	2.80
33	Yuanjie Semiconductor Technology Co Ltd	688498 CH	567,909.59	2.61
34	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	561,496.89	2.58
35	Amlogic Shanghai Co Ltd	688099 CH	540,851.50	2.48
36	Dongfang Electric Corp Ltd	600875 CH	538,022.00	2.47
37	SG Micro Corp	300661 CH	523,482.00	2.40
38	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	601138 CH	522,951.00	2.40
39	Merck & Co Inc	MRK UN	505,556.75	2.32
40	IEIT Systems Co Ltd	000977 CH	501,252.00	2.30
41	Goldwind Science & Technology Co Ltd	2208 HK	499,481.62	2.29
42	Coherent Corp	COHR UN	498,679.94	2.29
43	Li Ning Co Ltd	2331 HK	494,976.92	2.27
44	Advanced Micro Devices Inc	AMD UW	485,447.89	2.23
45	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	480,329.79	2.20
46	Chengxin Lithium Group Co Ltd	002240 CH	479,670.00	2.20
47	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	601318 CH	258,202.00	1.18
47	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	216,969.30	1.00
48	Alphabet Inc	GOOGL UW	473,097.22	2.17
49	Zhejiang Leapmotor Technology Co Ltd	9863 HK	472,243.22	2.17

50	Shanghai Fudan Microelectronics Group Co Ltd	1385 HK	467,860.19	2.15
51	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Ltd Co	6869 HK	457,115.51	2.10
52	Shenzhen Capchem Technology Co Ltd	300037 CH	454,176.00	2.08

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	China Shenhua Energy Co Ltd	601088 CH	1,627,693.00	7.47
1	China Shenhua Energy Co Ltd	1088 HK	159,577.69	0.73
2	CNOOC Ltd	883 HK	884,080.93	4.06
2	CNOOC Ltd	600938 CH	806,180.00	3.70
3	Hua Hong Grace Semiconductor Ltd	1347 HK	1,567,412.48	7.19
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	1,373,742.69	6.30
5	Zijin Mining Group Co Ltd	601899 CH	785,475.00	3.60
5	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	569,585.01	2.61
6	BYD Co Ltd	002594 CH	897,409.00	4.12
6	BYD Co Ltd	1211 HK	339,535.99	1.56
7	Anji Microelectronics Technology Shanghai Co Ltd	688019 CH	1,216,682.33	5.58
8	China Jushi Co Ltd	600176 CH	1,167,850.00	5.36
9	Lam Research Corp	LRCX UW	1,144,692.72	5.25
10	Alphabet Inc	GOOGL UW	1,136,330.14	5.21
11	Henderson Land Development Co Ltd	12 HK	1,099,214.21	5.04
12	GigaDevice Semiconductor Inc	603986 CH	1,059,447.00	4.86
12	GigaDevice Semiconductor Inc	3986 HK	14,232.66	0.07

13	Kweichow Moutai Co Ltd	600519 CH	978,943.00	4.49
14	Weichai Power Co Ltd	2338 HK	949,940.15	4.36
15	Sunwoda Electronic Co Ltd	300207 CH	935,799.00	4.29
16	Monolithic Power Systems Inc	MPWR UW	908,900.13	4.17
17	PetroChina Co Ltd	857 HK	904,367.25	4.15
18	Hengli Petrochemical Co Ltd	600346 CH	790,641.00	3.63
19	Hubei Dinglong Co Ltd	300054 CH	774,700.00	3.55
20	Chaozhou Three-Circle Group Co Ltd	300408 CH	729,797.00	3.35
21	Yangtze Optical Fibre & Cable Joint Stock Ltd Co	6869 HK	725,961.66	3.33
22	Shandong Hualu Hengsheng Chemical Co Ltd	600426 CH	715,136.00	3.28
23	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	700,560.39	3.21
24	China Merchants Bank Co Ltd	600036 CH	650,090.00	2.98
25	XCMG Construction Machinery Co Ltd	000425 CH	645,054.00	2.96
26	Sun Hung Kai Properties Ltd	16 HK	627,351.68	2.88
27	Semiconductor Manufacturing International Corp	981 HK	572,461.70	2.63
28	Dongfang Electric Corp Ltd	600875 CH	571,168.00	2.62
29	Foxconn Industrial Internet Co Ltd	601138 CH	568,848.00	2.61

