

嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金 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	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
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

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	48
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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 盈利投资者数量占比	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	50
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	51
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	53
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉实绿色主题股票发起式	
基金主代码	017744	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 17 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	1,125,844,596.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	嘉实绿色主题股票发起式 A	嘉实绿色主题股票发起式 C
下属分级基金的交 易代码	017744	017745
报告期末下属分级 基金的份额总额	72,265,077.31 份	1,053,579,519.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力争在严格控制风险的前提下，通过系统化研究挖掘兼具竞争力和成长潜力的优质上市公司进行投资，力争实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金将根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、市场面、政策面等多种因素的综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，以确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。 本基金根据绿色主题范畴选出备选股票池，并在此基础上通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘优质的上市公司，构建股票投资组合。 具体投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略（绿色主题的界定、个股精选策略、港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略）、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资策略、风险管理策略等。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×80%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	嘉实基金管理有限公司		中国银行股份有限公司
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 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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	嘉实绿色主题股票发起式 A	嘉实绿色主题股票发起式 C
本期已实现收益	5,884,731.46	38,541,042.49
本期利润	105,504,799.10	874,773,384.38
加权平均基金份 额本期利润	1.7230	2.0005
本期加权平均净 值利润率	92.42%	102.54%
本期基金份额净 值增长率	134.46%	133.75%

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	26,475,360.58	357,489,754.95
期末可供分配基金份额利润	0.3664	0.3393
期末基金资产净值	220,654,824.51	3,153,087,338.06
期末基金份额净值	3.0534	2.9927
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	205.34%	199.27%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实绿色主题股票发起式 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	112.77%	3.03%	10.16%	1.14%	102.61%	1.89%
过去六个月	134.46%	2.89%	7.93%	1.08%	126.53%	1.81%
过去一年	197.86%	2.60%	25.61%	0.96%	172.25%	1.64%
过去三年	240.82%	2.32%	32.38%	1.03%	208.44%	1.29%
自基金合同生效起	205.34%	2.25%	25.32%	1.01%	180.02%	1.24%

至今					%	
----	--	--	--	--	---	--

嘉实绿色主题股票发起式 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	112.43%	3.02%	10.16%	1.14%	102.27%	1.88%
过去六个月	133.75%	2.89%	7.93%	1.08%	125.82%	1.81%
过去一年	196.07%	2.59%	25.61%	0.96%	170.46%	1.63%
过去三年	234.75%	2.32%	32.38%	1.03%	202.37%	1.29%
自基金合同生效起至今	199.27%	2.25%	25.32%	1.01%	173.95%	1.24%

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：

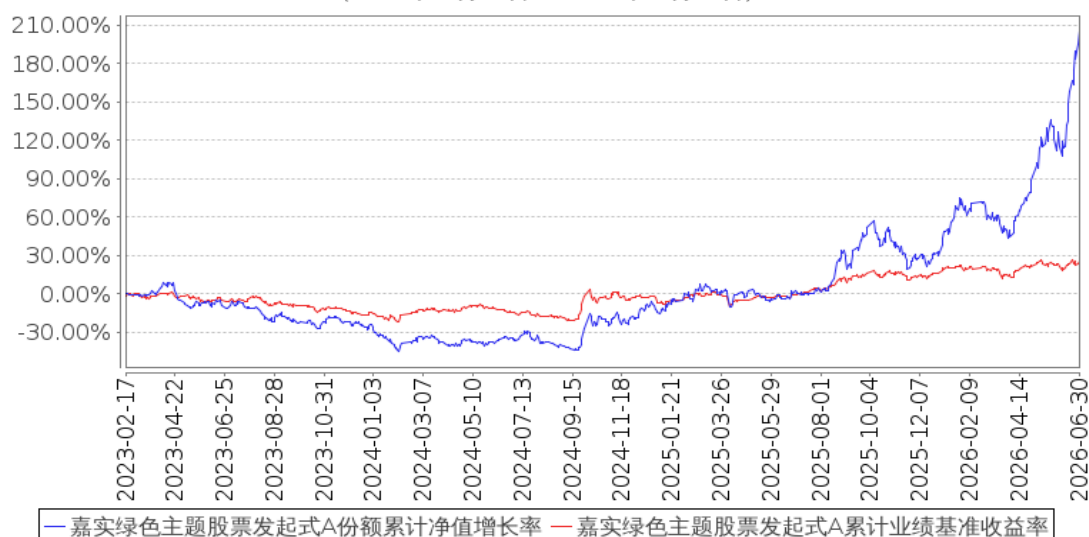
$$\begin{aligned} \text{Return}(t) &= 80\% \times (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 10\% \times (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 10\% \times (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) \\ \text{Benchmark}(t) &= (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1 \end{aligned}$$

