

# 百嘉百盛混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:百嘉基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月29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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	60

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	60
§9 开放式基金份额变动 .....	60
§10 重大事件揭示 .....	61
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	61
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 .....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	61
10.4 基金投资策略的改变 .....	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	61
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	61
10.8 其他重大事件 .....	63
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
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 .....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	63
§12 备查文件目录 .....	67
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	百嘉百盛混合型证券投资基金
基金简称	百嘉百盛混合
基金主代码	015056
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年06月16日
基金管理人	百嘉基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	103,750,645.61份
基金合同存续期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为混合型基金，在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，精选具有竞争优势或潜力的优质上市公司，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将结合对宏观经济走势、政策走势、证券市场环境等因素的分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定投资组合中各类资产的配置比例并根据市场环境变化动态调整，最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+恒生指数收益率×25%+中债综合财富(总值)指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

## 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		百嘉基金管理有限公司	浙商银行股份有限公司
信息披露	姓名	罗江华	朱巍

露负责人	联系电话	020-83539616	0571-87659806
	电子邮箱	luojianghua@baijiafunds.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400-8258838	95527
传真		020-83539672	0571-88268688
注册地址		广州市南沙区丰泽东路106号 (自编1号楼) X1301-G02095 0 (集群注册) (JM)	浙江省杭州市萧山区鸿宁路1 788号
办公地址		广州市天河区花城大道769号 广州嘉昱中心10层	杭州市拱墅区环城西路76号
邮政编码		510623	310006
法定代表人		詹松茂	陆建强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.baijiafunds.com.cn">http://www.baijiafunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广州市天河区花城大道769号广州嘉昱中心10层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	百嘉基金管理有限公司	广州市天河区花城大道769号10楼

## §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
	(2023年01月01日 - 2023年06月30日)
本期已实现收益	-8,121,418.44

本期利润	-9,548,975.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0804
本期加权平均净值利润率	-8.44%
本期基金份额净值增长率	-8.87%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
期末可供分配利润	-13,648,326.83
期末可供分配基金份额利润	-0.1315
期末基金资产净值	90,102,318.78
期末基金份额净值	0.8685
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-13.15%

注：1、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润，为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
过去一个月	-0.69%	1.40%	1.64%	0.76%	-2.33%	0.64%
过去三个月	-10.84%	1.06%	-3.96%	0.67%	-6.88%	0.39%
过去六个月	-8.87%	1.01%	-0.65%	0.70%	-8.22%	0.31%
过去一年	-14.33%	1.01%	-9.31%	0.85%	-5.02%	0.16%
自基金合同生效起至今	-13.15%	0.99%	-6.51%	0.86%	-6.64%	0.13%

注：本基金业绩比较基准为沪深300指数收益率×50%+恒生指数收益率×25%+中债综合财富(总值)指数收益率×25%。

### 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：本基金的投资组合比例为：本基金的股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不超过本基金所投资股票资产的50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，本报告期末距建仓结束不满一年，建仓期结束时本基金资产配置比例符合基金合同约定。

## §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

百嘉基金管理有限公司成立于2020年9月4日，注册资本1亿元，注册地广州市南沙区，办公地址为广州市花城大道769号广州嘉昱中心10楼。2021年3月17日，公司取得中

中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》，业务范围为公开募集证券投资基金管理、基金销售、私募资产管理。

公司恪守基金持有人利益至上原则，以“诚信、专业、团队、创优”为价值观，以“不忘初心、耕耘价值”为使命，坚守对基金持有人、员工、股东和社会的长期承诺，力求实现“百年基业、嘉绩长在”的美好愿景，致力打造倍受投资者认可、值得长期托付的资产管理公司。

公司拥有公募和私募资产管理业务资格，管理的公募基金产品覆盖主动权益、固定收益、存单指数等领域，为广大投资者提供专业的资产管理解决方案。

#### 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		
黄艺明	本基金的基金经理、总经理助理、研究部负责人、权益投资部负责人。	2022-06-16	-	14	厦门大学经济学硕士，具有基金从业资格。曾任广东粤财信托有限公司证券投资部研究员，金鹰基金管理有限公司研究员、基金经理助理、研究总监助理，七匹狼控股集团有限公司基金经理助理，广东富业盛德资产管理有限公司执行董事、投资总监，中科沃土基金管理有限公司专户投资部副总经理兼投资经理、权益投资部副总经理兼基金经理，现任公司总经理助理、研究部负责人、权益投资部负责人。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，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

本基金管理人已制定公平交易管理、投资权限管理、投资备选库管理和集中交易等制度，以公平交易贯穿始终、相互独立、公平对待作为公平交易的原则，通过恒生交易系统内的公平交易模块进行风险控制。

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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

1月至2月开局相对良好，持股的食品饮料、港股互联网、医疗等公司受益疫情后常态化场景消费需求恢复，相关公司股价上行。

3月中下旬以来回撤较大。高估了强消费的持续性、低估了疫情后“疤痕效应”，并对房地产新房成交在5月动能下行、6月同比下降约30%的情形估计不足。

另外，配置的新能源光伏储能相关公司一季报及中期业绩预期保持良好态势，但受制逆全球化及2024年行业产能过剩等担忧，股价下行。

我们认可人工智能产业趋势，但碍于短期商业模式、盈利落地尚不十分清晰，配置仓位相对不足，显著低估了AI科技创新主题在A股映射的强势表现及对其它行业的虹吸效应，整体配置时机偏晚，未取得预期收益。

期待下半年通过仓位及结构调整，聚焦产业、专注成长，提升业绩。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末百嘉百盛混合基金份额净值为0.8685元，本报告期内，基金份额净值增长率为-8.87%，同期业绩比较基准收益率为-0.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期，市场仍面临经济增速预期下行、房地产成交低迷等负面压力消化，权益市场呈现震荡态势。

中期，稳增长政策红利逐步释放，经济波浪式发展、曲折式前进上行，叠加中美关系阶段性预期缓和，市场投资信心有望恢复，权益市场中枢有望上移，我们保持中性偏积极策略。

中央政治局7月会议指出，要活跃资本市场，提振投资者信心，支持民营经济发展、稳消费（家居、电子产品、新能源汽车）、稳投资（积极稳步推进超大特大城市城中村改造、适时调整优化房地产政策）、稳外汇（将企业和金融机构跨境融资宏观审慎调节参数从1.25上调至1.5）、制订一揽子化债方案等。

国内下半年仍有望进一步降准降息，流动性持续改善。

主要配置方向：

##### 1、保持消费、医疗服务基础配置

消费板块在经过阶段性回调后估值已回落至历史合理水平，短期经济数据扰动难改中长期修复趋势以及向好格局。

消费升级以受益渗透率提高的中高端白酒、速冻食品、预制菜等为主，重点聚焦消费细分赛道中更具景气度以及成长属性的领域。

2023年竣工确定性改善，对家居企业业绩构成保障，我们优选定制及智能家居龙头进行配置。

医疗服务底层逻辑不变，优质供给不及、需求拓展行业长期发展空间，常态化后医疗需求强劲。

##### 2、数字经济、“人工智能+”等引领创新

多模态大模型GPT-4落地，GPU全球龙头公司英伟达对23Q2收入展望环比增加50%（大幅超市场预期），预示新一代人工智能科技革命浪潮的开启或正在发生，我们看好数字经济主体性的演绎机会，把握节奏、寻找弹性。

