

嘉实事件驱动股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 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，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 25 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55

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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	65
§ 11 备查文件目录	66
11.1 备查文件目录	66
11.2 存放地点	66
11.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实事件驱动股票型证券投资基金
基金简称	嘉实事件驱动股票
基金主代码	001416
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 9 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,362,663,423.10 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	立足于中国特定的投资环境，将自上而下的宏观及行业投资决策模式与自下而上的微观投资决策模式统一于事件分析的投资决策框架之内，在深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资，力争实现投资者的长期稳定增值。
投资策略	本基金深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资。事件性投资是主题性投资在标的股票上的具体表现形式。而相对于主题性投资相对宽泛的投资概念而言，事件性投资更加具体，与标的股票的联系更加紧密。在事件分析的投资决策框架内，事件性投资可以更加科学、有效地捕获事件冲击所带来的超额收益，以更加直观、明确的模式刻画超额收益的持续性，从而使事件性投资的操作和执行也更具针对性和纪律性，确保了超额收益的渐进式稳定增长。具体策略包括：大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中证综合债券指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		嘉实基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	郭明
	联系电话	(010)65215588	(010)66105799
	电子邮箱	service@jsfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95588

传真	(010) 65215588	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	经雷	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	447,047,733.41
本期利润	116,424,739.05
加权平均基金份额本期利润	0.0769
本期加权平均净值利润率	5.90%
本期基金份额净值增长率	5.04%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	511,423,857.30
期末可供分配基金份额利润	0.3753
期末基金资产净值	1,874,087,280.40
期末基金份额净值	1.375
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	37.50%

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）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.25%	1.07%	-1.57%	0.64%	5.82%	0.43%
过去三个月	13.64%	1.07%	3.07%	0.78%	10.57%	0.29%
过去六个月	5.04%	1.64%	0.79%	1.05%	4.25%	0.59%
过去一年	33.24%	1.59%	20.99%	1.07%	12.25%	0.52%
过去三年	91.77%	1.54%	42.79%	1.09%	48.98%	0.45%
自基金合同生效起至今	37.50%	1.48%	5.78%	1.18%	31.72%	0.30%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

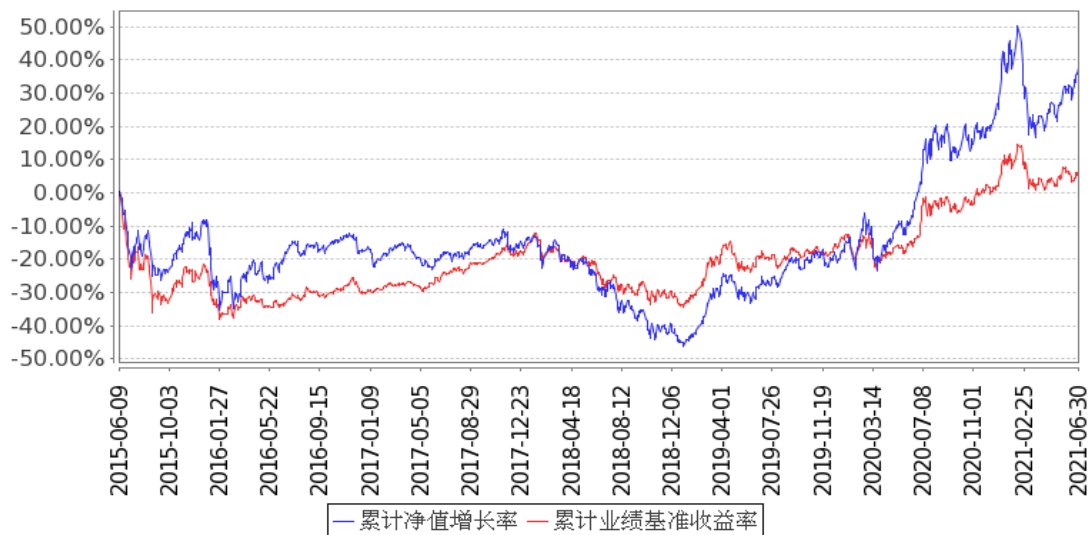
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

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

嘉实事件驱动股票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

(2015年06月09日至2021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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 223 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联

接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉

实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合、嘉实民安添岁稳健养老一年持有期混合 (FOF)、嘉实港股优势混合、嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证软件服务 ETF、嘉实品质回报混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实浦盈一年持有期混合、嘉实中证稀土产业 ETF、嘉实阿尔法优选混合、嘉实中证大农业 ETF、嘉实匠心回报混合、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实价值臻选混合、嘉实品质优选股票、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实领先优势混合、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合 (FOF)、嘉实优势精选混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张 自 力	本基金、嘉实美国成长股票 (QDII) 基金经理	2015 年 6 月 9 日	-	25 年	曾任美国世纪投资管理公司 (American Century Investments) 资深副总经理，研究部总监暨基金经理，负责直接管理、支持公司旗下近二百亿美元的多项大型公募基金和对冲基金类产品。2012 年 2 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任定量投资部负责人，现任人工智能投资部负责人。理论物理学博士，毕业于美国德州大学奥斯汀分校和中国科学技术大学，美国国籍。

张楠	本基金基金经理	2019 年 1 月 17 日	-	9 年	2012 年 1 月加入嘉实基金管理有限公司从事投资模型研究和投资组合管理工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
----	---------	-----------------	---	-----	---

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

2021 年上半年的报告期内，A 股市场整体震荡走平，期间在春节后经历了较强回撤，总体上周期风格相对最强，成长风格波动增大。二季度中后期，随着多方面因素的影响，市场再次对成长风格及部分高景气板块给予较多的估值上行。

进入 2021 年，A 股延续了近两年的整体向上趋势，春节前市场指数点位与各类投资工具净值持续上扬，风格上继续以高质量的大盘成长股为相对强势方向，主题类投资区域同样机会丰富。春节后估值过高以及持仓较为集中的中大盘股回撤明显，周期类、价值类风格表现抢眼，中小盘

在下行过程中相对跌幅更少。

2021 年，伴随疫情控制逐步见效以及病毒变异引发对再次失控的担忧而不断修正的经济政策、经济复苏预期，市场在风险偏好的选择也在不断切换。相比于疫情严重期间在宽松流动性环境下带来的高成长股的持续走强，今年全球复工复产、产业链重启以及央行减缓过度宽松的货币政策的背景下，上游资源股、周期类板块等占优。