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

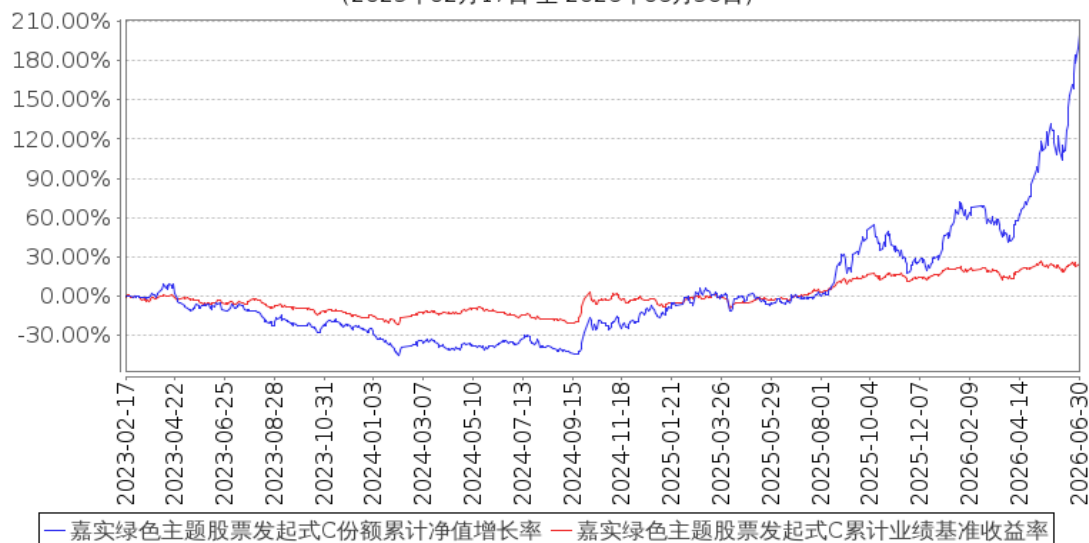
嘉实绿色主题股票发起式A份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023年02月17日至2026年06月30日)



嘉实绿色主题股票发起式C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02月17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		
蔡丞丰	本基金、嘉实品质发现混合、嘉实 ESG 可持续投资混合基金经理	2023 年 2 月 17 日	-	18 年	曾任台湾联越企业顾问有限公司、台湾华彦资产管理有限公司、北京阳光保险资管研究员，台湾全球人寿、北京金石中睿投资管理有限公司投资经理，泓德基金管理有限公司基金经理。2021 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司，从事股票研究工作。硕士研究生，具有基金从业资格。中国台湾籍。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的，合计 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

一、上半年市场环境回顾

2026 年上半年，A 股走出一轮高度分化的“K 型行情”：新动能抢跑，资源品接力，广谱消费缺席；上证呈现慢牛，科技演绎快牛，多数个股实则下跌。一级行业中仅少数录得正收益，涨幅高度集中于电子与通信。市场成交屡创天量，说明资金从来不缺；真正稀缺的，是能够持续上修盈利预期的产业与公司。上半年不是普遍牛市，而是一轮由流动性放大了盈利稀缺性的结构牛市——而半导体，正处在风暴眼。

产业层面最重要的变化，是 AI 需求从“模型推理”向“智能体”的大规模扩散：一季度推理端应用的爆发验证了算力消耗由一次性工程转向持续运营，需求沿“一阶算力向二阶内存与互连扩散”演进；二季度大模型走向多步推理与多工具自主调用，服务器内部互联与内存扩展的需求被推向新高度。与此同时，国产模型以“够用且便宜”的姿态进入全球开发者的真实工作流，开源权重的领先窗口被压缩至数月，既动摇了海外前沿实验室的估值信心，也为国产算力打开了真实需求空间。

资金层面，二季度对科技主线的聚焦达到前所未有的程度，电子板块总市值一度超越金融跃居全市场之首。就估值而言，我们倾向于认为半导体当前所处的位置更接近 1999 年而非 2000 年——创新远未停滞、资金约束尚不构成实质威胁，产业周期并未走完。但当估值倍数的收缩幅度超过盈利超预期的幅度，股价便会下跌，叙事动能的减弱本身即足以引发调整。这不单是价格方

向的问题，更是波动性显著加剧的问题。因此上半年我们的重心并非在高位加码，而是反复确认兑现路径，并对拥挤交易保持戒备。

二、上半年投资策略与运作回顾

贯穿上半年的框架，仍是我们既定的“寻找爆款”第一性原则：依托独有的“企业家评分模型”，对企业的商业模式、创新能力、投入产出效率与公司治理进行穿透式研究。落到运作上，组合围绕四条线索展开——把握国产算力的兑现窗口，坚守存储核心底仓但正视其内在矛盾，前瞻布局模拟芯片卡位 AI 光通讯的爆品机会，并以半导体材料锚定本土扩产的刚性需求。二季度组合未作明显调整，这不是被动，而是前瞻布局完成后的定力：所持方向兑现路径清晰、估值相对合理，我们选择以“持有等待兑现”替代“频繁调仓”。

1. 国产算力：必要条件已经齐备，兑现窗口正在开启

我们判断，2026 至 2028 年是国产算力从“逻辑演绎”走向“订单与业绩兑现”的关键窗口，上半年的进展已使必要条件基本齐备。产能上，国产先进制程产线的良率爬坡已能支撑千万颗量级的 AI 芯片供给；技术上，产业界通过先进封装、逻辑折叠与垂直堆叠，在不依赖最先进光刻设备的前提下走出了可持续的等效密度演进路线；订单上，头部厂商已与主要云厂商签订具约束力的供应协议，出货能见度延伸至 2028 年。瓶颈正从“做不做得出来”转向“交付节奏与产能爬坡”。

