

嘉实新能源新材料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	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52

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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	65
§ 11 备查文件目录	65
11.1 备查文件目录	65
11.2 存放地点	65
11.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新能源新材料股票型证券投资基金	
基金简称	嘉实新能源新材料股票	
基金主代码	003984	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 3 月 16 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	1,705,087,489.73 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实新能源新材料股票 A	嘉实新能源新材料股票 C
下属分级基金的交易代码	003984	003985
报告期末下属分级基金的份额总额	1,433,948,644.81 份	271,138,844.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于新能源新材料行业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将及时跟踪市场环境变化，根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场变化情况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。本基金根据新能源新材料的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。 本基金主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略等
业绩比较基准	中证全指一级行业能源指数收益率×40%+中证全指一级行业材料指数收益率×40%+中债综合指数收益率×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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	010-66594319
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.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）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京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	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100005	100818
法定代表人	经雷	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
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)	
	嘉实新能源新材料股票 A	嘉实新能源新材料股票 C
本期已实现收益	335,348,545.39	57,270,334.96
本期利润	607,050,402.82	105,335,493.31
加权平均基金份额本期利润	0.4544	0.4611
本期加权平均净值利润率	16.13%	16.57%
本期基金份额净值增长率	15.72%	15.42%

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	1,351,932,036.31	246,727,048.65
期末可供分配基金份额利润	0.9428	0.9100
期末基金资产净值	4,679,073,913.75	871,640,237.19
期末基金份额净值	3.2631	3.2147
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	226.31%	221.47%

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

嘉实新能源新材料股票 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
过去一个月	9.92%	1.45%	1.69%	0.94%	8.23%	0.51%
过去三个月	26.93%	1.30%	9.32%	1.04%	17.61%	0.26%
过去六个月	15.72%	1.71%	13.95%	1.26%	1.77%	0.45%
过去一年	80.83%	1.80%	34.70%	1.22%	46.13%	0.58%

过去三年	252.54%	1.79%	20.00%	1.15%	232.54%	0.64%
自基金合同生效起至今	226.31%	1.66%	4.56%	1.10%	221.75%	0.56%

嘉实新能源新材料股票 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
过去一个月	9.87%	1.45%	1.69%	0.94%	8.18%	0.51%
过去三个月	26.77%	1.30%	9.32%	1.04%	17.45%	0.26%
过去六个月	15.42%	1.71%	13.95%	1.26%	1.47%	0.45%
过去一年	79.92%	1.80%	34.70%	1.22%	45.22%	0.58%
过去三年	249.16%	1.79%	20.00%	1.15%	229.16%	0.64%
自基金合同生效起至今	221.47%	1.66%	4.56%	1.10%	216.91%	0.56%

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：

$$\begin{aligned} \text{Return}(t) = & 40\% \times (\text{中证全指一级行业能源指数}(t) / \text{中证全指一级行业能源指数}(t-1) - 1) \\ & + 40\% \times (\text{中证全指一级行业材料指数收益率}(t) / \text{中证全指一级行业材料指数收益率}(t-1) - 1) \\ & + 20\% \times (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) \end{aligned}$$