监管态度表述趋向积极，平台经济有望“大显身手”，互联网大厂陆续发布大模型，积极拥抱AI创新。

对于“人工智能+”，算力、算法、数据三大细分中，我们主要配置受益“AI+”降本增效的游戏公司、“AI+”赋能的办公软件及跨境电商公司、数据资源丰富的版权公司以及网络可视化安全龙头公司。

受益AI算力需求扩张的光通信、服务器龙头公司，耐心等待合理价格及产业进一步实质落地时，择机增加投资。

在“人工智能+”，我们优先配置收入或盈利率先呈现同比、环比加速的公司。

##### 3、政策扶持 + 技术进步AI赋能+进口替代

人形机器人产业进程加速，我们对“机器人+”相关受益公司保持跟踪，待产业实质落地后择机增加配置。

半导体设备国产化率提高，长期增长空间大。

4、光伏、储能、充电桩等新能源行业经过一年来行业估值风险释放，部分龙头公司具备中长期投资吸引力，我们保持跟踪及基础配置。

风险因素：

1. 国内经济复苏或稳增长政策实施效果不及预期，通缩风险。  
房地产销售持续下行超预期。
2. 海外核心技术对我国进一步封锁超预期。

#### 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、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，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人--百嘉基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对百嘉基金管理有限公司编制和披露的百嘉百盛混合型证券投资基金2023年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：百嘉百盛混合型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	9,682,121.31	15,537,366.02
结算备付金		1,874.29	3,005,659.52
存出保证金		2,120,271.72	4,531,608.39
交易性金融资产	6.4.7.2	78,733,376.52	96,719,822.68
其中：股票投资		78,733,376.52	96,719,822.68
基金投资		-	-
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	-760.31	1,999,295.69
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		7,200.00	-
应收申购款		40,631.54	26,996.53
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		90,584,715.07	121,820,748.83
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		168,581.32	3,657,238.42
应付赎回款		108,802.74	471,210.71
应付管理人报酬		116,486.48	163,183.99
应付托管费		19,414.43	27,197.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.21	0.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.5	69,111.11	15,912.42
负债合计		482,396.29	4,334,743.17
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	103,750,645.61	123,285,791.09
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-13,648,326.83	-5,799,785.43
净资产合计		90,102,318.78	117,486,005.66
负债和净资产总计		90,584,715.07	121,820,748.83

注：1.本基金合同生效日为2022年6月16日，2022年度实际报告期间为2022年6月16日至2022年12月31日。

2.报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.8685元，基金份额总额103,750,645.61份。

## 6.2 利润表

会计主体：百嘉百盛混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年06月16日（基 金合同生效日）至20 22年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-8,496,864.68	3,591,676.97
1.利息收入		53,191.63	115,167.22
其中：存款利息收入	6.4.7.8	36,869.64	56,147.03
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		16,321.99	59,020.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		-7,197,192.46	297,003.45
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-7,635,737.82	198,083.49

基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,661.26	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	425,884.10	98,919.96
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,427,557.28	2,899,076.07
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.17	74,693.43	280,430.23
<b>减：二、营业总支出</b>		1,052,111.04	181,595.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	845,521.89	153,913.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	140,920.30	25,652.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		0.07	-
8. 其他费用	6.4.7.19	65,668.78	2,029.20
<b>三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）</b>		-9,548,975.72	3,410,081.85
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		-9,548,975.72	3,410,081.85

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,548,975.72	3,410,081.85

注：本基金基金合同生效日为2022年6月16日，上年度可比期间为2022年6月16日至2022年6月30日。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：百嘉百盛混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06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（基金净值）	123,285,791.09	-	-5,799,785.43	117,486,005.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	123,285,791.09	-	-5,799,785.43	117,486,005.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,535,145.48	-	-7,848,541.40	-27,383,686.88
（一）、综合收益总额	-	-	-9,548,975.72	-9,548,975.72
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-19,535,145.48	-	1,700,434.32	-17,834,711.16

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	21,347,576.26	-	-442,432.89	20,905,143.37
2.基金赎回款	-40,882,721.74	-	2,142,867.21	-38,739,854.53
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	103,750,645.61	-	-13,648,326.83	90,102,318.78
项目	上年度可比期间			
	2022年06月16日(基金合同生效日)至2022年06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(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	275,837,112.01	-	-	275,837,112.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-36,166,420.78	-	3,306,683.67	-32,859,737.11

（一）、综合收益总额	-	-	3,410,081.85	3,410,081.85
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-36,166,420.78	-	-103,398.18	-36,269,818.96
其中：1.基金申购款	1,112,549.11	-	8,331.56	1,120,880.67
2.基金赎回款	-37,278,969.89	-	-111,729.74	-37,390,699.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	239,670,691.23	-	3,306,683.67	242,977,374.90

注：本基金基金合同生效日为2022年6月16日，上年度可比期间为2022年6月16日至2022年6月30日。

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：

詹松茂

傅军

高寅初

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

百嘉百盛混合型证券投资基金（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[2022]116号《关于准予百嘉百盛混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由百嘉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《百嘉百盛混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具众环验字（2022）0510017号验资报告后，向中国证监会备案。基金合同于2022年6月16日正式生效。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金本息为人民币275,837,112.01元，募集基金份额275,837,112.01份。

本基金的基金管理人为百嘉基金管理有限公司，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

百嘉百盛混合型证券投资基金根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、北京证券交易所、创业板、存托凭证及其他经中国证监会注册或核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包含股指期货、国债期货、股票期权）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单）、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，投资于港股通标的股票的比例不超过本基金所投资股票资产的50%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+恒生指数收益率×25%+中债综合财富(总值)指数收益率×25%。

#### 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、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、

《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 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要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金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 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （5）境外投资

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年06月30日	
活期存款	9,682,121.31	
等于：本金	9,681,525.90	
加：应计利息	595.41	
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	9,682,121.31	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票	78,503,791.54	-	78,733,376.52	229,584.98
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	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	78,503,791.54	-	78,733,376.52	229,584.98

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-760.31	-
银行间市场	-	-
合计	-760.31	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	7.79
应付交易费用	134.67
其中：交易所市场	134.67
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	5,951.28
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	3,510.00
合计	69,111.11

#### 6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	123,285,791.09	123,285,791.09
本期申购	21,347,576.26	21,347,576.26
本期赎回（以“-”号填列）	-40,882,721.74	-40,882,721.74
本期末	103,750,645.61	103,750,645.61