需求侧同样在强化。国产大模型在智能体与编码等真实任务上已进入“够用”区间，而价格仅为全球顶级模型的一小部分，“够用且便宜”正是走向全球采用的临界点。更重要的是杰文斯悖论：更廉价的智能降低了企业部署的回报门槛，反而放大推理用量的深度与广度。叠加智能体渗透率与芯片国产化率被写入政策目标——按当前指引，2028 年云厂商采购国产 AI 芯片有望接近其 AI 资本开支的一半——需求确定性与供给可得性正在同步改善。资本市场的定价也随之变化：国产算力相对海外算力资产此前累积的显著负超额，在二季度后段快速收窄约六成，说明市场已从“跟不上”的叙事，转向交易“正在追上”的替代周期。我们的持仓覆盖从芯片定制与 IP、到芯片设计、再到晶圆制造的完整链条。

2. 存储：战略资源的重估，与不可回避的矛盾点

存储是组合权重最高的核心底仓。上半年这一方向最本质的变化，不在于价格涨与不涨，而在于商业模式的结构性的迁移：过去存储以现货和年度议价为主，盈利高度不可预测，这正是其长期承受估值折价的根源；如今产业链大规模转向多年期长约，头部需求方为确保 AI 基础设施部署不因物料短缺受阻，普遍把“供应保障”置于“价格谈判”之前。其意义在于景气可见度的跃升——存储正从“赌周期”的品种，被重估为具备盈利可预测性的战略资源。供给侧，新增产能的正式交付要到 2027 年末乃至 2028 年初，增量相对刚性；而价格上行已由高端向服务器内存、企

业级存储乃至成熟制程产品全面外溢，呈现全品类共振。这对国内公司构成双重利好：海外厂商将有限产能优先投向最高价值产品，主动收缩利基与成熟制程供给，让出确定性的结构性缺口；同时国内供给优先服务内需，价格上行与国产替代形成共振。

但恰恰在共识最强的时候，我们通过对海外产业链的实地走访，看到三个不容回避的矛盾点。其一，存储涨价本质上站在下游云厂商投资回报的对立面——涨得越猛，客户被迫做出反应的动机就越强。据我们的情境测算，若云厂商“减配保出货”，2027 年内存需求相对基准情形将出现需求缺口，且减配越深、缺口越大；这意味着市场对需求的线性外推，隐含了“下游不会做任何优化”的强假设。其二，被视为可见度基石的多年期长约，本身可能是脆弱环节——若下游投资节奏生变，以定金锁定的产能存在违约风险，届时“锁量”代表的将是虚假需求而非真实订单。其三，交易结构已极度拥挤：产业链几乎没有一方认为 2027 年前主流价格会下行，海外长线资金对该板块的配置处于历史高位，甚至出现了放大波动的杠杆化产品。当一个判断不再存在对立面，它的风险收益比就已经开始恶化。

基于此，我们在报告期内维持核心底仓，但在方法上做了两点调整：选股更坚决地向与上游代工深度绑定、握有稀缺产能配额、并已将产品线切向车规与大容量等高附加值领域的设计龙头集中，而非依赖存货重估的模组环节；同时把情境测算常态化，预设了拥挤度与估值同时触及阈值时的应对方案。事后来看，这套预案发挥了应有的作用——我们于三季度初对部分涨幅显著透支、已充分反映乐观预期的存储头寸及时止盈，较好地规避了随后全球存储链条的剧烈调整。这再次印证了我们一贯的信念：当所有人都信了同一个故事时，反向思考比顺势加仓更能保护持有人利益。

3. 模拟与互连：从“0 到 1”的突破到放量兑现

一季度我们显著加码模拟领域的头部设计企业：随着 AI 集群规模指数级扩张，光互连成为解决带宽与功耗瓶颈的关键路径，为光电驱动、电源管理与高精度数据转换等器件创造了史无前例的需求真空。对国内厂商而言，这是罕见的从零到一的无人区机会——验证壁垒相对较低，产品一旦通过即可快速起量，带来爆品级别的规模效应与利润弹性；二季度随高速率光模块规模化量产，该方向已从验证期迈向兑现期。需要说明的是，光通讯内部同样存在分歧：部分新兴封装形态放量晚于预期，上游衬底供需在 2027 年可能明显转松，因此我们坚持精选而非全面暴露。

与之相伴的另一条线索，是智能体对服务器内部互联架构的重塑，传统“内存墙”被进一步放大，直接利好内存接口芯片与新型内存扩展、池化方案。一个容易被误读之处在于：下游为应对涨价而采用的内存池化与压缩，非但不会削弱内存总需求，反而正是内存扩展方案的核心应用场景——它恰恰构成了前述“减配”风险的对冲。我们判断，内存接口环节有望从“稳定现金流”

的叙事，升级为“内存扩展成长性”的叙事。

三、期末持仓结构概览

截至上半年末，组合延续“聚焦半导体、重仓头部”的风格，呈现“存储为压舱石、国产算力为兑现主线、模拟与互连为成长期权、材料为卫星布局”的清晰结构。存储仍是第一大配置方向；国产算力覆盖 IP 定制、芯片设计与晶圆制造全链条，构成第二大配置方向；模拟芯片与内存接口把握 AI 光通讯与内存扩展的成长机会；半导体材料、先进封装设备与第三方测试作为卫星仓位，绑定本土扩产周期红利。