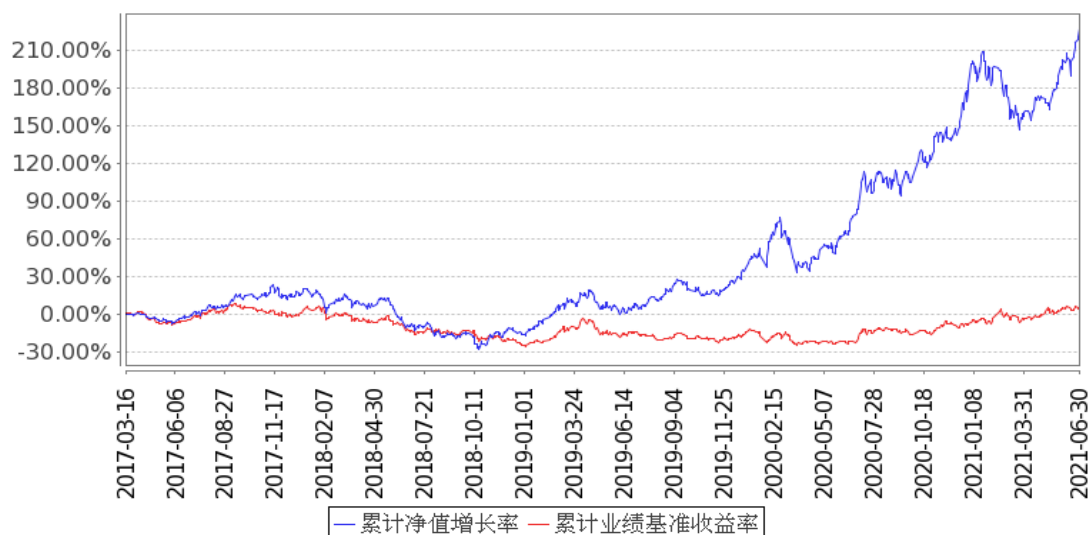
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

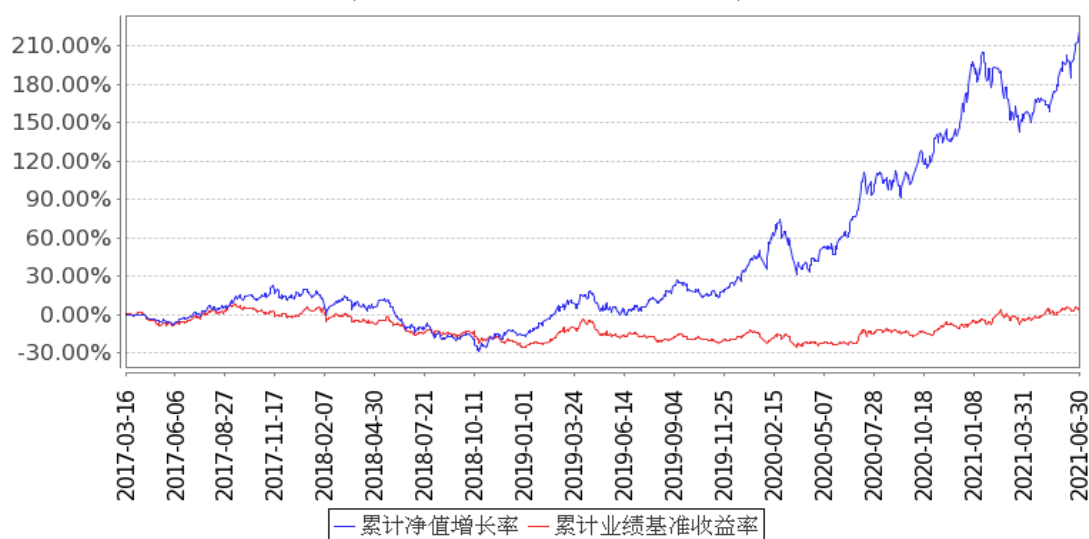
嘉实新能源新材料股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年03月16日至2021年06月30日)



嘉实新能源新材料股票C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

(2017年03月16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		
姚志鹏	本基金、嘉实环保低碳股票、嘉实智能汽车股票、嘉实产业先锋混合、嘉实动力先锋混合基金经理	2017 年 3 月 16 日	-	10 年	2011 年加入嘉实基金管理有限公司, 曾任股票研究部研究员一职, 现任主基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 中国国籍。
熊昱洲	本基金基金经理	2021 年 1 月 26 日	-	5 年	2015 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司研究部, 从事行业研究工作。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、《嘉实新能源新材料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