30	Zijin Gold International Co Ltd	2259 HK	567,963.46	2.61
31	Amlogic Shanghai Co Ltd	688099 CH	564,721.95	2.59
32	Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	TSM UN	547,575.36	2.51
33	China Mobile Ltd	600941 CH	546,967.00	2.51
34	IEIT Systems Co Ltd	000977 CH	543,430.00	2.49
35	China Life Insurance Co Ltd	2628 HK	542,500.14	2.49
36	Mixue Group	2097 HK	515,397.72	2.36
37	Contemporary Amperex Technology Co Ltd	3750 HK	512,135.44	2.35
38	Tongkun Group Co Ltd	601233 CH	510,459.00	2.34
39	Minimax Group Inc	100 HK	474,986.77	2.18
40	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	601318 CH	247,498.00	1.14
40	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	218,891.42	1.00
41	Merck & Co Inc	MRK UN	459,749.81	2.11
42	China Petroleum & Chemical Corp	386 HK	455,071.72	2.09
43	Chengxin Lithium Group Co Ltd	002240 CH	452,020.00	2.07
44	Industrial Bank Co Ltd	601166 CH	447,102.98	2.05
45	Li Ning Co Ltd	2331 HK	441,782.60	2.03
46	Zhejiang Yinlun Machinery Co Ltd	002126 CH	436,540.00	2.00
47	Jiangsu Hengli Hydraulic Co Ltd	601100 CH	436,265.00	2.00

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	61,343,247.54
卖出收入（成交）总额	57,472,286.86

注：7.5.1 项“买入金额”、7.5.2 项“卖出金额”及 7.5.3 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。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	State Street Energy Select Sector SPDR ETF	ETF	交易型开放式	SSgA Funds Management Inc	588,167.94	1.66
2	NEXT FUNDS TOPIX Banks Exchange Traded Fund	ETF	交易型开放式	Nomura Asset Management Co Ltd	294,145.98	0.83
3	iShares Global Healthcare ETF	ETF	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	272,042.87	0.77
4	NEXT FUNDS TOPIX-17 Commercial & Wholesale Trade ETF	ETF	交易型开放式	Nomura Asset Management Co Ltd	206,020.50	0.58

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 只基金。

7.11 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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，没有超出基金合同约定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 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	4,110.91
2	应收清算款	-
3	应收股利	31,415.86
4	应收利息	-
5	应收申购款	586,438.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	621,965.68

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,609	14,343.81	10,002,250.22	43.34	13,076,938.19	56.66

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
----	--------------------------------------

盈利投资者数量占比（%）	87.35
--------------	-------

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

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

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,250.22	43.34	10,002,250.22	43.34	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,250.22	43.34	10,002,250.22	43.34	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 11 月 13 日）基金份额总额	10,003,238.37
本报告期期初基金份额总额	18,353,352.45

本报告期基金总申购份额	7,776,476.05
减：本报告期基金总赎回份额	3,050,640.09
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	23,079,188.41

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。本基金份额变动含人民币份额及美元现汇份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况 1	内容
受到调查或处罚等措施的主体	管理人
受到调查或处罚等措施的时间	2026 年 2 月 12 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	人员管理
受到处罚的依据	《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》

管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已从制度建设、流程机制等方面整改完毕。
其他	—

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券股份有限公司 CITIC Securities Company Limited	—	21,314,154.39	17.94	9,289.93	8.47	—
国海证券股份有限	—	17,616,175.70	14.83	7,679.56	7.00	—