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.7 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
本期期初	-6,602,990.78	803,205.35	-5,799,785.43
本期利润	-8,121,418.44	-1,427,557.28	-9,548,975.72
本期基金份额交易产生的变动数	1,593,958.50	106,475.82	1,700,434.32
其中：基金申购款	-826,734.68	384,301.79	-442,432.89
基金赎回款	2,420,693.18	-277,825.97	2,142,867.21
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-13,130,450.72	-517,876.11	-13,648,326.83
-----	----------------	-------------	----------------

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
活期存款利息收入	19,037.93	
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	11,860.46	
其他	5,971.25	
合计	36,869.64	

#### 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
卖出股票成交总额	1,335,773,671.56	
减：卖出股票成本总额	1,339,732,835.72	
减：交易费用	3,676,573.66	
买卖股票差价收入	-7,635,737.82	

#### 6.4.7.10 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年01月01日至2023年06月30日	
债券投资收益——利息收入	12.76	
债券投资收益——买卖债券（债转股	12,648.50	

及债券到期兑付) 差价收入	
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	12,661.26

#### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	62,665.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,000.00
减：应计利息总额	13.37
减：交易费用	3.13
买卖债券差价收入	12,648.50

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	425,884.10

基金投资产生的股利收益	-
合计	425,884.10

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-1,427,557.28
——股票投资	-1,427,557.28
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-1,427,557.28

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	74,693.43
合计	74,693.43

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	5,951.28
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	210.13
合计	65,668.78

## 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内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
百嘉基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的基金交易。

#### 6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

### 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 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年06月16日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	845,521.89	153,913.65
其中：支付销售机构的客户维护费	325,437.13	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30	上年度可比期间 2022年06月16日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
----	----------------------------------	---

	日	
当期发生的基金应支付的托管费	140,920.30	25,652.27

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金报告期及上年度可比期间无应支付关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内未发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
詹松茂	395,455.25	0.38%	395,455.25	0.32%
王群航	99,893.89	0.10%	99,893.89	0.08%
郑南莹	29,976.87	0.03%	-	-

##### 6.4.10.5 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 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年06月16日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	9,682,121.31	19,037.93	31,154,732.64	12,833.01

注：本基金的上述银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项说明。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年06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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

本基金本报告期末无未到期银行间市场债券正回购抵押债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无未到期交易所市场债券正回购抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

##### （1）风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

##### （2）投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度。

##### （3）监察稽核制度

公司设立督察长，负责监察稽核工作，督察长由总经理提名，经董事会聘任，对董事会负责。

除应当回避的情况外，督察长可以列席公司相关会议，调阅公司相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能。

督察长应当定期和不定期向董事会报告公司内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。

公司设立监察稽核部门，具体执行监察稽核工作。公司明确规定了监察稽核部门及内部各岗位的具体职责，严格审查监察稽核人员的专业任职条件，配备了充足的合格的监察稽核人员，明确规定了监察稽核的操作程序和组织纪律。

监察稽核制度包括检查公司业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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。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控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

##### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金报告期末及上年度末未持有短期信用评级的债券投资。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金报告期末及上年度末未持有短期信用评级的资产支持证券投资。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金报告期末及上年度末未持有短期信用评级的同业存单投资。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的债券投资。

##### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有长期信用评级的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，通过计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

##### 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《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、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存	9,682,121.31	-	-	-	9,682,121.31

款					
结算备付金	1,874.29	-	-	-	1,874.29
存出保证金	2,120,271.72	-	-	-	2,120,271.72
交易性金融资产	-	-	-	78,733,376.52	78,733,376.52
买入返售金融资产	-760.31	-	-	-	-760.31
应收股利	-	-	-	7,200.00	7,200.00
应收申购款	-	-	-	40,631.54	40,631.54
资产总计	11,803,507.01	-	-	78,781,208.06	90,584,715.07
负债					
应付清算款	-	-	-	168,581.32	168,581.32
应付赎回款	-	-	-	108,802.74	108,802.74
应付管理人报酬	-	-	-	116,486.48	116,486.48
应付托管费	-	-	-	19,414.43	19,414.43
应交税费	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	69,111.11	69,111.11
负债总计	-	-	-	482,396.29	482,396.29
利率敏感度缺口	11,803,507.01	-	-	78,298,811.77	90,102,318.78
上年度末 2022年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,537,366.02	-	-	-	15,537,366.02
结算备	3,005,659.52	-	-	-	3,005,659.52

付金					
存出保证金	4,531,608.39	-	-	-	4,531,608.39
交易性金融资产	-	-	-	96,719,822.68	96,719,822.68
买入返售金融资产	1,999,295.69	-	-	-	1,999,295.69
应收申购款	-	-	-	26,996.53	26,996.53
资产总计	25,073,929.62	-	-	96,746,819.21	121,820,748.83
负债					
应付清算款	-	-	-	3,657,238.42	3,657,238.42
应付赎回款	-	-	-	471,210.71	471,210.71
应付管理人报酬	-	-	-	163,183.99	163,183.99
应付托管费	-	-	-	27,197.33	27,197.33
应交税费	-	-	-	0.30	0.30
其他负债	-	-	-	15,912.42	15,912.42
负债总计	-	-	-	4,334,743.17	4,334,743.17
利率敏感度缺口	25,073,929.62	-	-	92,412,076.04	117,486,005.66

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照金融资产及金融负债的剩余到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

## 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06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				
交易性金融资产	-	15,625,599.5 2	-	15,625,599.5 2
应收股利	-	7,200.00	-	7,200.00
资产合计	-	15,632,799.5 2	-	15,632,799.5 2
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,632,799.5 2	-	15,632,799.5 2
项目	上年度末 2022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				
交易性金融资产	-	26,582,417.6 8	-	26,582,417.6 8
资产合计	-	26,582,417.6 8	-	26,582,417.6 8
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	26,582,417.6 8	-	26,582,417.6 8

## 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变
----	--------------

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	人民币对一揽子货币平均升值5%	-781,279.98	-1,329,120.88
人民币对一揽子货币平均贬值5%	781,279.98	1,329,120.88	

#### 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。本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。

##### 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 2023年06月30日		上年度末 2022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	78,733,376.52	87.38	96,719,822.68	82.32
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	78,733,376.52	87.38	96,719,822.68	82.32

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,173,187.33	1,369,624.48
	业绩比较基准下降5%	-2,173,187.33	-1,369,624.48

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金持有的股票、债券、基金和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

第一层次：如以活跃市场报价估值的股票投资、股指期货投资、国债期货投资、每日开放申赎/买卖的基金投资等；

第二层次：如因新发/增发尚未上市交易而按发行价格/增发价格估值的不限售的股票投资、债券投资等，使用第三方基准服务机构提供的报价估值的在交易所市场或银行间同业市场交易的债券投资、资产支持证券投资等；

第三层次：如使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期的股票投资，以及违约债、非指数收益法估值的长期停牌的股票等估值模型中使用不可观察输入值的投资等。

##### 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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	78,733,376.52	96,719,822.68
第二层次	-	-
第三层次	-	-