过去的半年之中，市场呈现了显著不同于前两年的特质，波动率明显加大，波动率加大往往预示着市场分歧加大，是结构变化的一个重要特征。春节前夕整体市场非常亢奋，春节后迅速跌落谷底，而二季度随着流动性预期逆转，成长类资产重新迎来明显的反弹。除了市场的波动率显著加大以外，结构上也有明显的变化，一方面行情更集中于更少的高景气行业，另一方面，出现比较明显的市值下沉特质，这些趋势我们认为都需要保持重点关注。

从大势来看，我们认为中国宏观经济后续仍在复苏通道之中，但斜率最快的时候逐步过去，经济未来的趋势基本平稳。流动性方面，由于中国在应对疫情时相对克制，因此货币政策具备较大的灵活性，近期降准也是受益于此。中国和全球的疫情依然偶有反复，但我们认为还是属于节奏上的扰动，逐步复苏的大趋势依然不变。全球而言，由于这轮应对疫情的海外流动性释放非常充分，未来依然会有收缩的压力，但全球经济的进一步复苏也有望推动企业盈利上行，趋势也有望保持稳定。整体而言，我们认为市场没有系统性机会，但也没有系统性的风险，更多是结构性的机遇和结构性的风险，后续的波动率可能依然会较大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实新能源新材料股票 A 基金份额净值为 3.2631 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.72%；截至本报告期末嘉实新能源新材料股票 C 基金份额净值为 3.2147 元，本报告期基金份额净值增长率为 15.42%；业绩比较基准收益率为 13.95%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

投资就是投资国运，所以每一个时代的领先资产，往往也都带着清晰且不可磨灭的时代印迹。上一个 5 年的茅指数，和再往前推一个 5 年的互联网资产，都是时代趋势之下的微观缩影和体现。今年市场的大分化之表现，已经将大变局的趋势缓缓展开。“向来英雄如美人，不许人间有白头”。每一个企业和行业都有自身生命周期的最佳时刻，所有的企业都会经历初创期、成长期，也都会进入成熟期和衰落期。因此，客观的投资要跟随产业的发展趋势，在企业最好的发展阶段投资。未来的中国，随着政府对于教育、医疗和地产等三座大山监管强化，要素成本得到了有效控制，

中国将更加从容的应对未来对于全球领先经济体的赶超阶段，也有更好的基础来实现新能源、芯片等先进产业的发展，未来经济进入中长期的质量增长。社会调控也将更加注重价值创造的正外部效应，而不是存量利益的博弈。资本市场作为资源配置工具，存在的意义是服务实体经济，让优秀的企业脱颖而出。因此，我们相信投资还是要回归本源，让优秀企业的变革被发现，伴随优秀企业的成长，最终，企业的价值增长也会回报我们投资者。

今年可能成为非常重要的转折之年，成为布局未来 3-5 年赢家资产的关键时刻。顺应时代趋势、具备全球竞争力的“宁组合”的关注度目前正在持续酝酿和提升，目前可能是布局这类企业的黄金时刻，正如 16 年对于茅指数布局的意义。随着可再生能源和人工智能的发展，我们看到了很多新产业趋势在以令人惊叹的速度快速崛起，也看到了很多中国人重未涉足的空白逐步被填满。这样一个大江大河的大时代，必将诞生一批具备全球竞争力的先锋企业。如同我们在 12 年把握光伏的历史拐点，14 年看到电动车的蓬勃兴起，16 年看到汽车电子的逆势，我们作为投资者会庆幸在这样的时代做投资。

从中长期 5-10 年的维度来看，中国企业拥有全球范围内最为稀缺的稳定成长性，特别是具备全球竞争力的先进制造企业，社会财富向权益资产的配置提升也是长期趋势，我们非常看好中长期的市场表现，也是中国国运之重要体现。从短中期 1-3 年的趋势来看，在经历了过去两年较为充分的市场上涨和估值扩张之后，均衡配置和估值性价比的考虑需要更加侧重。立足中期维度，能源革命、人工智能仍然是新康波周期重要的中期驱动力，同时新消费和生物医药也不乏亮点。人工智能的导入带来了未来十年的新硬件终端智能汽车的发展和产业互联网的崛起。同时国际环境的不确定会带来中国产业安全、能源安全、粮食安全、信息安全和国家安全等领域的需求，也使得相关产业加速发展。