本组合在 2 月中旬的春节后，随成长风格的向下经历了回撤。在检测和确认市场风格的变化后，组合在受控的换手率内逐步调整。二季度内，组合在操作上通过负面清单方法在多类事件指标中对股票池进行筛选，在选股上倾向于规避基本面增长乏力、估值过高、市场过度追捧等标的，在风格和行业上以风险为度量采取更加均衡的配置，这一调整在 3 月及之后起到一定效果，组合净值从节后的回撤中开始稳步向上。

后续组合将根据全球疫情、国内经济复苏的情况，以及上市公司具体的盈利状态，对组合进行均衡调整。

报告期内，本组合严格遵守基金合同的约定，基于量化模型，构建多类事件驱动子策略，包括但不限于财报业绩加速事件、扭亏事件、股东高管增持事件、股权激励事件、重大重组事件、定向增发事件、限售股解禁事件、重大诉讼和关联交易事件、企业变革事件、国企改革国资注入事件、指数成分股调整事件、宏观对冲事件等，建立自下而上的主动选股模型。同时，本组合通过行业、风格、风险等维度的控制，进行组合优化，避免个别风格过于集中的风险暴露。本期内，组合根据国家政策、宏观经济周期以及对市场风格、境外资金、机构投资者的监控，积极布局市场发展方向。

组合作为股票型基金，在一季度内满足 80%-95% 的股票仓位约束，后续将坚持主动股票型的高仓位运作，坚持整体稳健的投资风格，对各类事件驱动型策略进行相应调整和优化，进一步控制风险和波动，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.375 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.04%，业绩比较基准收益率为 0.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着疫苗的推进，除非 Delta 或更强病毒再次造成更大损失，全球经济总体可划分入疫情后阶段。疫情控制的不同步，带来全球经济复苏进程的不同步，由此带来全球范围、全资产类别上的配置机会。就国家地区的实体经济而言，中国是当前唯一有效控制疫情并实现复产复工的大型经济体，是对投资必选方向；从大类资产标的的角度，经济复苏周期中，权益类资产将是主要战

略配置方向，其中经济周期相关性更强的周期板块、成长风格等，都将有更稳健的投资机会。

站在当前时点，中短期内，全球疫情因变异病毒如 Delta 等进一步出现变数，理想状况下的全球经济在疫情受控下共振强复苏的周期难以出现，在此情况下，美国欧盟等地区的货币扶持政策将不能轻易退出，财政政策会同时被积极使用，由此创造全球整体上的宽松环境。国内更关注的是流动性的分配结构，尤其是中小企业在融资成本层面的考虑。

组合管理上，我们将继续依据事件驱动类策略，寻找主营业务稳健、有业绩超预期的成长潜力、估值相对合理并且符合组合投资目标的标的。我们进一步加强投资流程，由内部风控端和组合控制端按照“定期对照持仓与投资信号”、“实时监控买入卖出清单”这两种方式，对事件策略的信号生产、组合持仓构建、交易过程进行监控，以确保组合是严格按照既定投资策略进行的。事件类选股策略上，主要基于上市公司各类重大事件进行构造，以公司经营基本面信息为主。其中，上市公司的主营收入和净利润增速变化事件、资本市场一致预期变化事件、重大并购重组预期和公告以及重大资产交易类事件等，基于上市公司盈利能力的新信息披露或潜在增长能力来进行选股。还有诸如测度内部人员行为（如控股股东、大股东、董监高行为事件）、上市公司自身对股价的主动或被动诉求（如业绩承诺完成期限、质押和定增涉及的价格、回购计划等事件），涉入重大关联交易、涉入重大诉讼事件，以及所在行业和板块所面临的国家新行业政策对盈利的影响、国企改革等事件。

结合 2021 年市场面临的外部环境、国内政策以及上游原材料涨价等现实情况，我们将会进一步扩展和增强风控类事件对组合下行风险的控制，利用投资框架的稳健性，积极调整模型，控制风险，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易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，本基金托管人在对嘉实事件驱动股票型证券投资基金的托管过程中，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，不存在任何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，嘉实事件驱动股票型证券投资基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在嘉实事件驱动股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的嘉实事件驱动股票型证券投资基金 2021 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核查，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：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	40,280,648.84	20,114,379.55
结算备付金		65,322,556.12	71,619,156.64
存出保证金		5,009,052.51	9,647,571.21
交易性金融资产	6.4.7.2	1,765,812,434.35	2,397,528,759.46
其中：股票投资		1,675,768,434.35	2,267,636,821.36

基金投资		-	-
债券投资		90,044,000.00	129,891,938.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,873,171.26	5,628,698.11
应收利息	6.4.7.5	1,604,642.11	3,809,593.75
应收股利		-	-
应收申购款		85,058.09	395,695.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,887,987,563.28	2,508,743,854.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		50,383.61	-
应付赎回款		10,264,936.13	26,430,332.39
应付管理人报酬		2,267,590.22	3,123,961.40
应付托管费		377,931.71	520,660.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	820,432.17	2,212,338.09
应交税费		-	66,095.26
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,009.04	231,306.29
负债合计		13,900,282.88	32,584,693.67
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,362,663,423.10	1,892,235,926.21
未分配利润	6.4.7.10	511,423,857.30	583,923,234.31
所有者权益合计		1,874,087,280.40	2,476,159,160.52
负债和所有者权益总计		1,887,987,563.28	2,508,743,854.19

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.375 元，基金份额总额 1,362,663,423.10 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		138,692,586.68	1,088,668,925.70
1. 利息收入		1,739,473.26	3,823,694.23
其中：存款利息收入	6.4.7.11	220,746.58	570,964.82
债券利息收入		1,518,726.68	3,252,729.41
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		467,442,354.73	694,436,974.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	451,776,189.19	681,006,637.77
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,291,314.29	-119,359.29
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	4,860,541.14	-5,652,451.26
股利收益	6.4.7.16	8,514,310.11	19,202,147.64
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-330,622,994.36	390,286,565.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	133,753.05	121,691.46
减：二、费用		22,267,847.63	48,813,801.43
1. 管理人报酬	-	14,789,761.06	32,114,709.48
2. 托管费	-	2,464,960.20	5,352,451.53
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,840,018.86	11,160,982.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		27,849.46	25,426.52
7. 其他费用	6.4.7.20	145,258.05	160,231.81
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		116,424,739.05	1,039,855,124.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		116,424,739.05	1,039,855,124.27

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,892,235,926.21	583,923,234.31	2,476,159,160.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	116,424,739.05	116,424,739.05
三、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）	-529,572,503.11	-188,924,116.06	-718,496,619.17
其中：1. 基金申购款	39,109,709.26	13,306,671.93	52,416,381.19
2. 基金赎回款	-568,682,212.37	-202,230,787.99	-770,913,000.36
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,362,663,423.10	511,423,857.30	1,874,087,280.40
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,515,213,622.32	-1,031,122,509.30	4,484,091,113.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,039,855,124.27	1,039,855,124.27
三、本期基金份额	-1,146,573,539.08	132,706,676.31	-1,013,866,862.77