合计	78,733,376.52	96,719,822.68
----	---------------	---------------

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期未发生公允价值所属层次间的重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2023年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	78,733,376.52	86.92
	其中：股票	78,733,376.52	86.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	-760.31	0.00
	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	9,683,995.60	10.69

8	其他各项资产	2,168,103.26	2.39
9	合计	90,584,715.07	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	43,953,101.60	48.78
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	4,098,224.00	4.55
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	11,869,954.40	13.17
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	113,449.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,073,048.00	3.41
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	63,107,777.00	70.04

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例（%）
------	-----------	--------------

非日常生活消费品	1,541,530.91	1.71
医疗保健	6,957,212.60	7.72
工业	125,922.40	0.14
信息技术	1,799,532.95	2.00
通讯业务	5,201,400.66	5.77
合计	15,625,599.52	17.34

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	H02273	固生堂	100,000	4,601,723.00	5.11
2	002912	中新赛克	103,000	4,533,030.00	5.03
3	603345	安井食品	29,000	4,257,200.00	4.72
4	000596	古井贡酒	13,900	3,438,582.00	3.82
5	300592	华凯易佰	124,700	3,394,334.00	3.77
6	301391	卡莱特	27,700	3,245,609.00	3.60
7	688120	华海清科	12,760	3,216,158.00	3.57
8	H00772	阅文集团	93,000	2,837,281.67	3.15
9	300793	佳禾智能	134,700	2,724,981.00	3.02
10	002987	京北方	117,720	2,580,422.40	2.86
11	H00700	腾讯控股	7,700	2,364,118.99	2.62
12	H06078	海吉亚医疗	60,000	2,355,489.60	2.61
13	601138	工业富联	77,700	1,958,040.00	2.17
14	H03888	金山软件	63,000	1,799,532.95	2.00
15	002965	祥鑫科技	31,000	1,726,080.00	1.92
16	002517	恺英网络	107,700	1,695,198.00	1.88
17	001215	千味央厨	24,300	1,615,707.00	1.79
18	300693	盛弘股份	42,400	1,565,408.00	1.74
19	603198	迎驾贡酒	23,900	1,524,820.00	1.69

20	002439	启明星辰	50,000	1,488,000.00	1.65
21	300494	盛天网络	57,600	1,427,904.00	1.58
22	600537	亿晶光电	177,700	1,357,628.00	1.51
23	603369	今世缘	23,900	1,261,920.00	1.40
24	H03690	美团-W	11,000	1,245,613.27	1.38
25	603027	千禾味业	57,000	1,203,840.00	1.34
26	301039	中集车辆	53,300	705,159.00	0.78
26	H01839	中集车辆	67,000	421,840.04	0.47
27	603180	金牌厨柜	33,300	1,116,216.00	1.24
28	000860	顺鑫农业	29,900	1,007,331.00	1.12
29	300672	国科微	11,700	975,195.00	1.08
30	002159	三特索道	53,300	969,527.00	1.08
31	002371	北方华创	3,000	952,950.00	1.06
32	000888	峨眉山 A	78,800	903,048.00	1.00
33	002508	老板电器	33,300	842,157.00	0.93
34	688037	芯源微	4,700	803,465.00	0.89
35	688332	中科蓝讯	9,000	753,120.00	0.84
36	688409	富创精密	6,700	730,300.00	0.81
37	301376	致欧科技	29,700	703,890.00	0.78
38	001322	箭牌家居	42,000	703,080.00	0.78
39	603801	志邦家居	19,700	650,494.00	0.72
40	603199	九华旅游	17,900	618,445.00	0.69
41	002271	东方雨虹	21,400	583,364.00	0.65
42	603099	长白山	45,400	582,028.00	0.65
43	300438	鹏辉能源	11,300	542,852.00	0.60
44	002572	索菲亚	28,300	492,986.00	0.55
45	300274	阳光电源	4,000	466,520.00	0.52
46	688261	东微半导	3,300	461,571.00	0.51
47	300260	新莱应材	11,580	457,641.60	0.51
48	002959	小熊电器	5,300	442,550.00	0.49
49	688305	科德数控	3,400	340,884.00	0.38

50	002459	晶澳科技	8,000	333,600.00	0.37
51	603816	顾家家居	8,700	331,905.00	0.37
52	688516	奥特维	1,700	320,280.00	0.36
53	002472	双环传动	5,700	206,910.00	0.23
54	002139	拓邦股份	14,700	191,835.00	0.21
55	600446	金证股份	10,000	145,400.00	0.16
56	002011	盾安环境	10,000	138,300.00	0.15
57	600415	小商品城	13,300	113,449.00	0.13
58	300820	英杰电气	1,300	107,094.00	0.12
59	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.09
60	002847	盐津铺子	400	34,020.00	0.04
61	300308	中际旭创	200	29,490.00	0.03
62	603043	广州酒家	700	19,782.00	0.02
63	600702	舍得酒业	100	12,395.00	0.01
64	300394	天孚通信	100	10,683.00	0.01
65	002511	中顺洁柔	700	7,805.00	0.01

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002965	祥鑫科技	20,448,988.00	17.41
2	002335	科华数据	17,877,556.00	15.22
3	002508	老板电器	14,961,827.03	12.73
4	600537	亿晶光电	14,073,439.92	11.98
5	688120	华海清科	13,417,225.08	11.42
6	688063	派能科技	13,379,746.95	11.39
7	605117	德业股份	13,118,614.00	11.17
8	000860	顺鑫农业	12,979,966.16	11.05
9	600138	中青旅	12,930,225.00	11.01

10	603180	金牌厨柜	12,561,367.28	10.69
11	603136	天目湖	11,771,432.00	10.02
12	601138	工业富联	11,617,561.00	9.89
13	688037	芯源微	11,325,581.96	9.64
14	600054	黄山旅游	11,301,202.50	9.62
15	002371	北方华创	11,119,093.66	9.46
16	603198	迎驾贡酒	11,114,308.00	9.46
17	002236	大华股份	11,097,135.00	9.45
18	002043	兔宝宝	10,723,167.00	9.13
19	000888	峨眉山 A	10,462,558.00	8.91
20	688516	奥特维	10,370,397.56	8.83
21	603801	志邦家居	9,996,584.64	8.51
22	603199	九华旅游	9,394,600.00	8.00
23	300693	盛弘股份	9,259,418.00	7.88
24	002572	索菲亚	9,132,269.00	7.77
25	600197	伊力特	9,097,412.24	7.74
26	603019	中科曙光	8,755,917.00	7.45
27	002271	东方雨虹	8,744,099.00	7.44
28	002555	三七互娱	8,696,624.00	7.40
29	688390	固德威	8,595,206.81	7.32
30	000988	华工科技	8,357,361.00	7.11
31	300251	光线传媒	8,272,266.23	7.04
32	603369	今世缘	8,263,545.61	7.03
33	300308	中际旭创	8,258,605.00	7.03
34	688032	禾迈股份	8,200,483.34	6.98
35	000568	泸州老窖	8,154,785.50	6.94
36	603043	广州酒家	7,885,325.00	6.71
37	002624	完美世界	7,828,174.00	6.66
38	300788	中信出版	7,772,313.00	6.62
39	300763	锦浪科技	7,751,774.00	6.60
40	300750	宁德时代	7,687,563.60	6.54