四、投资纪律与风控

本基金始终坚守既定的投资哲学，上半年在操作层面尤其强调三条纪律：

- 1) 前瞻布局优于事后追逐。核心持仓均在其成长空间尚未被市场充分认知时提前卡位，因此在兑现期无需追高，只需持有等待；二季度的低换手正是这套方法论的自然结果。
- 2) 业绩兑现度高于短期弹性。无论是存储的产能兑现、模拟的业绩放量还是国产算力的订单落地，我们优选的都是兑现路径清晰、而非仅靠故事驱动的方向。
- 3) 在共识最强处保持警惕，并预先准备退出方案。我们以情境测算替代线性外推，评估的不只是“最好会怎样”，更是“如果下游做出反应会怎样”；当拥挤度与估值同时越过阈值，及时止盈是纪律，而非对产业趋势的否定。

三条纪律背后，是我们对确定性因子的持续重排：从单纯的数量逻辑，走向人均毛利润所验证的研发变现效率；从价格弹性，走向产能兑现；从常规的国产替代，走向 AI 核心环节的爆品破局；从下游终端复苏，走向中上游先进制程扩产的刚性消耗。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实绿色主题股票发起式 A 基金份额净值为 3.0534 元，本报告期基金份额净值增长率为 134.46%；截至本报告期末嘉实绿色主题股票发起式 C 基金份额净值为 2.9927 元，本报告期基金份额净值增长率为 133.75%；业绩比较基准收益率为 7.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期后的市场变化，为上述纪律提供了一次直接检验。进入 7 月，全球科技资产同步调整：海外扩产计划超预期引发对算力与存储产能过剩的担忧，叠加流动性收紧预期反复与地缘局势升温，最拥挤的成长方向首当其冲，半导体与存储链条成为重灾区。得益于此前的情境推演与预案，我们较好地控制了组合回撤。我们倾向于将其理解为估值快速扩张后的结构性消化，而非产业趋势的终结——真正变化的是定价方式：市场正从“只要身处 AI 产业链就给予估值”，转向“订单、利润、现金流与资本回报率必须同时经得起验证”。这意味着 AI 投资周期已由“买算力扩张”进

入“验证系统回报”的第二阶段：一阶趋势仍然向上，需求持续由芯片向电力、存储、互连与数据中心基础设施外溢，但二阶导已从全面加速转为内部的高低分化。

因此下半年我们的选股标准将同步升级，更倾向订单可见、交付稳定、现金转化良好的环节，并降低对高估值、单一客户依赖与仅靠远期叙事支撑标的的容忍度。国产算力是我们最看重的方向：订单能见度已延伸至 2028 年，产能与技术的必要条件均已具备，而当前估值仍未充分反映替代周期的斜率，重点跟踪产能爬坡与交付节奏能否如期兑现。存储方面，中期供需格局的判断并未改变，但会以更审慎的姿态对待，观察下游资本开支是否实质下修、长约履约情况与中报能否验证利润，待拥挤度充分释放、风险收益比重新占优时择机再度布局。模拟与互连有望随光模块放量与内存扩展落地迎来收入加速；材料方面，本土扩产节奏不因短期波动而改变，需求的确定性在市场恐慌时反而更显珍贵。在市场的喧嚣与恐慌之间，我们将继续坚守“寻找爆款”的第一性原则，以前瞻布局、持有兑现与及时止盈的纪律，力争为持有人创造持续稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》及中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于基金资产估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求，履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，具备投研、风险管理、基金估值运作、法律合规等方面的专业胜任能力。

本基金管理人使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制，与估值相关的机构包括基金投资市场的证券交易场所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金（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合规守信、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：嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金

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	767,446,803.28	13,233,429.34
结算备付金		32,479,599.80	347,302.95
存出保证金		691,597.24	11,304.97
交易性金融资产	6.4.7.2	2,673,504,995.46	174,742,836.37
其中：股票投资		2,673,504,995.46	174,742,836.37
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	-	-
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		-	2,466,365.53
应收股利		193,233.12	-
应收申购款		89,248,692.00	1,165,639.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		3,563,564,920.90	191,966,879.09
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		114,248,159.22	-
应付赎回款		71,570,586.31	4,369,947.50
应付管理人报酬		1,894,761.09	194,897.88
应付托管费		315,793.55	32,482.99
应付销售服务费		867,518.40	65,808.01
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	925,939.76	250,607.58
负债合计		189,822,758.33	4,913,743.96
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,125,844,596.45	145,286,722.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	2,247,897,566.12	41,766,412.26
净资产合计		3,373,742,162.57	187,053,135.13
负债和净资产总计		3,563,564,920.90	191,966,879.09

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，嘉实绿色主题股票发起式 A 基金份额净值 3.0534 元，基金份额总额 72,265,077.31 份，嘉实绿色主题股票发起式 C 基金份额净值 2.9927 元，基金份额总额 1,053,579,519.14 份，基金份额总额合计为 1,125,844,596.45 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金