碳中和成为全球共识的重大产业趋势，新能源汽车也开始形成全球共振上行趋势。国内渗透率已经达到 15% 的黄金成长点，相比去年的 5% 大幅度提升，而且渗透率提升的速度甚至明显快于国家的规划。10% 左右的渗透率是成长性行业从萌芽期到成长期的关键拐点，往往后继是一个五到七年渗透率提升到 70% 的过程。随着中国和欧洲市场相继越过这个关键拐点，新能源汽车的发展已经成为趋势。目前全球范围内看，欧洲德国法国英国的渗透率均接近 20%，美国随着政策的推进未来也有望加速渗透。我们正处于全球智能汽车新的产业周期的启动时刻，未来的新的需求的爆发可能会超出市场预期，特别是新供给的创造者，不仅仅引领了技术的变迁，也成为了需求的创造者。短期在芯片短缺的扰动仍未完全消除，但需求端的因素我们认为才是真正的长期的主导力量。作为新科技终端的智能汽车将是中长期最重要的产业方向之一。短期看，整车和资源端存在一定的泡沫，因此围绕着各环节的核心龙头企业仍然是中期重要的配置方向。

而随着传统互联网平台逐步变成基础设施，全社会的效率将进一步提升。同时随着企业级的信息化改造和数字化转型，未来企业端的数据产生和变现将成为中长期重要的科技动力，围绕者疫情之后企业的数字化转型，包括移动办公，信息安全，工业软件等信息化方向将成为和智能汽车同样重要的产业方向。尤其是疫情之后我们见到越来越多的网络会议，协同办公，数据也越来越存储云端，数字化转型会带来信息产业的长期繁荣。

随着 Z 世代的崛起，新的消费趋势值得关注，19 年我们提出 Z 世代消费是未来重要的消费趋势后，我们已经见证了电子烟、医美、国潮化妆品、运动休闲等产业的爆发，展望未来，Z 世代的消费具备实用主义、迭代快、民族自信等特征，其中部分特征非常类似于日本的 90 年代以后的消费特征。因此未来消费的投资可能会告别过去数年的所谓消费升级的逻辑，而是更关注边际变化，更加快速应对 Z 世代的消费机遇。

生物医药同样面对着人类对抗疾病，延长自身寿命的使命，随着基因治疗等新的技术的发展，生物医药也迎来越来越多的机遇，但是如同新消费一样，这些领域目前仍然面临着拥挤的赛道和过去几年过度扩张的估值压力。同时随着中国医药医疗政策越来越注重公平，很多模仿类的企业的超额利润会被快速压缩，未来盈利前景可能大幅压缩，未来只有少数具备全球首创能力的医药医疗企业具备较大的市值扩张空间。

我们认为股票投资的背后无论是基本面还是股价对基本面的反馈机制，都有无数的因子在发挥作用，作为投资者只能用有限的关键因子去做决策。而随着外部环境等因素的变化，不同阶段的关键因子也会发生变化，因此，投资是没有所谓用框架和方法包打天下的。很多的方法本身都带着深深的偏见。因此投资组合的管理重要是通过提高决策的正确率和单次决策的赢面来实现长期的超额回报。通俗就是将对的时候挣大钱，错的时候亏小钱。我们认为要沿着长期的产业线索，在他们景气度上行的阶段投资其中能够打胜仗的公司，因为投资决策信息的局限性，要做到适当的分散来降低决策的风险。围绕 6~7 个核心赛道进行配置。同时任何时候都要注重估值的合理性，历史上每一次高估值的泡沫最终都破灭了，从 07 年的资源泡沫到 15 年的互联网泡沫再到这次所谓的核心资产高估，估值的约束最终是实现组合收益和控制风险的核心要素。今年的高波动率，疫情和流动性的反复，对短期操作会带来明显的难度和挑战，同时对于未来具备较大产业意义的企业的挖掘也是一件艰苦的工作。不论是行业的分析，还是管理层的评估本身都牵扯大量的精力，也会有一定失败的概率。但我们仍将以“我将无我”的态度，继续聚焦于发掘下一个 3-5 年的重大产业趋势和先锋企业，找到真正的“宁组合”，与企业长期共同成长。