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	52,863,031.36	-6,360,731.54	46,502,299.82
2. 基金赎回款	-1,199,436,570.44	139,067,407.85	-1,060,369,162.59
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,368,640,083.24	141,439,291.28	4,510,079,374.52

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

黄志泉

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

嘉实事件驱动股票型证券投资基金(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[2015]1064 号《关于准予嘉实事件驱动股票型证券投资基金注册的批复》核准,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《嘉实事件驱动股票型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,《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 16,549,730,858.05 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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基金净值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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《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[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[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	40,280,648.84
定期存款	-
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	-
合计	40,280,648.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,202,750,722.06	1,675,768,434.35	473,017,712.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	89,988,560.00	90,044,000.00
	合计	89,988,560.00	90,044,000.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,292,739,282.06	1,765,812,434.35	473,073,152.29

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	35,618,180.00	-	-	
其中：股指期货投资	35,618,180.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	35,618,180.00	-	-	

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金买入 IC2107 持仓量为 15 手，对应合约市值 20,301,600.00 元，公允价值变动-95,360.00 元；买入 IF2107 持仓量为 10 手，对应合约市值 15,573,600.00 元，公允价值变动 352,380.00 元。公允价值变动总额合计 257,020.00 元，可抵消期货暂收款 257,020.00 元，股指期货投资净额为零。

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	3,679.23

应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	7,102.46
应收债券利息	1,593,739.73
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	120.69
合计	1,604,642.11

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	820,432.17
银行间市场应付交易费用	-
合计	820,432.17

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,953.70
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,055.34
合计	119,009.04

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,892,235,926.21	1,892,235,926.21
本期申购	39,109,709.26	39,109,709.26
本期赎回（以“-”号填列）	-568,682,212.37	-568,682,212.37
- 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	1,362,663,423.10	1,362,663,423.10

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	523,408,249.69	60,514,984.62	583,923,234.31
本期利润	447,047,733.41	-330,622,994.36	116,424,739.05
本期基金份额交易产生的变动数	-212,003,768.72	23,079,652.66	-188,924,116.06
其中：基金申购款	16,485,033.72	-3,178,361.79	13,306,671.93
基金赎回款	-228,488,802.44	26,258,014.45	-202,230,787.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	758,452,214.38	-247,028,357.08	511,423,857.30

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	57,596.56
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	159,435.68
其他	3,714.34
合计	220,746.58

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	451,776,189.19
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	451,776,189.19

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

卖出股票成交总额	2,131,785,498.73
减：卖出股票成本总额	1,680,009,309.54
买卖股票差价收入	451,776,189.19

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,291,314.29
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	2,291,314.29

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	134,972,251.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	128,246,690.00
减：应收利息总额	4,434,247.23
买卖债券差价收入	2,291,314.29

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	4,860,541.14

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,514,310.11
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	8,514,310.11

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
------	---------------------------------------

1. 交易性金融资产	-328,530,197.89
股票投资	-326,940,389.79
债券投资	-1,589,808.10
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-2,092,796.47
权证投资	-
期货投资	-2,092,796.47
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	-330,622,994.36

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	114,576.23
基金转出费收入	19,176.82
合计	133,753.05

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	4,839,493.86
银行间市场交易费用	525.00
合计	4,840,018.86

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	12,602.71
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	145,258.05

6.4.7.21 分部报告

无。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,789,761.06	32,114,709.48
其中：支付销售机构的客户维护费	2,767,421.84	11,553,155.00

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 1.5%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×1.5%/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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,464,960.20	5,352,451.53

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国工商银行股份有限公司_活期	40,280,648.84	57,596.56	83,883,947.56	171,735.39

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(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日), 本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2021 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	可流通日	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
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁定	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 12 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月	2021 年 7 月	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-

		29 日	7 日							
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300943	春晖智控	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300955	嘉亨家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业	2021 年	2021	新股锁	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

	科技	3月22日	2021年9月29日	定						
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-

			日							
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远 新能	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 29 日	新股锁 定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁 定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益 通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福 泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁 定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马 遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁 定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德 新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁 定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐 家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波 方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁 定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛 股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁 定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈 仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁 定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17	新股锁 定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-

			日							
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新发未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新发未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新发未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688131	皓元医药	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 8 日	新股锁定	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688226	威腾	2021 年	2021	新发未	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

	电气	6月28日	2021年7月7日	上市						
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	新股锁定	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新股锁定	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新发未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股锁定	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00	-
688625	呈和科技	2021年5月31日	2021年12月7日	新股锁定	16.48	42.63	2,672	44,034.56	113,907.36	-
688626	翔宇医疗	2021年3月23日	2021年10月8日	新股锁定	28.82	104.16	3,652	105,250.64	380,392.32	-
688636	智明达	2021年3月30日	2021年10月8日	新股锁定	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96	-
688669	聚石化学	2021年1月15日	2021年7月26日	新股锁定	36.65	32.39	2,681	98,258.65	86,837.59	-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股锁定	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-
688696	极米科技	2021年2月23日	2021年9月3日	新股锁定	133.73	780.24	1,252	167,429.96	976,860.48	-

注：1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

2. 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，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

600460	士兰微	2021 年 6 月 30 日	重大 事项 停牌	56.35	2021 年 7 月 1 日	59.49	120,173	4,465,878.18	6,771,748.55	-
--------	-----	-----------------------	----------------	-------	----------------------	-------	---------	--------------	--------------	---

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

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是立足于中国特定的投资环境，将自上而下的宏观及行业投资决策模式与自下而上的微观投资决策模式统一于事件分析的投资决策框架之内，在深入挖掘并充分理解国内经济增长、结构转型以及行业轮动所带来的事件性投资机会，通过筛选、鉴别事件信息扩散对资产价格的影响模式，选择最具有竞争优势的标的股票进行价值投资，力争实现投资者的长期稳定增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类

风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	—	6,551,819.90
AAA 以下	—	3,041,118.20
未评级	—	—
合计	—	9,592,938.10

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	40,280,648.84	-	-	-	40,280,648.84
结算备付金	65,322,556.12	-	-	-	65,322,556.12
存出保证金	297,996.51	-	-	4,711,056.00	5,009,052.51
交易性金融资产	90,044,000.00	-	-	1,675,768,434.35	1,765,812,434.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	9,873,171.26	9,873,171.26
应收利息	-	-	-	1,604,642.11	1,604,642.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	85,058.09	85,058.09
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	195,945,201.47	-	-	1,692,042,361.81	1,887,987,563.28
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	50,383.61	50,383.61
应付赎回款	-	-	-	10,264,936.13	10,264,936.13