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		989,446,057.32	91,025,479.38
1. 利息收入		298,807.10	128,135.42
其中：存款利息收入	6.4.7.13	298,807.10	128,135.42
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）		43,522,346.38	76,712,834.77
其中：股票投资收益	6.4.7.14	42,086,473.75	76,438,099.02
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-248.12
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,435,872.63	274,983.87
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	935,852,409.53	9,853,052.18
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	9,772,494.31	4,331,457.01
减：二、营业总支出		9,167,873.84	2,705,814.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,641,673.43	1,669,255.04
2. 托管费	6.4.10.2.2	940,278.98	278,209.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,484,330.77	735,648.19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	101,590.66	22,701.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		980,278,183.48	88,319,665.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		980,278,183.48	88,319,665.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		980,278,183.48	88,319,665.23
----------	--	----------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金

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	145,286,722.87	-	41,766,412.26	187,053,135.13
二、本期期初净资产	145,286,722.87	-	41,766,412.26	187,053,135.13
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	980,557,873.58	-	2,206,131,153.86	3,186,689,027.44
（一）、综合收益总额	-	-	980,278,183.48	980,278,183.48
（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)	980,557,873.58	-	1,225,852,970.38	2,206,410,843.96
其中：1. 基金申购款	2,291,342,050.15	-	2,479,114,754.57	4,770,456,804.72
2. 基金赎回款	-1,310,784,176.57	-	-1,253,261,784.19	-2,564,045,960.76
（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	1,125,844,596.45	-	2,247,897,566.12	3,373,742,162.57
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	108,484,122.75	-	-14,254,306.03	94,229,816.72

二、本期期初净资产	108,484,122.75	-	-14,254,306.03	94,229,816.72
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	43,933,357.14	-	16,438,287.71	60,371,644.85
(一)、综合收益总额	-	-	88,319,665.23	88,319,665.23
(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)	43,933,357.14	-	-71,881,377.52	-27,948,020.38
其中：1. 基金申购款	1,490,678,270.91	-	-116,020,922.89	1,374,657,348.02
2. 基金赎回款	-1,446,744,913.77	-	44,139,545.37	-1,402,605,368.40
(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	152,417,479.89	-	2,183,981.68	154,601,461.57

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：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金(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]3224号《关于准予嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金注册的批复》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《嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金基金合同》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,《嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金基金合同》于

2023 年 2 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,191,114.94 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。

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。

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	767,446,803.28
等于：本金	767,406,047.70
加：应计利息	40,755.58
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	767,446,803.28

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		1,718,059,776.33	-	2,673,504,995.46	955,445,219.13
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		1,718,059,776.33	-	2,673,504,995.46	955,445,219.13

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	1,763.84
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	847,312.46
其中：交易所市场	847,312.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	76,863.46
合计	925,939.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实绿色主题股票发起式 A

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	47,609,683.52	47,609,683.52
本期申购	96,640,296.31	96,640,296.31
本期赎回（以“-”号填列）	-71,984,902.52	-71,984,902.52
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	72,265,077.31	72,265,077.31

嘉实绿色主题股票发起式 C

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	97,677,039.35	97,677,039.35
本期申购	2,194,701,753.84	2,194,701,753.84
本期赎回（以“-”号填列）	-1,238,799,274.05	-1,238,799,274.05
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	1,053,579,519.14	1,053,579,519.14

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实绿色主题股票发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,581,017.12	1,811,300.38	14,392,317.50
本期期初	12,581,017.12	1,811,300.38	14,392,317.50
本期利润	5,884,731.46	99,620,067.64	105,504,799.10
本期基金份额交易产生的变动数	8,009,612.00	20,483,018.60	28,492,630.60
其中：基金申购款	30,792,479.67	66,899,126.97	97,691,606.64
基金赎回款	-22,782,867.67	-46,416,108.37	-69,198,976.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,475,360.58	121,914,386.62	148,389,747.20

嘉实绿色主题股票发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	23,854,669.65	3,519,425.11	27,374,094.76
本期期初	23,854,669.65	3,519,425.11	27,374,094.76
本期利润	38,541,042.49	836,232,341.89	874,773,384.38
本期基金份额交易产生的变动数	295,094,042.81	902,266,296.97	1,197,360,339.78
其中：基金申购款	663,908,475.91	1,717,514,672.02	2,381,423,147.93
基金赎回款	-368,814,433.10	-815,248,375.05	-1,184,062,808.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	357,489,754.95	1,742,018,063.97	2,099,507,818.92

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	289,577.68
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	7,232.78
其他	1,996.64
合计	298,807.10

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	42,086,473.75
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	42,086,473.75
----	---------------

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	578,241,281.80
减：卖出股票成本总额	534,175,595.76
减：交易费用	1,979,212.29
买卖股票差价收入	42,086,473.75

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,435,872.63
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,435,872.63

6.4.7.20 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	935,852,409.53
股票投资	935,852,409.53
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	-
合计	935,852,409.53

6.4.7.21 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	9,511,839.08
基金转出费收入	260,655.23
合计	9,772,494.31

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	17,356.09
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	23,074.13
深港通证券组合费	1,653.07
合计	101,590.66

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
嘉实财富管理有限公司（“嘉实财富”）	基金管理人的控股子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	5,641,673.43	1,669,255.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,171,223.56	657,015.57
应支付基金管理人的净管理费	3,470,449.87	1,012,239.47