结合我们方法论的 ROE 工具，我们看好新硬件终端汽车行业电动化和电子化的机会，同时看好数字化转型的产业机会，以及在这个背景下，具备全球竞争力的先锋企业。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实新能源新材料股票型证券投资基金（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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：嘉实新能源新材料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	958,395,965.69	637,000,713.86
结算备付金		2,311,522.87	2,925,986.93
存出保证金		820,253.58	201,895.99
交易性金融资产	6.4.7.2	4,612,202,346.00	3,125,803,947.80
其中：股票投资		4,547,679,649.22	3,125,803,947.80
基金投资		-	-
债券投资		64,522,696.78	-
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		30,467,815.13	-
应收利息	6.4.7.5	221,875.08	33,870.54
应收股利		-	-
应收申购款		81,360,585.38	36,539,498.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,685,780,363.73	3,802,505,913.34
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		-	79,518,478.50
应付赎回款		125,570,650.41	63,237,283.60
应付管理人报酬		6,259,263.19	3,643,039.60
应付托管费		1,043,210.56	607,173.25
应付销售服务费		317,256.44	190,249.00
应付交易费用	6.4.7.7	1,640,648.60	1,176,915.48
应交税费		760.03	2.15
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	234,423.56	261,450.06
负债合计		135,066,212.79	148,634,591.64
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,705,087,489.73	1,298,185,160.54
未分配利润	6.4.7.10	3,845,626,661.21	2,355,686,161.16
所有者权益合计		5,550,714,150.94	3,653,871,321.70
负债和所有者权益总计		5,685,780,363.73	3,802,505,913.34

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，嘉实新能源新材料股票 A 基金份额净值 3.2631 元，基金份额总额 1,433,948,644.81 份，嘉实新能源新材料股票 C 基金份额净值 3.2147 元，基金份额总额 271,138,844.92 份，基金份额总额合计为 1,705,087,489.73 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实新能源新材料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		757,829,880.01	220,586,457.01
1. 利息收入		958,366.07	278,523.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	910,829.35	221,481.31
债券利息收入		47,536.72	57,042.64
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）		422,666,962.61	85,091,009.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	398,511,273.47	76,283,139.10
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,310,357.60	4,623,471.88
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	22,845,331.54	4,184,398.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	319,767,015.78	132,597,119.10

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	14, 437, 535. 55	2, 619, 804. 42
减：二、费用		45, 443, 983. 88	9, 245, 850. 99
1. 管理人报酬	-	32, 734, 626. 94	5, 920, 094. 30
2. 托管费	-	5, 455, 771. 19	986, 682. 40
3. 销售服务费	-	1, 576, 918. 56	413, 759. 41
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	5, 543, 068. 92	1, 809, 447. 77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		171. 20	19. 46
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	133, 427. 07	115, 847. 65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		712, 385, 896. 13	211, 340, 606. 02
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		712, 385, 896. 13	211, 340, 606. 02

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实新能源新材料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, 298, 185, 160. 54	2, 355, 686, 161. 16	3, 653, 871, 321. 70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	712, 385, 896. 13	712, 385, 896. 13
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）	406, 902, 329. 19	777, 554, 603. 92	1, 184, 456, 933. 11
其中：1. 基金申购款	1, 796, 410, 348. 43	3, 392, 129, 790. 52	5, 188, 540, 138. 95
2. 基金赎回款	-1, 389, 508, 019. 24	-2, 614, 575, 186. 60	-4, 004, 083, 205. 84
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）	1,705,087,489.73	3,845,626,661.21	5,550,714,150.94
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）	461,190,397.91	162,724,156.28	623,914,554.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	211,340,606.02	211,340,606.02
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）	114,481,709.41	86,752,848.79	201,234,558.20
其中：1. 基金申购款	726,270,656.88	435,128,905.14	1,161,399,562.02
2. 基金赎回款	-611,788,947.47	-348,376,056.35	-960,165,003.82
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）	575,672,107.32	460,817,611.09	1,036,489,718.41