41	300672	国科微	7,682,150.72	6.54
42	002987	京北方	7,659,727.08	6.52
43	300438	鹏辉能源	7,654,095.80	6.51
44	300592	华凯易佰	7,643,971.40	6.51
45	600702	舍得酒业	7,560,210.00	6.43
46	688332	中科蓝讯	7,460,931.81	6.35
47	688223	晶科能源	7,367,401.25	6.27
48	H03690	美团-W	7,281,118.90	6.20
49	002865	钧达股份	7,258,589.65	6.18
50	001215	千味央厨	7,227,067.58	6.15
51	688579	山大地纬	7,200,417.50	6.13
52	002044	美年健康	7,123,097.00	6.06
53	000596	古井贡酒	7,090,034.00	6.03
54	601360	三六零	7,062,208.91	6.01
55	688676	金盘科技	7,058,493.83	6.01
56	002511	中顺洁柔	6,980,300.00	5.94
57	300494	盛天网络	6,804,775.00	5.79
58	301039	中集车辆	6,755,315.97	5.75
59	300058	蓝色光标	6,690,866.00	5.70
60	688566	吉贝尔	6,637,569.25	5.65
61	002912	中新赛克	6,634,880.00	5.65
62	H00700	腾讯控股	6,450,468.13	5.49
63	002518	科士达	6,445,680.00	5.49
64	000786	北新建材	6,417,999.00	5.46
65	603027	千禾味业	6,338,081.77	5.39
66	000729	燕京啤酒	6,263,492.00	5.33
67	688348	昱能科技	6,235,466.59	5.31
68	300846	首都在线	6,126,685.00	5.21
69	603636	南威软件	6,090,509.00	5.18
70	002334	英威腾	6,026,607.00	5.13
71	688305	科德数控	5,933,775.59	5.05

72	002487	大金重工	5,787,275.64	4.93
73	300364	中文在线	5,709,811.00	4.86
74	688409	富创精密	5,691,099.04	4.84
75	000970	中科三环	5,689,141.00	4.84
76	003000	劲仔食品	5,585,120.00	4.75
77	002991	甘源食品	5,574,381.00	4.74
78	002475	立讯精密	5,553,630.00	4.73
79	300820	英杰电气	5,552,774.00	4.73
80	002463	沪电股份	5,533,919.20	4.71
81	600600	青岛啤酒	5,486,957.00	4.67
82	002011	盾安环境	5,478,420.00	4.66
83	603690	至纯科技	5,401,673.00	4.60
84	002368	太极股份	5,382,370.88	4.58
85	603517	绝味食品	5,331,015.68	4.54
86	000002	万科 A	5,314,389.56	4.52
87	002459	晶澳科技	5,299,935.20	4.51
88	301391	卡莱特	5,271,671.52	4.49
89	300911	亿田智能	5,210,507.00	4.44
90	603919	金徽酒	5,187,742.00	4.42
91	002739	万达电影	5,154,234.00	4.39
92	603605	珀莱雅	4,962,127.00	4.22
93	688401	路维光电	4,921,980.98	4.19
94	000858	五粮液	4,911,209.00	4.18
95	688262	国芯科技	4,909,983.49	4.18
96	300793	佳禾智能	4,886,864.00	4.16
97	300894	火星人	4,870,217.80	4.15
98	300274	阳光电源	4,825,317.00	4.11
99	002635	安洁科技	4,782,421.00	4.07
100	600298	安琪酵母	4,769,305.00	4.06
101	600559	老白干酒	4,661,857.00	3.97
102	002837	英维克	4,621,095.27	3.93

103	002439	启明星辰	4,614,026.00	3.93
104	300887	谱尼测试	4,607,152.00	3.92
105	H03888	金山软件	4,596,768.16	3.91
106	688556	高测股份	4,496,776.81	3.83
107	688072	拓荆科技	4,394,134.21	3.74
108	002159	三特索道	4,342,949.00	3.70
109	300118	东方日升	4,305,483.00	3.66
110	300133	华策影视	4,255,134.00	3.62
111	300129	泰胜风能	4,226,413.38	3.60
112	000799	酒鬼酒	4,130,014.00	3.52
113	601888	中国中免	4,094,544.00	3.49
114	002990	盛视科技	4,074,666.00	3.47
115	605009	豪悦护理	4,066,394.00	3.46
116	000403	派林生物	4,010,864.00	3.41
117	688012	中微公司	3,965,369.65	3.38
118	600487	亨通光电	3,870,900.00	3.29
119	002600	领益智造	3,861,716.00	3.29
120	688158	优刻得	3,846,207.01	3.27
121	300433	蓝思科技	3,806,980.00	3.24
122	000831	中国稀土	3,786,759.00	3.22
123	300724	捷佳伟创	3,734,489.00	3.18
124	600977	中国电影	3,724,516.00	3.17
125	600779	水井坊	3,715,852.00	3.16
126	000333	美的集团	3,704,544.00	3.15
127	001322	箭牌家居	3,698,362.00	3.15
128	688082	盛美上海	3,692,996.62	3.14
129	002268	电科网安	3,627,215.12	3.09
130	688363	华熙生物	3,566,626.78	3.04
131	300957	贝泰妮	3,508,484.00	2.99
132	603533	掌阅科技	3,504,353.00	2.98
133	605089	味知香	3,434,725.00	2.92

134	300394	天孚通信	3,431,917.69	2.92
135	601186	中国铁建	3,429,715.00	2.92
136	300972	万辰生物	3,427,348.00	2.92
137	H06049	保利物业	3,415,054.49	2.91
138	688686	奥普特	3,406,979.32	2.90
139	301177	迪阿股份	3,384,973.41	2.88
140	601766	中国中车	3,356,280.00	2.86
141	000034	神州数码	3,320,726.00	2.83
142	688218	江苏北人	3,294,881.24	2.80
143	688665	四方光电	3,289,914.82	2.80
144	002916	深南电路	3,259,384.28	2.77
145	688700	东威科技	3,253,435.06	2.77
146	300900	广联航空	3,235,778.00	2.75
147	600859	王府井	3,181,352.86	2.71
148	003043	华亚智能	3,154,152.00	2.68
149	300990	同飞股份	3,139,413.00	2.67
150	300624	万兴科技	3,126,754.00	2.66
151	000977	浪潮信息	3,101,615.00	2.64
152	300986	志特新材	3,088,887.00	2.63
153	300014	亿纬锂能	3,077,777.00	2.62
154	002847	盐津铺子	3,071,216.00	2.61
155	603032	德新交运	3,066,637.00	2.61
156	002517	恺英网络	3,065,216.00	2.61
157	600732	爱旭股份	3,057,752.00	2.60
158	603345	安井食品	3,043,094.00	2.59
159	H00751	创维集团	3,021,163.19	2.57
160	H01797	东方甄选	2,994,307.11	2.55
161	301266	宇邦新材	2,987,561.00	2.54
162	688095	福昕软件	2,985,759.45	2.54
163	603589	口子窖	2,980,420.00	2.54
164	002782	可立克	2,959,931.66	2.52