应付管理人报酬	-	-	-	2,267,590.22	2,267,590.22
应付托管费	-	-	-	377,931.71	377,931.71
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	820,432.17	820,432.17
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	119,009.04	119,009.04
负债总计	-	-	-	13,900,282.88	13,900,282.88
利率敏感度缺口	195,945,201.47	-	-	-1,678,142,078.93	1,874,087,280.40
上年度末 2020 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	20,114,379.55	-	-	-	20,114,379.55
结算备付金	71,619,156.64	-	-	-	71,619,156.64
存出保证金	662,067.21	-	-	8,985,504.00	9,647,571.21
交易性金融资产	120,299,000.00	383,432.80	9,209,505.30	2,267,636,821.36	2,397,528,759.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,628,698.11	5,628,698.11
应收利息	-	-	-	3,809,593.75	3,809,593.75
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	395,695.47	395,695.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	212,694,603.40	383,432.80	9,209,505.30	2,286,456,312.69	2,508,743,854.19
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	26,430,332.39	26,430,332.39
应付管理人报酬	-	-	-	3,123,961.40	3,123,961.40
应付托管费	-	-	-	520,660.24	520,660.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	2,212,338.09	2,212,338.09
应付税费	-	-	-	66,095.26	66,095.26
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	231,306.29	231,306.29

负债总计	-	-	-	32,584,693.67	32,584,693.67
利率敏感度缺口	212,694,603.40	383,432.80	9,209,505.30	2,253,871,619.02	2,476,159,160.52

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			
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	市场利率上升 25 个基点	-65,962.92	-177,953.13	
	市场利率下降 25 个基点	66,127.60	180,475.71	

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

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			
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	所有外币相对人民币升值 5%	-	-	
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-	

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 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,675,768,434.35	89.42	2,267,636,821.36	91.58
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	1,675,768,434.35	89.42	2,267,636,821.36	91.58

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		
	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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	135,859,845.50	161,013,983.58
	业绩比较基准下降 5%	-135,859,845.50	-161,013,983.58

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 1,664,240,503.20 元，属于第二层次的余额为 101,571,931.15 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 2,238,195,131.05 元，第二层次 159,333,628.41 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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，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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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）。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，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	1,675,768,434.35	88.76
	其中：股票	1,675,768,434.35	88.76
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	90,044,000.00	4.77
	其中：债券	90,044,000.00	4.77
	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	105,603,204.96	5.59
8	其他各项资产	16,571,923.97	0.88
9	合计	1,887,987,563.28	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

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	13,678.28	0.00
B	采矿业	31,893,031.33	1.70
C	制造业	1,204,602,977.46	64.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	51,791,515.00	2.76
E	建筑业	1,773,844.93	0.09
F	批发和零售业	1,263,812.14	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	50,480,176.30	2.69
H	住宿和餐饮业	6,947,486.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	76,713,104.06	4.09
J	金融业	108,412,763.58	5.78
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	15,948,925.50	0.85
M	科学研究和技术服务业	71,595,483.34	3.82
N	水利、环境和公共设施管理业	12,797,536.31	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	40,760,559.52	2.17
R	文化、体育和娱乐业	773,540.60	0.04
S	综合	-	-
	合计	1,675,768,434.35	89.42

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300750	宁德时代	124,600	66,636,080.00	3.56
2	600036	招商银行	997,416	54,049,973.04	2.88
3	300124	汇川技术	648,450	48,153,897.00	2.57
4	600519	贵州茅台	22,607	46,495,816.90	2.48
5	601012	隆基股份	421,238	37,422,783.92	2.00
6	603486	科沃斯	129,500	29,536,360.00	1.58
7	300760	迈瑞医疗	58,006	27,845,780.30	1.49
8	300327	中颖电子	313,950	26,757,958.50	1.43
9	000858	五 粮 液	89,565	26,680,517.85	1.42
10	000001	平安银行	1,150,700	26,028,834.00	1.39
11	002709	天赐材料	219,964	23,443,763.12	1.25
12	300496	中科创达	147,005	23,088,605.30	1.23
13	002460	赣锋锂业	176,101	21,324,070.09	1.14
14	603259	药明康德	127,248	19,925,764.32	1.06
15	601799	星宇股份	87,009	19,639,671.48	1.05
16	300782	卓胜微	35,740	19,210,250.00	1.03
17	002138	顺络电子	483,492	18,744,984.84	1.00
18	300363	博腾股份	211,700	17,808,204.00	0.95
19	002142	宁波银行	455,855	17,764,669.35	0.95
20	603501	韦尔股份	54,794	17,643,668.00	0.94
21	300012	华测检测	504,784	16,092,513.92	0.86
22	002139	拓邦股份	892,400	16,054,276.00	0.86
23	601636	旗滨集团	848,000	15,738,880.00	0.84
24	603816	顾家家居	195,400	15,100,512.00	0.81
25	300450	先导智能	248,882	14,967,763.48	0.80
26	002821	凯莱英	39,400	14,680,440.00	0.78
27	603008	喜临门	442,000	14,590,420.00	0.78
28	603128	华贸物流	1,010,300	14,235,127.00	0.76
29	688169	石头科技	11,245	14,179,945.00	0.76
30	002415	海康威视	216,185	13,943,932.50	0.74