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

嘉实新能源新材料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[2016]1633 号《关于准予嘉实新能源新材料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《嘉实新能源新材料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,《嘉实新能源新材料股票型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,314,003,567.13 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》、《嘉实新能源新材料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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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	958,395,965.69
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	958,395,965.69

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	3,337,505,284.45	4,547,679,649.22	1,210,174,364.77
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	64,522,696.78	7,943,686.44
	银行间市场	—	—
	合计	64,522,696.78	7,943,686.44
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	3,394,084,294.79	4,612,202,346.00	1,218,118,051.21

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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。

6.4.7.5 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	59,083.59
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	936.09

应收债券利息	161,523.21
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	332.19
合计	221,875.08

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	1,640,648.60
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,640,648.60

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	125,327.62
应付证券出借违约金	—
预提费用	109,095.94
合计	234,423.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实新能源新材料股票 A

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	1,099,266,320.51	1,099,266,320.51
本期申购	1,442,035,501.04	1,442,035,501.04
本期赎回（以“-”号填列）	-1,107,353,176.74	-1,107,353,176.74
-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	1,433,948,644.81	1,433,948,644.81

嘉实新能源新材料股票 C

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	198,918,840.03	198,918,840.03
本期申购	354,374,847.39	354,374,847.39
本期赎回（以“-”号填列）	-282,154,842.50	-282,154,842.50
-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	271,138,844.92	271,138,844.92

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

嘉实新能源新材料股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	770,115,976.80	1,230,488,948.28	2,000,604,925.08
本期利润	335,348,545.39	271,701,857.43	607,050,402.82
本期基金份额交易产生的变动数	246,467,514.12	391,002,426.92	637,469,941.04
其中：基金申购款	1,120,918,978.66	1,608,909,346.95	2,729,828,325.61
基金赎回款	-874,451,464.54	-1,217,906,920.03	-2,092,358,384.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,351,932,036.31	1,893,193,232.63	3,245,125,268.94

嘉实新能源新材料股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	134,855,988.49	220,225,247.59	355,081,236.08
本期利润	57,270,334.96	48,065,158.35	105,335,493.31
本期基金份额交易产生的变动数	54,600,725.20	85,483,937.68	140,084,662.88
其中：基金申购款	270,000,634.15	392,300,830.76	662,301,464.91
基金赎回款	-215,399,908.95	-306,816,893.08	-522,216,802.03

本期已分配利润	-	-	-
本期末	246,727,048.65	353,774,343.62	600,501,392.27

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	875,086.87
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	30,575.48
其他	5,167.00
合计	910,829.35

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	398,511,273.47
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	398,511,273.47

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	1,956,150,967.44
减：卖出股票成本总额	1,557,639,693.97
买卖股票差价收入	398,511,273.47

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	1,310,357.60
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	1,310,357.60

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	6,171,135.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	4,856,600.00
减：应收利息总额	4,177.75
买卖债券差价收入	1,310,357.60

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

无。

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	22,845,331.54
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	22,845,331.54

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	319,767,015.78
股票投资	311,823,329.34
债券投资	7,943,686.44
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	319,767,015.78

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	13,551,725.86
基金转出费收入	885,809.69
合计	14,437,535.55

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	5,543,068.92
银行间市场交易费用	-
合计	5,543,068.92

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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	15,331.13
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	133,427.07

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	32,734,626.94	5,920,094.30
其中：支付销售机构的客户维护费	3,361,149.21	1,565,060.22

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分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	5,455,771.19	986,682.40