165	000524	岭南控股	2,922,265.00	2.49
166	301278	快可电子	2,912,611.00	2.48
167	H00772	阅文集团	2,847,993.21	2.42
168	002184	海得控制	2,789,799.66	2.37
169	300490	华自科技	2,787,837.00	2.37
170	600641	万业企业	2,742,093.00	2.33
171	300170	汉得信息	2,727,437.00	2.32
172	000651	格力电器	2,697,370.00	2.30
173	003012	东鹏控股	2,687,848.00	2.29
174	002230	科大讯飞	2,676,021.00	2.28
175	301205	联特科技	2,651,752.00	2.26
176	H01024	快手-W	2,634,319.90	2.24
177	002531	天顺风能	2,623,451.00	2.23
178	600519	贵州茅台	2,613,928.00	2.22
179	600745	闻泰科技	2,610,008.00	2.22
180	000910	大亚圣象	2,593,836.00	2.21
181	H00520	呷哺呷哺	2,589,853.21	2.20
182	300428	立中集团	2,464,174.00	2.10
183	688111	金山办公	2,463,562.60	2.10
184	603305	旭升股份	2,456,673.97	2.09
185	688208	道通科技	2,437,206.12	2.07
186	603650	彤程新材	2,402,304.00	2.04
187	002850	科达利	2,377,152.00	2.02

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值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	002965	祥鑫科技	23,455,636.10	19.96

2	002335	科华数据	18,522,085.61	15.77
3	688063	派能科技	16,667,993.51	14.19
4	002043	兔宝宝	16,640,019.40	14.16
5	603198	迎驾贡酒	14,878,067.98	12.66
6	002508	老板电器	14,296,510.00	12.17
7	688037	芯源微	14,032,293.62	11.94
8	688120	华海清科	13,398,010.60	11.40
9	600138	中青旅	13,190,064.00	11.23
10	605117	德业股份	12,849,610.00	10.94
11	600537	亿晶光电	12,659,709.00	10.78
12	603136	天目湖	12,303,457.00	10.47
13	688516	奥特维	11,651,196.94	9.92
14	000860	顺鑫农业	11,576,356.00	9.85
15	603180	金牌厨柜	11,529,648.10	9.81
16	600054	黄山旅游	11,398,466.00	9.70
17	603369	今世缘	11,132,185.00	9.48
18	600702	舍得酒业	11,000,852.00	9.36
19	002236	大华股份	10,905,281.97	9.28
20	601138	工业富联	10,858,287.00	9.24
21	300820	英杰电气	10,789,415.00	9.18
22	300438	鹏辉能源	10,335,032.38	8.80
23	002371	北方华创	10,311,746.00	8.78
24	603801	志邦家居	10,259,282.00	8.73
25	000888	峨眉山 A	9,709,040.00	8.26
26	603199	九华旅游	9,065,257.00	7.72
27	600197	伊力特	8,947,639.00	7.62
28	002555	三七互娱	8,889,326.00	7.57
29	002572	索菲亚	8,815,205.00	7.50
30	000988	华工科技	8,775,134.96	7.47
31	603019	中科曙光	8,631,070.00	7.35
32	300308	中际旭创	8,400,666.20	7.15

33	688390	固德威	8,308,375.82	7.07
34	300788	中信出版	8,137,683.36	6.93
35	002865	钧达股份	8,116,733.21	6.91
36	000568	泸州老窖	7,943,975.00	6.76
37	688032	禾迈股份	7,903,800.55	6.73
38	002271	东方雨虹	7,882,021.00	6.71
39	002624	完美世界	7,850,572.00	6.68
40	300251	光线传媒	7,827,069.00	6.66
41	603043	广州酒家	7,759,121.00	6.60
42	300763	锦浪科技	7,716,019.00	6.57
43	300693	盛弘股份	7,605,449.00	6.47
44	300750	宁德时代	7,518,789.80	6.40
45	H03690	美团-W	7,505,788.49	6.39
46	688579	山大地纬	7,276,392.63	6.19
47	002044	美年健康	7,250,318.00	6.17
48	688223	晶科能源	7,178,868.97	6.11
49	601360	三六零	7,025,671.00	5.98
50	002511	中顺洁柔	6,927,633.00	5.90
51	000786	北新建材	6,822,318.46	5.81
52	002518	科士达	6,821,343.00	5.81
53	688072	拓荆科技	6,699,850.45	5.70
54	688332	中科蓝讯	6,699,203.08	5.70
55	300058	蓝色光标	6,654,753.00	5.66
56	H06049	保利物业	6,598,855.23	5.62
57	688566	吉贝尔	6,533,739.89	5.56
58	688556	高测股份	6,454,993.25	5.49
59	300672	国科微	6,451,631.00	5.49
60	688676	金盘科技	6,417,498.19	5.46
61	000729	燕京啤酒	6,264,114.00	5.33
62	300846	首都在线	6,212,616.00	5.29
63	H00700	腾讯控股	6,120,861.69	5.21

64	301039	中集车辆	6,044,863.15	5.15
65	002334	英威腾	6,012,227.00	5.12
66	603636	南威软件	5,957,574.00	5.07
67	688348	昱能科技	5,943,133.97	5.06
68	300364	中文在线	5,825,922.00	4.96
69	300494	盛天网络	5,766,109.00	4.91
70	688262	国芯科技	5,743,621.76	4.89
71	688401	路维光电	5,717,914.38	4.87
72	002487	大金重工	5,704,839.00	4.86
73	002463	沪电股份	5,689,627.00	4.84
74	000002	万科A	5,671,795.80	4.83
75	000970	中科三环	5,597,041.68	4.76
76	002475	立讯精密	5,524,138.00	4.70
77	603605	珀莱雅	5,494,915.03	4.68
78	603690	至纯科技	5,438,443.85	4.63
79	002368	太极股份	5,426,237.96	4.62
80	001215	千味央厨	5,409,796.00	4.60
81	688305	科德数控	5,402,706.48	4.60
82	003000	劲仔食品	5,340,764.00	4.55
83	002991	甘源食品	5,320,485.00	4.53
84	688409	富创精密	5,316,546.84	4.53
85	600600	青岛啤酒	5,311,256.89	4.52
86	001269	欧晶科技	5,165,457.00	4.40
87	603517	绝味食品	5,156,915.00	4.39
88	002011	盾安环境	5,142,429.00	4.38
89	300260	新莱应材	5,095,212.00	4.34
90	300911	亿田智能	5,004,268.00	4.26
91	002739	万达电影	4,984,923.00	4.24
92	002459	晶澳科技	4,972,711.00	4.23
93	603919	金徽酒	4,956,996.00	4.22
94	603027	千禾味业	4,954,128.00	4.22