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	940,278.98	278,209.27

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	嘉实绿色主题股票发 起式 A	嘉实绿色主题股票发 起式 C	合计
嘉实基金管理有限公司	—	251,146.05	251,146.05
嘉实财富	—	1,748.29	1,748.29
合计	—	252,894.34	252,894.34
获得销售服务费的各关联 方名称	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销售服务费		
	嘉实绿色主题股票发 起式 A	嘉实绿色主题股票发 起式 C	合计
嘉实基金管理有限公司	—	5,580.84	5,580.84
嘉实财富	—	186.52	186.52
合计	—	5,767.36	5,767.36

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	嘉实绿色主题股票发起式 A	嘉实绿色主题股票发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,000,450.04	—
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	10,000,450.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.84%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	嘉实绿色主题股票发起式 A	嘉实绿色主题股票发起式 C
报告期初持有的基金份额	10,000,450.04	-
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	10,000,450.04	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	26.87%	-

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	767,446,803.28	289,577.68	19,285,398.68	124,772.25

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本期(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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	186	2,079.48	3,271.74	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	70	1,531.60	1,786.40	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-

	技	日								
688635	长进光子	2026年5月20日	6个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688785	恒运昌	2026年1月20日	6个月	新股锁定	92.18	463.15	49	4,516.82	22,694.35	-
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026年4月16日	6个月	新股锁定	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026年4月1日	6个月	新股锁定	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026年3月24日	6个月	新股锁定	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定	19.68	141.49	994	19,561.92	140,641.06	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值价格与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会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时间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	767,446,803.28	-	-	-	767,446,803.28
结算备付金	32,479,599.80	-	-	-	32,479,599.80
存出保证金	691,597.24	-	-	-	691,597.24
交易性金融资产	-	-	-	2,673,504,995.46	2,673,504,995.46
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	-	-	-	193,233.12	193,233.12
应收申购款	-	-	-	89,248,692.00	89,248,692.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	800,618,000.32	-	-	2,762,946,920.58	3,563,564,920.90
负债					

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	114,248,159.22	114,248,159.22
应付赎回款	-	-	-	71,570,586.31	71,570,586.31
应付管理人报酬	-	-	-	1,894,761.09	1,894,761.09
应付托管费	-	-	-	315,793.55	315,793.55
应付销售服务费	-	-	-	867,518.40	867,518.40
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	-	-	-	925,939.76	925,939.76
负债总计	-	-	-	189,822,758.33	189,822,758.33
利率敏感度缺口	800,618,000.32	-	-	2,573,124,162.25	3,373,742,162.57
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	13,233,429.34	-	-	-	13,233,429.34
结算备付金	347,302.95	-	-	-	347,302.95
存出保证金	11,304.97	-	-	-	11,304.97
交易性金融资产	-	-	-	174,742,836.37	174,742,836.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	2,466,365.53	2,466,365.53
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,165,639.93	1,165,639.93
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	13,592,037.26	-	-	178,374,841.83	191,966,879.09
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	-	-	-	4,369,947.50	4,369,947.50
应付管理人报酬	-	-	-	194,897.88	194,897.88
应付托管费	-	-	-	32,482.99	32,482.99
应付销售服务费	-	-	-	65,808.01	65,808.01
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	-	-	-	250,607.58	250,607.58
负债总计	-	-	-	4,913,743.96	4,913,743.96
利率敏感度缺口	13,592,037.26	-	-	173,461,097.87	187,053,135.13

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	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资	-	276,009,156.56	-	276,009,156.56

产				
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	276,009,156.56	-	276,009,156.56
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	276,009,156.56	-	276,009,156.56
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

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%	13,800,457.83	-

	所有外币相对人民币贬值 5%	-13, 800, 457. 83	-
--	----------------	-------------------	---

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	2, 673, 504, 995. 46	79. 24	174, 742, 836. 37	93. 42
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2, 673, 504, 995. 46	79. 24	174, 742, 836. 37	93. 42

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%	332, 556, 311. 19	15, 942, 432. 93

	业绩比较基准下降 5%	-332, 556, 311. 19	-15, 942, 432. 93
--	----------------	--------------------	-------------------

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	2, 672, 834, 060. 69	170, 401, 764. 74
第二层次	-	-
第三层次	670, 934. 77	4, 341, 071. 63
合计	2, 673, 504, 995. 46	174, 742, 836. 37

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	2,673,504,995.46	75.02
	其中：股票	2,673,504,995.46	75.02
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	—	—
	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	799,926,403.08	22.45
8	其他各项资产	90,133,522.36	2.53
9	合计	3,563,564,920.90	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 276,009,156.56 元，占基金资产净值的比例为 8.18%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,810,829,176.54	53.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	500,142,066.36	14.82
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	86,524,596.00	2.56

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,397,495,838.90	71.06

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	83,102.86	0.00
非必需消费品	-	-
必需消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	275,926,053.70	8.18
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	276,009,156.56	8.18