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。

6.4.10.2.3 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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实新能源新材料股票 A	嘉实新能源新材料股票 C	合计
嘉实基金管理有限公司	—	231,867.21	231,867.21
中国银行	—	91,402.51	91,402.51
嘉实财富	—	1,876.31	1,876.31
合计	—	325,146.03	325,146.03
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	嘉实新能源新材料股票 A	嘉实新能源新材料股票 C	合计
嘉实基金管理有限公司	—	175,347.64	175,347.64
中国银行	—	34,759.67	34,759.67
嘉实财富	—	—	—
合计	—	210,107.31	210,107.31

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，每日计提，逐日累计至每月月底，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 × 0.50% / 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

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
中国银行股份有限公司_活期	958,395,965.69	875,086.87	76,369,031.48	207,236.51

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
002230	科大讯飞	2019 年 7 月 17 日	2021 年 7 月 19 日	非公开发行锁定	27.10	65.92	73,801	2,000,007.10	4,864,961.92	-
002709	天赐材料	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 15 日	非公开发行锁定	68.00	94.91	735,294	49,999,992.00	69,786,753.54	-
300274	阳光电源	2021 年 06 月 24 日	2021 年 12 月 24 日	大宗交易受让减持锁定	97.38	101.04	500,000	48,690,000.00	50,520,000.00	-
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 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
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	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
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	-
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	2021	2021	新股	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

	通	年 5 月 12 日	年 11 月 22 日	锁定						
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 日	新股 锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
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	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
688067	爱威科技	2021年6月7日	2021年12月16日	新股锁定	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
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	-
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新发未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	新股锁定	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688499	利元亨	2021年6月	2021年7月	新发未上	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

		23 日	1 日	市						
688575	亚辉龙	2021 年 5 月 10 日	2021 年 11 月 17 日	新股锁定	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-
688609	九联科技	2021 年 3 月 15 日	2021 年 9 月 23 日	新股锁定	3.99	15.29	10,372	41,384.28	158,587.88	-
688613	奥精医疗	2021 年 5 月 13 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688630	芯碁微装	2021 年 3 月 25 日	2021 年 10 月 8 日	新股锁定	15.23	58.42	3,397	51,736.31	198,452.74	-
688655	迅捷兴	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁定	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-

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

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。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通过投资于新能源新材料行业中具有长期稳定成长性的上市公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。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	-	-
AAA 以下	64,522,696.78	-
未评级	-	-
合计	64,522,696.78	-

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 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	958,395,965.69	-	-	-	958,395,965.69
结算备付金	2,311,522.87	-	-	-	2,311,522.87

存出保证金	820,253.58	-	-	-	820,253.58
交易性金融资产	-	35,919,192.90	28,603,503.88	4,547,679,649.22	4,612,202,346.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	30,467,815.13	30,467,815.13
应收利息	-	-	-	221,875.08	221,875.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	81,360,585.38	81,360,585.38
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	961,527,742.14	35,919,192.90	28,603,503.88	4,659,729,924.81	5,685,780,363.73
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	-	-	-	125,570,650.41	125,570,650.41
应付管理人报酬	-	-	-	6,259,263.19	6,259,263.19
应付托管费	-	-	-	1,043,210.56	1,043,210.56
应付销售服务费	-	-	-	317,256.44	317,256.44
应付交易费用	-	-	-	1,640,648.60	1,640,648.60
应付税费	-	-	-	760.03	760.03
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	234,423.56	234,423.56
负债总计	-	-	-	135,066,212.79	135,066,212.79
利率敏感度缺口	961,527,742.14	35,919,192.90	28,603,503.88	4,524,663,712.02	5,550,714,150.94
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	637,000,713.86	-	-	-	637,000,713.86
结算备付金	2,925,986.93	-	-	-	2,925,986.93
存出保证金	201,895.99	-	-	-	201,895.99
交易性金融资产	-	-	-	3,125,803,947.80	3,125,803,947.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	33,870.54	33,870.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	36,539,498.22	36,539,498.22
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	640,128,596.78	-	-	-3,162,377,316.56	3,802,505,913.34
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	-	-	-	79,518,478.50	79,518,478.50
应付赎回款	-	-	-	63,237,283.60	63,237,283.60
应付管理人报酬	-	-	-	3,643,039.60	3,643,039.60
应付托管费	-	-	-	607,173.25	607,173.25
应付销售服务费	-	-	-	190,249.00	190,249.00
应付交易费用	-	-	-	1,176,915.48	1,176,915.48
应付税费	-	-	-	2.15	2.15
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	261,450.06	261,450.06
负债总计	-	-	-	148,634,591.64	148,634,591.64
利率敏感度缺口	640,128,596.78	-	-	-3,013,742,724.92	3,653,871,321.70