95	002987	京北方	4,922,052.00	4.19
96	002635	安洁科技	4,915,880.00	4.18
97	000858	五粮液	4,902,387.50	4.17
98	600298	安琪酵母	4,750,680.00	4.04
99	300894	火星人	4,664,646.00	3.97
100	600732	爱旭股份	4,611,093.00	3.92
101	600559	老白干酒	4,544,972.16	3.87
102	300887	谱尼测试	4,535,202.00	3.86
103	300592	华凯易佰	4,502,127.00	3.83
104	002837	英维克	4,500,501.00	3.83
105	300274	阳光电源	4,467,793.00	3.80
106	H00168	青岛啤酒股份	4,405,299.08	3.75
107	688700	东威科技	4,367,577.09	3.72
108	300129	泰胜风能	4,255,597.00	3.62
109	300133	华策影视	4,221,039.20	3.59
110	300118	东方日升	4,189,504.00	3.57
111	688012	中微公司	4,174,868.62	3.55
112	002600	领益智造	4,135,384.91	3.52
113	601888	中国中免	4,102,821.00	3.49
114	000831	中国稀土	4,097,543.00	3.49
115	002990	盛视科技	4,075,320.00	3.47
116	605009	豪悦护理	4,008,324.00	3.41
117	000403	派林生物	3,954,061.00	3.37
118	000596	古井贡酒	3,926,847.00	3.34
119	300433	蓝思科技	3,924,374.00	3.34
120	688158	优刻得	3,888,968.77	3.31
121	600487	亨通光电	3,868,795.00	3.29
122	600779	水井坊	3,823,365.00	3.25
123	000799	酒鬼酒	3,815,605.00	3.25
124	301177	迪阿股份	3,799,549.00	3.23

125	600977	中国电影	3,685,540.28	3.14
126	688218	江苏北人	3,667,482.32	3.12
127	000333	美的集团	3,663,892.00	3.12
128	H00291	华润啤酒	3,645,186.43	3.10
129	002268	电科网安	3,641,160.36	3.10
130	688082	盛美上海	3,607,295.70	3.07
131	300394	天孚通信	3,587,254.00	3.05
132	300724	捷佳伟创	3,574,917.00	3.04
133	603533	掌阅科技	3,562,415.38	3.03
134	300990	同飞股份	3,541,276.00	3.01
135	300972	万辰生物	3,482,415.00	2.96
136	601186	中国铁建	3,478,505.00	2.96
137	000034	神州数码	3,444,756.00	2.93
138	688363	华熙生物	3,433,618.44	2.92
139	002159	三特索道	3,407,508.00	2.90
140	688686	奥普特	3,406,643.16	2.90
141	300957	贝泰妮	3,394,223.00	2.89
142	605089	味知香	3,364,758.00	2.86
143	002916	深南电路	3,325,170.00	2.83
144	601766	中国中车	3,316,775.00	2.82
145	300900	广联航空	3,278,582.00	2.79
146	603345	安井食品	3,264,933.00	2.78
147	H00751	创维集团	3,260,668.43	2.78
148	300624	万兴科技	3,246,661.00	2.76
149	688665	四方光电	3,236,011.92	2.75
150	000977	浪潮信息	3,221,194.00	2.74
151	300986	志特新材	3,208,152.00	2.73
152	600859	王府井	3,195,049.00	2.72
153	H06078	海吉亚医疗	3,190,879.66	2.72
154	H01951	锦欣生殖	3,186,352.58	2.71

155	H09922	九毛九	3,154,586.27	2.69
156	300014	亿纬锂能	3,141,700.00	2.67
157	003043	华亚智能	3,098,782.00	2.64
158	H03888	金山软件	3,082,799.11	2.62
159	688095	福昕软件	3,036,526.41	2.58
160	002782	可立克	2,993,215.75	2.55
161	002847	盐津铺子	2,943,472.00	2.51
162	603589	口子窖	2,919,684.00	2.49
163	001322	箭牌家居	2,917,003.00	2.48
164	000524	岭南控股	2,913,696.00	2.48
165	301266	宇邦新材	2,905,010.00	2.47
166	002439	启明星辰	2,904,464.00	2.47
167	603032	德新交运	2,896,004.00	2.46
168	301278	快可电子	2,879,412.00	2.45
169	300170	汉得信息	2,745,545.00	2.34
170	002230	科大讯飞	2,737,467.00	2.33
171	002184	海得控制	2,703,309.00	2.30
172	600641	万业企业	2,686,420.00	2.29
173	688111	金山办公	2,666,480.98	2.27
174	002531	天顺风能	2,663,472.00	2.27
175	000651	格力电器	2,649,034.00	2.25
176	300490	华自科技	2,646,920.00	2.25
177	000910	大亚圣象	2,643,284.00	2.25
178	003012	东鹏控股	2,638,600.00	2.25
179	600519	贵州茅台	2,614,706.00	2.23
180	H00520	呷哺呷哺	2,604,162.20	2.22
181	301205	联特科技	2,584,498.00	2.20
182	600745	闻泰科技	2,571,546.00	2.19
183	H01024	快手-W	2,554,332.01	2.17
184	603650	彤程新材	2,484,293.18	2.11
185	603305	旭升股份	2,479,589.67	2.11

186	688208	道通科技	2,419,884.85	2.06
187	300428	立中集团	2,408,579.00	2.05

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	1,323,173,946.84
卖出股票收入（成交）总额	1,335,773,671.56

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券投资。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金报告期末未持有债券投资。

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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金参与股指期货交易，将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其理估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

本基金股指期货交易符合基金合同有关约定，股指期货交易符合既定的投资政策和投资目标。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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，卡莱特科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳市公安局南山分局的处罚，华海清科股份有限公司在报告编制日前一年内曾收到上海证券交易所的监管工作函。

本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,120,271.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	7,200.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	40,631.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,168,103.26

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中无流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

**§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
1,881	55,157.17	16,436,061.48	15.84%	87,314,584.13	84.16%

**8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	4,762,623.76	4.59%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日(2022年06月16日)基金份额总额	275,837,112.01
本报告期期初基金份额总额	123,285,791.09
本报告期基金总申购份额	21,347,576.26

减：本报告期基金总赎回份额	40,882,721.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	103,750,645.61

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

基金托管人于2023年5月17日发布公告，自2023年5月10日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自2023年5月10日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

### 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、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
国金证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	3	886,961,392.26	33.36%	732,776.86	36.13%	-
申万宏源	3	1,771,986,226.14	66.64%	1,295,308.80	63.87%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	8,200,000.00	4.97%	-	-	-	-
申万宏源	62,665.00	100.00%	156,700,000.00	95.03%	-	-	-	-

注：本基金采用“第三方存管”模式进行管理，与托管银行、券商签订三方存管协议，指定三方在基金投资与交易中的管理范围和职责，基金租用券商席位，券商主要负责基金在场内（上交所、深交所）各项交易和清算，并按协议约定收取佣金。