31	300759	康龙化成	63,600	13,800,564.00	0.74
32	601919	中远海控	446,600	13,639,164.00	0.73
33	603833	欧派家居	90,604	12,862,143.84	0.69
34	600809	山西汾酒	28,629	12,825,792.00	0.68
35	601899	紫金矿业	1,323,500	12,824,715.00	0.68
36	300122	智飞生物	68,200	12,734,986.00	0.68
37	002230	科大讯飞	186,800	12,623,944.00	0.67
38	300408	三环集团	294,000	12,471,480.00	0.67
39	300015	爱尔眼科	172,664	12,255,690.72	0.65
40	002648	卫星石化	300,160	11,763,270.40	0.63
41	300274	阳光电源	101,600	11,690,096.00	0.62
42	300454	深信服	45,007	11,678,416.36	0.62
43	300285	国瓷材料	238,200	11,612,250.00	0.62
44	300595	欧普康视	110,670	11,459,878.50	0.61
45	300725	药石科技	70,970	11,277,842.70	0.60
46	600563	法拉电子	70,200	11,116,872.00	0.59
47	002594	比亚迪	44,000	11,044,000.00	0.59
48	603026	石大胜华	67,200	10,889,760.00	0.58
49	002372	伟星新材	526,100	10,874,487.00	0.58
50	300316	晶盛机电	214,652	10,839,926.00	0.58
51	002812	恩捷股份	45,883	10,741,210.30	0.57
52	603588	高能环境	733,300	10,618,184.00	0.57
53	601888	中国中免	35,192	10,561,119.20	0.56
54	600025	华能水电	1,815,700	10,512,903.00	0.56
55	600900	长江电力	508,800	10,501,632.00	0.56
56	603882	金域医学	65,700	10,496,889.00	0.56
57	603801	志邦家居	325,820	10,413,207.20	0.56
58	002410	广联达	150,706	10,278,149.20	0.55
59	300763	锦浪科技	56,690	10,238,214.00	0.55
60	600674	川投能源	824,700	10,168,551.00	0.54
61	603127	昭衍新药	55,148	10,133,445.00	0.54
62	300347	泰格医药	52,216	10,093,352.80	0.54
63	002541	鸿路钢构	165,600	9,662,760.00	0.52
64	603806	福斯特	91,900	9,661,447.00	0.52
65	600803	新奥股份	568,600	9,387,586.00	0.50
66	002563	森马服饰	776,600	9,280,370.00	0.50
67	601598	中国外运	1,818,700	9,184,435.00	0.49
68	300628	亿联网络	109,500	9,176,100.00	0.49
69	300390	天华超净	188,100	9,034,443.00	0.48
70	002402	和而泰	364,300	8,732,271.00	0.47
71	002967	广电计量	198,200	8,681,160.00	0.46
72	601633	长城汽车	192,200	8,377,998.00	0.45

73	601225	陕西煤业	689,100	8,165,835.00	0.44
74	002129	中环股份	206,100	7,955,460.00	0.42
75	600763	通策医疗	19,257	7,914,627.00	0.42
76	000733	振华科技	127,600	7,792,532.00	0.42
77	002841	视源股份	61,500	7,643,835.00	0.41
78	002568	百润股份	80,533	7,633,723.07	0.41
79	600885	宏发股份	119,600	7,498,920.00	0.40
80	603659	璞泰来	53,883	7,360,417.80	0.39
81	600436	片仔癀	16,400	7,352,120.00	0.39
82	002311	海大集团	89,000	7,262,400.00	0.39
83	601088	中国神华	363,800	7,101,376.00	0.38
84	601966	玲珑轮胎	162,173	7,093,447.02	0.38
85	600460	士兰微	120,173	6,771,748.55	0.36
86	603456	九洲药业	138,900	6,747,762.00	0.36
87	603180	金牌厨柜	140,668	6,708,456.92	0.36
88	002920	德赛西威	60,100	6,615,808.00	0.35
89	600754	锦江酒店	114,200	6,503,690.00	0.35
90	002371	北方华创	23,359	6,479,319.42	0.35
91	002810	山东赫达	134,260	6,331,701.60	0.34
92	002832	比音勒芬	246,500	6,307,935.00	0.34
93	300373	扬杰科技	103,400	6,259,836.00	0.33
94	300146	汤臣倍健	185,900	6,116,110.00	0.33
95	002430	杭氧股份	172,143	5,954,426.37	0.32
96	600377	宁沪高速	601,400	5,869,664.00	0.31
97	600660	福耀玻璃	101,200	5,652,020.00	0.30
98	603345	安井食品	22,200	5,639,244.00	0.30
99	300896	爱美客	7,051	5,562,392.88	0.30
100	688363	华熙生物	20,000	5,557,200.00	0.30
101	600406	国电南瑞	239,040	5,555,289.60	0.30
102	002049	紫光国微	35,119	5,414,998.61	0.29
103	300751	迈为股份	11,820	5,374,554.00	0.29
104	600886	国投电力	547,200	5,258,592.00	0.28
105	002484	江海股份	338,500	5,239,980.00	0.28
106	002791	坚朗五金	26,998	5,238,961.90	0.28
107	300627	华测导航	151,800	5,177,898.00	0.28
108	002028	思源电气	162,800	5,012,612.00	0.27
109	000049	德赛电池	108,380	4,974,642.00	0.27
110	603605	珀莱雅	24,200	4,760,382.00	0.25
111	002756	永兴材料	77,900	4,626,481.00	0.25
112	000830	鲁西化工	240,200	4,498,946.00	0.24
113	300059	东方财富	136,471	4,474,884.09	0.24
114	002531	天顺风能	486,300	4,206,495.00	0.22

115	300568	星源材质	99,010	4,096,043.70	0.22
116	603899	晨光文具	48,400	4,092,704.00	0.22
117	600882	妙可蓝多	58,000	4,048,400.00	0.22
118	600884	杉杉股份	172,600	4,025,032.00	0.21
119	600845	宝信软件	78,268	3,983,841.20	0.21
120	002258	利尔化学	153,900	3,970,620.00	0.21
121	002409	雅克科技	47,600	3,855,600.00	0.21
122	002318	久立特材	318,900	3,833,178.00	0.20
123	002407	多氟多	106,500	3,785,010.00	0.20
124	002179	中航光电	45,513	3,596,437.26	0.19
125	300037	新宙邦	35,300	3,533,530.00	0.19
126	002706	良信股份	154,070	3,472,737.80	0.19
127	300014	亿纬锂能	33,373	3,468,455.89	0.19
128	002027	分众传媒	367,600	3,459,116.00	0.18
129	300687	赛意信息	160,460	3,429,030.20	0.18
130	300630	普利制药	65,100	3,411,240.00	0.18
131	002833	弘亚数控	86,520	3,352,650.00	0.18
132	002001	新 和 成	112,220	3,218,469.60	0.17
133	601233	桐昆股份	124,800	3,006,432.00	0.16
134	603877	太平鸟	55,300	2,951,914.00	0.16
135	600483	福能股份	267,200	2,802,928.00	0.15
136	300737	科顺股份	87,200	2,741,568.00	0.15
137	002928	华夏航空	181,453	2,739,940.30	0.15
138	600926	杭州银行	185,072	2,729,812.00	0.15
139	601100	恒立液压	30,094	2,585,676.48	0.14
140	600132	重庆啤酒	12,900	2,553,555.00	0.14
141	002891	中宠股份	62,100	2,546,100.00	0.14
142	601009	南京银行	238,100	2,504,812.00	0.13
143	300671	富满电子	18,600	2,448,504.00	0.13
144	300623	捷捷微电	64,600	2,443,818.00	0.13
145	600309	万华化学	22,400	2,437,568.00	0.13
146	601021	春秋航空	42,300	2,406,870.00	0.13
147	603885	吉祥航空	157,600	2,404,976.00	0.13
148	300415	伊之密	111,200	2,390,800.00	0.13
149	601689	拓普集团	63,100	2,361,833.00	0.13
150	600426	华鲁恒升	74,040	2,291,538.00	0.12
151	600985	淮北矿业	186,500	2,277,165.00	0.12
152	603568	伟明环保	94,000	2,146,020.00	0.11
153	300458	全志科技	23,900	2,095,074.00	0.11
154	300207	欣旺达	63,700	2,074,072.00	0.11
155	000100	TCL 科技	267,200	2,044,080.00	0.11
156	300119	瑞普生物	60,300	2,039,346.00	0.11