公司 Sealand Securi ties Co .,Ltd.						
申万宏源 证券有限 公司 Shenwan Hongyu an Secu rities Co.,Ltd.	-	12,292,535.88	10.35	5,357.90	4.89	-
花旗环球 金融亚洲 有限公司 Citigrou p Glo bal Mar kets As ia Limi ted	-	10,384,544.00	8.74	11,076.79	10.10	-
招商证券 （香港） 有限公司 China Mercha nts Sec urities (HK) Co ., Ltd.	-	5,786,681.75	4.87	7,234.68	6.60	-
天风证券 股份有限 公司 Tianfeng Securi ties Co .,Ltd.	-	5,737,843.37	4.83	2,501.49	2.28	-
里昂证券 有限公司 CLSA Limited	-	5,161,122.52	4.34	3,723.83	3.40	-
高盛（亚 洲）有限 责任公司	-	4,980,755.14	4.19	9,961.51	9.09	-

Goldman Sachs (Asia) L. L. C						
野村证券 NOMURA	-	4,939,893.12	4.16	6,433.98	5.87	-
招商证券股份有限公司 China Merchants Securities Co., Ltd.	-	4,774,605.00	4.02	2,081.51	1.90	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	4,124,675.41	3.47	8,284.16	7.56	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	3,718,139.29	3.13	5,166.44	4.71	-
安信国际证券(香港)有限公司 Essence International Securities (Hong Kong) Ltd	-	3,142,713.65	2.65	6,444.89	5.88	-

mitted						
侨丰证券 有限公司 OSK S ecuritie s Hong Kong Limited	-	2,872,118.39	2.42	5,744.24	5.24	-
美林证券 公司 Bank of Americ a Merri ll Lync h	-	2,582,232.48	2.17	774.61	0.71	-
摩根士丹 利亚洲有 限公司 Morgan Stanle y Asia Limite d	-	1,850,376.71	1.56	555.10	0.51	-
摩根大通 证券（亚 太）有限 公司 J.P.Morg an Se curities (Asia P acific) Limite d	-	1,821,691.76	1.53	3,643.38	3.32	-
法国巴黎 证券（亚 洲）有限 公司 BNP P ARIBAS Securiti es (Asia) Limited	-	1,252,786.04	1.05	2,505.57	2.29	-
香港上海	-	1,251,368.27	1.05	1,877.06	1.71	-

汇丰银行 有限公司 The H ongkong and S hanghai Bankin g Corpo ration Limited						
天风国际 证券与期 货有限公 司 TFI S ECURITIE S AND FUTURES LIMITE D	-	880,555.98	0.74	1,761.10	1.61	-
华泰金融 控股（香 港）有限 公司 Hu atai Fi nancial Holdin gs (Hong K ong) Li mited	-	737,397.08	0.62	3,637.25	3.32	-
中国国际 金融股份 有限公司 China Intern ational Capita l Corpo ration Limited	-	398,509.24	0.34	199.25	0.18	-
元大证券 （香港） 有限公司	-	394,616.29	0.33	789.24	0.72	-

Yuanta Securi ties (Hong K ong) Co mpany L imited						
信达国际 证券有限 公司 CINDA INTERN ATIONAL SECURI TIES LI MITED	-	347,512.28	0.29	695.02	0.63	-
美林（亚 太）有限 公司 Merrill Lynch (Asia P acific) Limite d	-	285,720.21	0.24	571.44	0.52	-
广发证券 （香港） 经纪有限 公司 GF Se curities (Hong K ong) Br okerage Ltd	-	164,670.90	0.14	1,646.70	1.50	-
德意志银 行股份有 限公司 Deutsche Bank	-	670.44	0.00	6.71	0.01	-
国泰海通 证券股份 有限公司 Guotai Haiton	-	-	-	-	-	-

g Secur ities C o., Ltd .						
平安证券 股份有限 公司 Ping An Secu rities Co., Lt d	-	-	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo Securi ties LL C	-	-	-	-	-	-
富瑞金融 集团 Jefferie s Hon g Kong Limite d	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司 Huatai Securi ties Co ., Ltd.	-	-	-	-	-	-
蒙特利尔 银行 BMO C apital Markets Corp	-	-	-	-	-	-
多伦多道 明证券 TD Se curities	-	-	-	-	-	-
极讯欧洲 有限公司 Instinet	-	-	-	-	-	-