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

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	300223	北京君正	1,231,600	306,545,240.00	9.09
2	688766	普冉股份	382,967	293,582,502.20	8.70
3	603986	兆易创新	316,465	257,918,975.00	7.64
4	688008	澜起科技	657,085	203,630,641.50	6.04
5	688521	芯原股份	547,563	203,222,531.82	6.02
6	688041	海光信息	495,588	183,516,236.40	5.44
7	688256	寒武纪	109,963	175,451,464.65	5.20
8	00981	中芯国际	1,955,000	151,802,563.35	4.50
9	688123	聚辰股份	666,716	141,743,821.60	4.20
10	300661	圣邦股份	870,600	124,913,688.00	3.70
11	688536	思瑞浦	333,621	121,468,069.89	3.60
12	688019	安集科技	310,760	105,490,589.60	3.13
13	688372	伟测科技	465,186	86,524,596.00	2.56
14	920179	凯德石英	704,084	69,176,253.00	2.05
15	00522	ASMPT	247,100	51,250,946.75	1.52
16	300236	上海新阳	380,759	50,069,808.50	1.48

17	300054	鼎龙股份	423,200	44,846,504.00	1.33
18	01304	FORTIOR	364,300	44,487,634.76	1.32
19	06082	壁仞科技	534,000	28,384,908.84	0.84
20	688381	帝奥微	480,163	25,688,720.50	0.76
21	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.04
22	688813	泰金新能	2,337	481,899.06	0.01
23	603459	红板科技	3,300	361,089.30	0.01
24	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
25	688811	有研复材	8,337	252,717.42	0.01
26	688785	恒运昌	487	234,699.49	0.01
27	688049	炬芯科技	4,333	203,261.03	0.01
28	688820	盛合晶微	994	140,641.06	0.00
29	688805	健信超导	2,378	111,694.66	0.00
30	01024	快手-W	2,300	83,102.86	0.00
31	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
32	603092	德力佳	674	36,375.78	0.00
33	688809	强一股份	58	36,134.00	0.00
34	601112	振石股份	1,853	33,661.15	0.00
35	603293	埃泰克	716	28,924.24	0.00
36	001312	福恩股份	1,333	25,209.37	0.00
37	688775	影石创新	137	18,995.05	0.00
38	603352	至信股份	696	18,081.18	0.00
39	603370	华新精科	437	15,723.26	0.00
40	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
41	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
42	603049	中策橡胶	82	3,674.42	0.00
43	603262	技源集团	137	3,372.94	0.00
44	603418	友升股份	72	3,180.24	0.00
45	603406	天富龙	60	1,557.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300223	北京君正	176,342,765.81	94.27
2	688521	芯原股份	145,407,899.47	77.74
3	688008	澜起科技	142,284,633.89	76.07
4	00981	中芯国际	138,853,322.07	74.23
5	688041	海光信息	135,404,522.68	72.39
6	688766	普冉股份	132,272,860.66	70.71
7	603986	兆易创新	121,838,556.93	65.14
8	688256	寒武纪	116,778,979.58	62.43
9	688123	聚辰股份	101,241,166.07	54.12
10	300661	圣邦股份	79,615,066.00	42.56

11	688019	安集科技	74,144,567.08	39.64
12	688372	伟测科技	69,233,865.10	37.01
13	688536	思瑞浦	68,671,951.25	36.71
14	01304	FORTIOR	56,141,952.39	30.01
14	688279	峰昭科技	3,678,063.93	1.97
15	688120	华海清科	57,991,953.44	31.00
16	002371	北方华创	49,890,071.93	26.67
17	920179	凯德石英	47,580,555.97	25.44
18	00522	ASMPT	43,806,668.65	23.42
19	300236	上海新阳	40,886,108.79	21.86
20	300666	江丰电子	39,292,342.00	21.01
21	688049	炬芯科技	31,498,098.36	16.84
22	300054	鼎龙股份	30,084,314.00	16.08
23	06082	壁仞科技	26,577,503.98	14.21
24	688012	中微公司	25,927,664.23	13.86
25	02631	天岳先进	22,415,397.78	11.98
25	688234	天岳先进	1,929,021.34	1.03
26	688368	晶丰明源	23,041,629.17	12.32
27	688381	帝奥微	20,641,184.17	11.03
28	300373	扬杰科技	18,850,635.00	10.08
29	002409	雅克科技	16,364,784.07	8.75
30	688449	联芸科技	15,120,830.33	8.08
31	688249	晶合集成	9,938,034.87	5.31
32	688110	东芯股份	6,564,865.87	3.51
33	688409	富创精密	5,449,580.65	2.91

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688120	华海清科	55,587,894.28	29.72
2	002371	北方华创	49,808,665.00	26.63
3	300666	江丰电子	42,556,737.00	22.75
4	688766	普冉股份	40,925,191.19	21.88
5	603986	兆易创新	38,313,984.84	20.48
6	02631	天岳先进	29,875,563.99	15.97
6	688234	天岳先进	2,001,299.88	1.07
7	688049	炬芯科技	30,903,087.99	16.52
8	688521	芯原股份	29,083,597.70	15.55
9	688008	澜起科技	28,473,751.09	15.22
10	688368	晶丰明源	28,218,474.87	15.09
11	688123	聚辰股份	24,511,217.13	13.10
12	688012	中微公司	23,963,695.04	12.81
13	688249	晶合集成	19,193,297.63	10.26
14	300373	扬杰科技	18,246,147.00	9.75