157	002043	兔 宝 宝	206,700	2,038,062.00	0.11
158	600795	国电电力	836,200	2,031,966.00	0.11
159	600176	中国巨石	129,390	2,006,838.90	0.11
160	300529	健帆生物	23,208	2,004,242.88	0.11
161	300596	利安隆	44,700	1,936,851.00	0.10
162	688111	金山办公	4,900	1,934,520.00	0.10
163	300662	科锐国际	31,000	1,879,220.00	0.10
164	000725	京东方 A	297,300	1,855,152.00	0.10
165	603113	金能科技	99,200	1,791,552.00	0.10
166	603290	斯达半导	5,500	1,760,000.00	0.09
167	300073	当升科技	31,300	1,758,747.00	0.09
168	002690	美亚光电	31,500	1,756,440.00	0.09
169	300638	广和通	36,700	1,713,890.00	0.09
170	002271	东方雨虹	30,531	1,688,974.92	0.09
171	603060	国检集团	96,860	1,652,431.60	0.09
172	002601	龙蟠佰利	47,100	1,628,718.00	0.09
173	601311	骆驼股份	138,700	1,604,759.00	0.09
174	000739	普洛药业	54,300	1,596,420.00	0.09
175	300035	中科电气	64,300	1,572,135.00	0.08
176	300132	青松股份	71,700	1,512,870.00	0.08
177	002080	中材科技	57,056	1,493,155.52	0.08
178	300685	艾德生物	13,900	1,446,712.00	0.08
179	000538	云南白药	12,500	1,446,500.00	0.08
180	002444	巨星科技	42,400	1,444,992.00	0.08
181	600019	宝钢股份	179,600	1,372,144.00	0.07
182	600188	兖州煤业	86,900	1,334,784.00	0.07
183	603613	国联股份	13,100	1,309,607.00	0.07
184	603489	八方股份	5,500	1,300,090.00	0.07
185	603098	森特股份	31,700	1,233,130.00	0.07
186	600111	北方稀土	56,900	1,177,830.00	0.06
187	603799	华友钴业	9,600	1,096,320.00	0.06
188	300661	圣邦股份	4,231	1,069,300.63	0.06
189	603599	广信股份	35,200	1,058,816.00	0.06
190	002293	罗莱生活	78,600	1,052,454.00	0.06
191	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.06
192	002884	凌霄泵业	44,940	1,046,652.60	0.06
193	300726	宏达电子	14,700	1,036,203.00	0.06
194	002241	歌尔股份	23,858	1,019,690.92	0.05
195	688696	极米科技	1,252	976,860.48	0.05
196	603583	捷昌驱动	18,344	928,573.28	0.05
197	000902	新洋丰	58,700	917,481.00	0.05
198	600486	扬农化工	7,800	871,806.00	0.05

199	002556	辉隆股份	76,400	828,940.00	0.04
200	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.04
201	601166	兴业银行	39,600	813,780.00	0.04
202	002539	云图控股	90,200	787,446.00	0.04
203	002078	太阳纸业	58,200	776,970.00	0.04
204	600740	山西焦化	148,460	754,176.80	0.04
205	300567	精测电子	11,500	706,100.00	0.04
206	603612	索通发展	39,100	702,627.00	0.04
207	601965	中国汽研	40,200	694,656.00	0.04
208	002508	老板电器	14,500	674,250.00	0.04
209	601677	明泰铝业	34,100	666,655.00	0.04
210	600690	海尔智家	24,880	644,640.80	0.03
211	603236	移远通信	3,770	643,199.70	0.03
212	300144	宋城演艺	38,200	641,760.00	0.03
213	300474	景嘉微	6,500	636,480.00	0.03
214	000825	太钢不锈	78,400	587,216.00	0.03
215	300699	光威复材	7,687	583,827.65	0.03
216	600236	桂冠电力	93,700	581,877.00	0.03
217	600315	上海家化	9,300	559,302.00	0.03
218	600452	涪陵电力	37,600	540,312.00	0.03
219	600456	宝钛股份	12,400	531,960.00	0.03
220	600970	中材国际	57,400	526,358.00	0.03
221	600143	金发科技	24,300	506,898.00	0.03
222	603979	金诚信	28,100	505,800.00	0.03
223	000983	山西焦煤	60,600	503,586.00	0.03
224	000301	东方盛虹	23,900	499,510.00	0.03
225	000921	海信家电	34,600	497,202.00	0.03
226	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.03
227	601666	平煤股份	67,300	478,503.00	0.03
228	002475	立讯精密	10,400	478,400.00	0.03
229	002677	浙江美大	25,900	473,452.00	0.03
230	002459	晶澳科技	9,600	470,400.00	0.03
231	601898	中煤能源	64,800	463,320.00	0.02
232	600258	首旅酒店	18,600	443,796.00	0.02
233	688690	纳微科技	3,477	408,547.50	0.02
234	688626	翔宇医疗	3,652	380,392.32	0.02
235	000568	泸州老窖	1,604	378,447.76	0.02
236	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.02
237	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.02
238	601168	西部矿业	30,000	357,900.00	0.02
239	002074	国轩高科	8,000	348,480.00	0.02
240	002050	三花智控	14,040	336,679.20	0.02