1、本基金管理人证券经纪商的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下T+0估值的时效性要求。

2、基金专用交易单元的选择程序：

本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定证券经营机构，然后基金管理人、基金托管人和证券经纪商签订证券经纪服务协议。

3、报告期内使用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内停用安信证券2个席位，增加国金证券2个席位。

**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	百嘉基金管理有限公司旗下开放式基金增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	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	2023-01-09
2	百嘉基金管理有限公司旗下基金2022年第4季度报告提示性公告	证券时报	2023-01-18
3	百嘉百盛混合型证券投资基金2022年第4季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
4	百嘉基金管理有限公司旗下基金2022年年度报告提示性公告	证券时报	2023-03-29
5	百嘉百盛混合型证券投资基金2022年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
6	百嘉基金管理有限公司旗下基金2023年第1季度报告提示性公告	证券时报	2023-04-20
7	百嘉百盛混合型证券投资基金2023年第1季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-20
8	百嘉基金管理有限公司旗下基金增加阳光人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	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	2023-06-09

**§11 影响投资者决策的其他重要信息****11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

本基金的特定风险

## 1、资产配置风险

本基金股票资产占基金资产的比例为60%-95%，属于股票仓位偏高且相对稳定的基金品种，受股票市场系统性风险影响较大，如果股票市场出现整体下跌，本基金的净值表现将受到影响，投资者面临无法获得收益甚至可能发生较大亏损的风险。

## 2、资产支持证券投资风险

本基金将资产支持证券纳入到投资范围当中，可能带来以下风险：

(1) 信用风险：基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降，造成基金财产损失。

(2) 利率风险：市场利率波动会导致资产支持证券的收益率和价格的变动，一般而言，如果市场利率上升，本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险，而如果市场利率下降，资产支持证券利息的再投资收益将面临下降的风险。

(3) 流动性风险：受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险。

(4) 提前偿付风险：债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付，从而使基金资产面临再投资风险。

(5) 操作风险：基金相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、交易错误、IT系统故障等风险。

(6) 法律风险：由于法律法规方面的原因，某些市场行为受到限制或合同不能正常执行，导致基金财产损失。

## 3、投资国债期货的风险

### (1) 流动性风险

本基金在国债期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓国债期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。

### (2) 基差风险

国债期货基差是指国债现货价格与国债期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本基金投资产生影响。

### (3) 合约展期风险

本基金所投资的国债期货合约主要包括国债期货当月和近月合约。当本基金所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。

### (4) 国债期货保证金不足风险

由于国债期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，国债期货头寸将被强行平仓，直接影响本基金收益水平，从而产生风险。

#### （5）杠杆风险

国债期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，本基金可能承受超出保证金甚至委托财产本金的损失。

#### 4、投资港股通标的股票的风险

（1）本基金将通过港股通机制投资于香港市场，在市场环境、市场进入、投资额度、可投资对象、税务政策、市场制度等方面都有一定的限制，而且此类限制可能会不断调整，这些限制因素的变化可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍，从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

（2）香港市场交易规则有别于内地A股市场规则，此外，在港股通机制下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

①香港市场证券实行T+0回转交易，且对个股交易价格并无涨跌幅上下限的规定，因此每日涨跌幅空间相对较大，港股也可能表现出比A股更为剧烈的股价波动；

②只有沪港深三地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，因此在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险；

③香港出现台风、黑色暴雨或者联交所规定的其他情形时，联交所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险；

④投资者因港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入，内地证券交易所另有规定的除外；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出；

⑤代理投票。由于中国结算是汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿，中国结算对投资者设定的意愿征集期比香港结算的征集期稍早结束；投票没有权益登记日的，以投票截止日的持有作为计算基准；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数；

（3）港股交易失败风险：港股通业务试点期间存在每日额度。在香港联合交易所有限公司开市前阶段，当日额度使用完毕的，新增的买单申报将面临失败的风险；在联交所持续交易时段，当日额度使用完毕的，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

#### 5、投资股指期货特有的风险

(1) 杠杆风险：因股指期货采用保证金交易而存在杠杆，基金财产可能因此产生更大的收益波动。

(2) 基差风险：在利用股指期货对冲市场系统风险时，基金资产可能因为股指期货合约与标的指数价格变动方向不一致而承担基差风险。因存在基差风险，在股指期货合约展期操作时，基金资产可能因股指期货合约之间价差的异常变动而遭受展期风险。

(3) 股指期货展期时的流动性风险：本基金持有的股指期货头寸需要进行展期操作，平仓持有的股指期货合约，换成其他月份股指期货合约，当股指期货市场流动性不佳、交易量不足时，将会导致展期操作执行难度提高、交易成本增加，从而可能对基金资产造成不利的影响。

(4) 期货盯视结算制度带来的现金管理风险：股指期货采取保证金交易制度，保证金账户实行当日无负债结算制度，资金管理要求高。当市场持续向不利方向波动导致期货保证金不足，如果未能在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，可能给基金资产带来超出预期的损失。

(5) 到期日风险：股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险。

(6) 对手方风险：资产管理人运用基金资产投资于股指期货时，会尽力选择资信状态优良、风险控制能力强的期货公司作为经纪商，但不能杜绝在极端情况下，所选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为或破产清算导致基金资产遭受损失。

(7) 连带风险：为基金资产进行结算的结算会员或该结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中金所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，基金资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

(8) 未平仓合约不能继续持有风险：由于国家法律、法规、政策的变化、中金所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，基金资产持有的未平仓合约可能无法继续持有，基金资产必须承担由此导致的损失。

## 6、投资于存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

7、汇率风险：本基金将投资港股通标的股票，在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率。港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险，汇率波动可能对基金的投资收益造成损失。

#### 8、可转换债券（可交换公司债）投资风险

利息损失风险：当可转债正股股价下跌到转换价格以下时，可转债投资者被迫转为债券投资者。因可转债利率一般低于同等级的普通债券利率，所以会给投资者带来利息损失。

公司经营风险（信用风险）：可转换债券（可交换公司债）的发行主体是上市公司（上市公司股东）本身。如果可转换债券（可交换公司债）在存续期间，上市公司或其股东存在较大的经营风险或偿债能力风险时，对可转换债券（可交换公司债）的价格冲击较大。

提前赎回风险：可转换债券（可交换公司债）都规定了发行人可以在满足特定条件后，以某一价格强制赎回债券。当发行人发布强制赎回公告后，投资者未在规定时间内申请转股，将被以赎回价强制赎回，可能遭受损失。

#### 9、参与融资业务的风险

本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资业务，可能存在杠杆投资风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

以上所述因素可能会给本基金投资带来特殊交易风险。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予百嘉百盛混合型证券投资基金注册的文件
- 2、《百嘉百盛混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《百嘉百盛混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《百嘉百盛混合型证券投资基金的法律意见书》

### 12.2 存放地点

广州市天河区花城大道769号广州嘉昱中心10楼。

### 12.3 查阅方式

投资人可在办公时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

百嘉基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十日