15	688449	联芸科技	17,101,007.10	9.14
16	002409	雅克科技	15,226,831.00	8.14
17	01304	FORTIOR	10,285,006.95	5.50
17	688279	峰昭科技	3,515,882.82	1.88
18	300054	鼎龙股份	9,398,556.00	5.02
19	688536	思瑞浦	8,062,055.11	4.31
20	300236	上海新阳	7,138,923.00	3.82
21	688256	寒武纪	7,016,494.62	3.75
22	300223	北京君正	6,523,578.00	3.49
23	688041	海光信息	6,274,896.85	3.35
24	688372	伟测科技	6,241,547.63	3.34
25	688409	富创精密	5,449,597.68	2.91
26	688110	东芯股份	5,444,031.56	2.91

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	2,097,085,345.32
卖出股票收入（成交）总额	578,241,281.80

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	691,597.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	193,233.12
4	应收利息	-
5	应收申购款	89,248,692.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,133,522.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
嘉实绿色 主题股票 发起式 A	8,387	8,616.32	10,000,450.04	13.84	62,264,627.27	86.16
嘉实绿色 主题股票 发起式 C	164,457	6,406.41	368,613,434.61	34.99	684,966,084.53	65.01
合计	171,949	6,547.55	378,613,884.65	33.63	747,230,711.80	66.37

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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（%）	84.21

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

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实绿色主题股票发起式 A	1,789,534.41	2.48
	嘉实绿色主题股票发起式 C	1,236.06	0.00
	合计	1,790,770.47	0.16

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门	嘉实绿色主题股票发起式 A	>100
	嘉实绿色主题股票发起式 C	0

负责人持有本开放式基金		
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实绿色主题股票发起式 A	10~50
	嘉实绿色主题股票发起式 C	0
	合计	10~50

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	10,000,450.04	0.89	10,000,450.04	0.89	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	10,000,450.04	0.89	10,000,450.04	0.89	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实绿色主题股票发起式 A	嘉实绿色主题股票发起式 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 17 日）基金份额总额	10,720,467.61	470,647.33
本报告期期初基金份额总额	47,609,683.52	97,677,039.35
本报告期基金总申购份额	96,640,296.31	2,194,701,753.84
减：本报告期基金总赎回份额	71,984,902.52	1,238,799,274.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	72,265,077.31	1,053,579,519.14

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。

§ 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(%)	
国金证券股份有限公司	2	535,675,918.69	20.03	233,500.80	19.73	—
国海证券股份有限公司	2	250,754,456.01	9.38	111,288.11	9.40	—
兴业证券股份有限公司	3	249,369,229.23	9.32	108,703.41	9.19	—
华泰证券股份有限公司	6	225,353,799.31	8.43	101,566.23	8.58	—
长江证券股份有限公司	2	225,143,809.63	8.42	100,052.95	8.45	—
国信证券股份有限公司	1	171,432,894.91	6.41	74,728.04	6.31	—
东方证券股份有限公司	4	165,107,110.82	6.17	71,971.41	6.08	—
招商证券股份有限公司	2	138,614,931.90	5.18	61,334.19	5.18	—

中泰证券股份有限公司	5	132,502,846.66	4.95	64,612.92	5.46	—
浙商证券股份有限公司	1	117,874,727.13	4.41	51,381.88	4.34	—
天风证券股份有限公司	4	99,717,984.56	3.73	43,469.17	3.67	—
东吴证券股份有限公司	3	80,100,800.40	2.99	36,177.39	3.06	—
东方财富证券股份有限公司	2	66,710,510.18	2.49	29,079.33	2.46	—
中信建投证券股份有限公司	4	53,815,271.15	2.01	22,582.61	1.91	—
华创证券有限责任公司	2	46,097,212.52	1.72	20,360.12	1.72	—
中信证券股份有限公司	8	38,700,921.40	1.45	15,651.78	1.32	—
申万宏源证券有限公司	3	32,537,720.32	1.22	16,268.79	1.37	—
中国国际金融股份有限公司	5	29,018,681.07	1.09	12,649.69	1.07	—
国泰海通证券股份有限公司	7	15,987,240.52	0.60	7,993.53	0.68	—
渤海证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
财通证券股份有限公司	2	—	—	—	—	—
长城证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
诚通证券股份有限	2	—	—	—	—	—

公司						
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
高盛（中国）证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	6	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华林证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
联储证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	2	-	-	-	-	-
平安证券股份有限	4	-	-	-	-	-

公司						
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
山西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
天府证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
万联证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
粤开证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	3	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中山证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
中邮证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-

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

2. 交易单元的选择标准和程序

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

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

3. 报告期内，本基金退租以下交易单元：渤海证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国泰海通证券股份有限公司退租交易单元 1 个。国新证券股份有限公司退租交易单元 2 个。信达证券股份有限公司退租交易单元 2 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：摩根大通证券(中国)有限公司新增交易单元 2 个。

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证	-	-	-	-	-	-

券股份 有限公 司						
长江证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东吴证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
华创证 券有限	-	-	-	-	-	-

责任公司						
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
高盛(中国)证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国新证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华林证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华龙证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联储证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

有限公司						
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天府证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
万联证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券有限公司	-	-	-	-	-	-
粤开证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有	-	-	-	-	-	-

限公司						
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司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

§ 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

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

§ 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绿色主题股票型发起式证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实绿色主题股票型发起式证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日