241	002595	豪迈科技	12,500	333,750.00	0.02
242	603218	日月股份	12,300	333,084.00	0.02
243	002876	三利谱	5,100	329,970.00	0.02
244	688005	容百科技	2,700	327,240.00	0.02
245	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.02
246	603267	鸿远电子	2,520	322,358.40	0.02
247	300476	胜宏科技	14,700	321,195.00	0.02
248	300566	激智科技	11,240	314,607.60	0.02
249	600584	长电科技	8,200	308,976.00	0.02
250	688269	凯立新材	1,941	270,808.32	0.01
251	600089	特变电工	20,300	260,855.00	0.01
252	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.01
253	603027	千禾味业	9,059	238,161.11	0.01
254	301009	可靠股份	7,207	238,093.97	0.01
255	688613	奥精医疗	2,617	237,597.43	0.01
256	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
257	603678	火炬电子	3,067	207,022.50	0.01
258	600141	兴发集团	10,900	205,247.00	0.01
259	002340	格林美	21,000	196,350.00	0.01
260	300101	振芯科技	10,200	182,682.00	0.01
261	300919	中伟股份	1,110	180,930.00	0.01
262	000547	航天发展	9,100	171,717.00	0.01
263	300613	富瀚微	1,100	171,468.00	0.01
264	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.01
265	600570	恒生电子	1,800	167,850.00	0.01
266	688390	固德威	500	167,000.00	0.01
267	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.01
268	688408	中信博	800	160,640.00	0.01
269	300861	美畅股份	1,900	160,189.00	0.01
270	002572	索菲亚	6,600	159,720.00	0.01
271	600997	开滦股份	21,000	157,500.00	0.01
272	002511	中顺洁柔	5,700	157,035.00	0.01
273	000963	华东医药	3,400	156,434.00	0.01
274	603505	金石资源	8,047	156,031.33	0.01
275	002092	中泰化学	14,300	146,861.00	0.01
276	300357	我武生物	2,200	141,064.00	0.01
277	688216	气派科技	2,000	133,400.00	0.01
278	688097	博众精工	3,983	132,235.60	0.01
279	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.01
280	300413	芒果超媒	1,921	131,780.60	0.01
281	600507	方大特钢	19,000	128,820.00	0.01
282	688319	欧林生物	3,412	127,642.92	0.01

283	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.01
284	688625	呈和科技	2,672	113,907.36	0.01
285	002025	航天电器	2,100	105,357.00	0.01
286	002497	雅化集团	4,200	95,676.00	0.01
287	603606	东方电缆	4,500	90,630.00	0.00
288	002242	九阳股份	2,703	87,820.47	0.00
289	688669	聚石化学	2,681	86,837.59	0.00
290	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
291	601877	正泰电器	2,500	83,450.00	0.00
292	300224	正海磁材	7,500	81,525.00	0.00
293	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
294	000333	美的集团	1,130	80,648.10	0.00
295	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
296	688636	智明达	918	74,100.96	0.00
297	002056	横店东磁	5,300	68,900.00	0.00
298	300470	中密控股	1,700	65,688.00	0.00
299	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
300	600346	恒力石化	2,400	62,976.00	0.00
301	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.00
302	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.00
303	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
304	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
305	301010	晶雪节能	2,172	50,480.96	0.00
306	603010	万盛股份	2,380	49,908.60	0.00
307	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.00
308	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.00
309	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
310	688067	爱威科技	1,259	39,520.01	0.00
311	688367	工大高科	1,717	37,035.69	0.00
312	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
313	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
314	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
315	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
316	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
317	600409	三友化工	1,700	17,187.00	0.00
318	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
319	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
320	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
321	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.00
322	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
323	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
324	300937	药易购	244	13,105.24	0.00

325	603129	春风动力	100	12,408.00	0.00
326	000661	长春高新	32	12,384.00	0.00
327	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
328	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
329	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
330	300724	捷佳伟创	100	11,601.00	0.00
331	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
332	300033	同花顺	100	11,278.00	0.00
333	300558	贝达药业	100	10,824.00	0.00
334	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
335	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
336	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
337	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
338	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
339	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
340	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
341	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
342	600760	中航沈飞	140	8,442.00	0.00
343	603517	绝味食品	100	8,429.00	0.00
344	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
345	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
346	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
347	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
348	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
349	300618	寒锐钴业	100	7,884.00	0.00
350	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
351	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
352	603298	杭叉集团	400	7,256.00	0.00
353	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
354	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
355	002959	小熊电器	100	6,644.00	0.00
356	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
357	002032	苏泊尔	100	6,379.00	0.00
358	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
359	603288	海天味业	47	6,060.65	0.00
360	603187	海容冷链	140	6,003.20	0.00
361	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
362	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
363	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
364	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
365	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
366	600893	航发动力	100	5,319.00	0.00

367	603883	老百姓	100	5,268.00	0.00
368	300617	安靠智电	100	4,879.00	0.00
369	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
370	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
371	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
372	002557	洽洽食品	100	4,310.00	0.00
373	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
374	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
375	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
376	002008	大族激光	100	4,039.00	0.00
377	002414	高德红外	140	3,861.20	0.00
378	300607	拓斯达	100	3,480.00	0.00
379	002597	金禾实业	100	3,470.00	0.00
380	300659	中孚信息	100	3,357.00	0.00
381	002153	石基信息	140	3,291.40	0.00
382	300034	钢研高纳	100	3,221.00	0.00
383	600703	三安光电	100	3,205.00	0.00
384	600862	中航高科	100	3,078.00	0.00
385	000636	风华高科	100	3,022.00	0.00
386	300674	宇信科技	160	2,990.40	0.00
387	002867	周大生	150	2,965.50	0.00
388	300433	蓝思科技	100	2,941.00	0.00
389	002439	启明星辰	100	2,901.00	0.00
390	603308	应流股份	140	2,891.00	0.00
391	000977	浪潮信息	100	2,813.00	0.00
392	603337	杰克股份	100	2,673.00	0.00
393	600741	华域汽车	100	2,627.00	0.00
394	002299	圣农发展	100	2,388.00	0.00
395	600362	江西铜业	100	2,238.00	0.00
396	600323	瀚蓝环境	100	2,179.00	0.00
397	002236	大华股份	100	2,110.00	0.00
398	000581	威孚高科	100	2,083.00	0.00
399	300054	鼎龙股份	100	1,825.00	0.00
400	300188	美亚柏科	100	1,740.00	0.00
401	300369	绿盟科技	100	1,595.00	0.00
402	002064	华峰化学	100	1,420.00	0.00
403	000878	云南铜业	100	1,283.00	0.00
404	600066	宇通客车	100	1,249.00	0.00
405	000703	恒逸石化	100	1,195.00	0.00
406	601699	潞安环能	100	1,181.00	0.00
407	300227	光韵达	100	990.00	0.00
408	000933	神火股份	100	945.00	0.00