Europe Limite d						
浙商证券 股份有限 公司 ZHESHANG SECURI TIES CO , LTD.	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司 Sinolink Securi ties Co , Ltd.	-	-	-	-	-	-
广发证券 股份有限 公司 GF Se curities Co., Lt d.	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司 Huachuan g Sec urities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-
盛博香港 有限公司 Sanford C. Be rnstein (Hong K ong) Li mited	-	-	-	-	-	-
申万宏源 (香港) 有限公司 Shenwan Hongyu	-	-	-	-	-	-

an Securities (H.K.) Limited						
民生证券股份有限公司 Minsheng Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

- （1）经营行为规范；
- （2）财务状况良好；
- （3）合规风控能力较强；
- （4）研究、交易等服务能力较强。

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易	权证交易	基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

				(%)		)		
中信证券股份有限公司 CITIC Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司 Sealand Securities Co.,Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司 Shenwan Hongyuan Securities Co.,Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	-	-	-	-	-	2,172,942.97	18.33
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	754,018.23	6.36
天风证券股份有限公司 Tianfeng Securities Co.,Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	1,746,202.28	14.73
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	-	-
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	520,635.26	4.39
招商证券股份有限公司 China Merchants Securities Co.,Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	1,174,346.77	9.91
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	749,098.07	6.32
安信国际证券(香港)有限公司 Essence International Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
侨丰证券有限公司 OSK Securities Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	715,436.29	6.03
美林证券公司 Bank of America Merrill Lynch	-	-	-	-	-	-	288,362.43	2.43
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	1,697,251.23	14.32
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-

法国巴黎证券（亚洲）有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
天风国际证券与期货有限公司 TFI SECURITIES AND FUTURES LIMITED	-	-	-	-	-	-	275,623.01	2.33
华泰金融控股（香港）有限公司 Huatai Financial Holdings (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	168,841.83	1.42
中国国际金融股份有限公司 China International Capital Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
元大证券（香港）有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
美林（亚太）有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券（香港）经纪有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司 Guotai Haitong Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司 Ping An Securities Co., Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
富国证券 Wells Fargo Securities LLC	682,566.70	100.00	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司 Huatai Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
蒙特利尔银行 BMO Capital Markets Corp	-	-	-	-	-	-	-	-
多伦多道明证券 TD Securities	-	-	-	-	-	-	-	-
极讯欧洲有限公司 Instinet Europe Limited	-	-	-	-	-	-	1,592,181.48	13.43
浙商证券股份有限公司 ZHESHANG SECURITIES CO., LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

Sinolink Securities Co., Ltd.								
广发证券股份有限公司 GF Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司 Huachuang Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源（香港）有限公司 Shenwan Hongyuan Securities (H.K.) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司 Minsheng Securities Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-

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	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 1 月 12 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 8 日
2	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 1 月 19 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 15 日
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 28 日
4	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 2 月 11 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 9 日
5	关于嘉实全球产业精选混合发起式（QDII）基金经理变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 25 日
6	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 3 月 20 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 18 日
7	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 4 月 3 日至 4 月 7 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 1 日
8	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 4 月 29 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 27 日

9	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 5 月 6 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 29 日
10	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 13 日
11	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 5 月 25 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 5 月 21 日
12	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日
13	关于嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）2026 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定期定额投资业务的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 29 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2026-01-01 至 2026-06-30	10,002,250.22	-	-	10,002,250.22	43.34
个人	1	2026-01-01 至 2026-06-30	6,825,462.87	163,212.01	-	6,988,674.88	30.28
产品特有风险							
报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。 未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项。							

注：申购份额包括申购、转换转入、红利再投或份额拆分等导致增加的份额，赎回份额包括赎回、转换转出或份额合并等导致减少的份额。

§ 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全球产业精选混合型发起式证券投资基金(QDII)注册的批复文件。
- (2) 《嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）基金合同》；
- (3) 《嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）托管协议》；
- (4) 《嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实全球产业精选混合型发起式证券投资基金（QDII）公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日