409	000708	中信特钢	40	833.60	0.00
410	000528	柳 工	100	820.00	0.00
411	600516	方大炭素	100	744.00	0.00
412	000932	华菱钢铁	100	660.00	0.00
413	601003	柳钢股份	100	590.00	0.00
414	601985	中国核电	100	506.00	0.00
415	000717	韶钢松山	100	459.00	0.00
416	000898	鞍钢股份	100	445.00	0.00
417	000778	新兴铸管	100	372.00	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	603128	华贸物流	14,233,531.36	0.57
2	603816	顾家家居	14,043,226.32	0.57
3	002572	索菲亚	13,883,257.30	0.56
4	688169	石头科技	13,648,893.48	0.55
5	603833	欧派家居	13,490,417.89	0.54
6	603801	志邦家居	13,207,726.15	0.53
7	300782	卓胜微	12,758,708.17	0.52
8	002142	宁波银行	12,143,374.03	0.49
9	603008	喜临门	12,112,352.45	0.49
10	603486	科沃斯	11,827,636.80	0.48
11	603127	昭衍新药	11,614,617.00	0.47
12	601318	中国平安	11,598,849.00	0.47
13	300725	药石科技	11,308,518.20	0.46
14	300759	康龙化成	11,271,917.00	0.46
15	601636	旗滨集团	11,068,734.50	0.45
16	601888	中国中免	11,021,331.00	0.45
17	603501	韦尔股份	10,461,338.32	0.42
18	002139	拓邦股份	10,237,924.32	0.41
19	603588	高能环境	10,236,892.04	0.41
20	600900	长江电力	9,790,027.00	0.40

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	601012	隆基股份	99,422,346.49	4.02
2	000858	五粮液	71,382,926.52	2.88
3	600519	贵州茅台	48,248,099.25	1.95
4	002594	比亚迪	47,752,908.92	1.93
5	300750	宁德时代	47,269,012.78	1.91

6	601166	兴业银行	41,984,010.22	1.70
7	600809	山西汾酒	40,758,279.29	1.65
8	002142	宁波银行	37,737,519.46	1.52
9	601100	恒立液压	37,412,045.76	1.51
10	002475	立讯精密	35,848,493.52	1.45
11	000333	美的集团	33,672,459.00	1.36
12	600036	招商银行	30,377,832.00	1.23
13	300760	迈瑞医疗	30,348,228.33	1.23
14	300015	爱尔眼科	30,005,167.31	1.21
15	600031	三一重工	28,993,533.15	1.17
16	002179	中航光电	28,208,064.90	1.14
17	600763	通策医疗	27,849,342.77	1.12
18	600926	杭州银行	27,223,363.92	1.10
19	300014	亿纬锂能	26,733,524.39	1.08
20	300059	东方财富	25,386,008.54	1.03

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	1,415,081,312.32
卖出股票收入（成交）总额	2,131,785,498.73

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	90,044,000.00	4.80
	其中：政策性金融债	90,044,000.00	4.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	90,044,000.00	4.80

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	200309	20 进出 09	500,000	50,020,000.00	2.67

2	210201	21 国开 01	400,000	40,024,000.00	2.14
---	--------	----------	---------	---------------	------

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2107	IC2107	15	20,301,600.00	-95,360.00	-
IF2107	IF2107	10	15,573,600.00	352,380.00	-
公允价值变动总额合计（元）					257,020.00
股指期货投资本期收益（元）					4,860,541.14
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-2,092,796.47

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，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

无。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

7.11.3 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

(1) 2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】67 号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规事实，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 4880 万元。

2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）16 号），对招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2021 年 5 月 17 日作出行政处罚决定，罚款 7170 万元。

本基金投资于“招商银行（600036）”的决策程序说明：基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“招商银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。本基金投资于“21 国开 01（210201）”的决策程序说明：基于对 21 国开 01 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“21 国开 01”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他八名证券发行主体无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。

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中，没有超出基金合同规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	5,009,052.51
2	应收证券清算款	9,873,171.26
3	应收股利	—
4	应收利息	1,604,642.11
5	应收申购款	85,058.09
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	16,571,923.97

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

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 (%)
31,530	43,218.00	2,080,927.49	0.15	1,360,582,495.61	99.85

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	178,128.89	0.01

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 6 月 9 日) 基金份额总额	16,549,730,858.05
本报告期期初基金份额总额	1,892,235,926.21
本报告期基金总申购份额	39,109,709.26
减：本报告期基金总赎回份额	568,682,212.37
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	1,362,663,423.10

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，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

2021 年 5 月 29 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，杨竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、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，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

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

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关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	

东方证券股份有限公司	2	1,168,599,264.95	33.04%	772,139.82	32.93%	—
东方财富证券股份有限公司	2	835,640,651.94	23.63%	527,544.60	22.50%	—
长江证券股份有限公司	3	408,390,650.04	11.55%	285,876.06	12.19%	—
国盛证券有限责任公司	2	404,186,879.65	11.43%	255,161.22	10.88%	—
中信建投证券股份有限公司	2	176,442,334.31	4.99%	123,509.65	5.27%	—
广发证券股份有限公司	1	136,530,653.58	3.86%	95,573.14	4.08%	—
中泰证券股份有限公司	1	113,334,256.23	3.20%	79,335.05	3.38%	—
国信证券股份有限公司	2	89,991,262.92	2.54%	63,081.05	2.69%	—
海通证券股份有限公司	2	81,636,538.92	2.31%	57,145.61	2.44%	—
中信证券股份有限公司	2	59,324,865.67	1.68%	41,527.38	1.77%	—

北京高华 证券有限 责任公司	2	56,238,116.68	1.59%	39,367.13	1.68%	-
华泰证券 股份有限 公司	1	6,287,105.27	0.18%	4,400.98	0.19%	-
安信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国都证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

开源证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	-

中银国际 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
----------------------	---	---	---	---	---	---

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) 研究能力较强；

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：长城证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：开源证券股份有限公司新增交易单元 2 个，浙商证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

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	
	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
东方证券股份有限公司	454,180.60	4.31%	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	8,639,161.20	81.94%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

广发证券股份有限公司						
中泰证券股份有限公司						
国信证券股份有限公司	1,449,909.72	13.75%				
海通证券股份有限公司						
中信证券股份有限公司						
北京高华证券有限责任公司						
华泰证券股份有限公司						
安信证券股份有限公司						
东吴证券股份有限公司						
东兴证券股份有限公司						
光大证券股份有限公司						
国都证券股份有限公司						
国金证券股份有限公司						
国泰君安证券股份有限公司						
华福证券有限责任						

公司						
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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关闭跨 TA 转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 21 日
2	关于嘉实基金管理有限公司旗下部分基金 2020 年年度报告的更正公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 04 月 13 日
3	嘉实基金管理有限公司关于终止凤凰金信（银川）基金销售有限公司办理	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2021 年 05 月 07 日

	旗下基金相关销售业务的公告	金电子披露网站	
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实事件驱动股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实事件驱动股票型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 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

11.3 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

2021 年 8 月 27 日