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	-714,752.76	-
	市场利率下降 25 个基点	725,368.85	-

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	4,547,679,649.22	81.93	3,125,803,947.80	85.55
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	4,547,679,649.22	81.93	3,125,803,947.80	85.55

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%	219,019,726.91	226,070,498.28
	业绩比较基准下降 5%	-219,019,726.91	-226,070,498.28

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 4,479,911,241.64 元，属于第二层次的余额为 132,291,104.36 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 3,036,186,531.95 元，第二层次 89,617,415.85 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	4,547,679,649.22	79.98
	其中:股票	4,547,679,649.22	79.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	64,522,696.78	1.13
	其中:债券	64,522,696.78	1.13
	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	960,707,488.56	16.90
8	其他各项资产	112,870,529.17	1.99
9	合计	5,685,780,363.73	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	11,290.28	0.00

B	采矿业	101,048,733.24	1.82
C	制造业	4,190,937,377.64	75.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,151,678.21	0.09
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	273,170.14	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	122,221,086.20	2.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	120,319,838.72	2.17
J	金融业	34,721.10	0.00
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	808,669.45	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	31,153.31	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,827,574.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,547,679,649.22	81.93

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	955,926	511,229,224.80	9.21
2	002709	天赐材料	3,246,436	337,424,267.90	6.08
3	601799	星宇股份	1,015,265	229,165,615.80	4.13
4	300037	新宙邦	2,124,358	212,648,235.80	3.83
5	688116	天奈科技	1,758,614	207,516,452.00	3.74
6	000049	德赛电池	4,251,463	195,142,151.70	3.52
7	600699	均胜电子	7,488,630	191,109,837.60	3.44
8	000301	东方盛虹	8,766,300	183,215,670.00	3.30
9	002475	立讯精密	3,751,700	172,578,200.00	3.11
10	600346	恒力石化	6,480,939	170,059,839.36	3.06
11	603659	璞泰来	1,208,435	165,072,221.00	2.97
12	600486	扬农化工	1,345,318	150,366,192.86	2.71
13	300618	寒锐钴业	1,857,097	146,413,527.48	2.64

14	688388	嘉元科技	1,413,564	128,577,781.44	2.32
15	300224	正海磁材	11,707,700	127,262,699.00	2.29
16	601021	春秋航空	2,147,998	122,221,086.20	2.20
17	000547	航天发展	6,122,700	115,535,349.00	2.08
18	603179	新泉股份	3,372,664	110,893,192.32	2.00
19	000975	银泰黄金	10,625,524	101,048,733.24	1.82
20	600110	诺德股份	7,627,800	92,906,604.00	1.67
21	002407	多氟多	2,258,332	80,261,119.28	1.45
22	300454	深信服	304,500	79,011,660.00	1.42
23	002850	科达利	869,500	75,994,300.00	1.37
24	600567	山鹰国际	19,152,900	66,077,505.00	1.19
25	600426	华鲁恒升	2,082,741	64,460,833.95	1.16
26	688390	固德威	180,210	60,190,140.00	1.08
27	300769	德方纳米	283,364	58,568,505.16	1.06
28	002025	航天电器	1,140,400	57,213,868.00	1.03
29	300274	阳光电源	500,000	50,520,000.00	0.91
30	300115	长盈精密	1,985,066	40,892,359.60	0.74
31	601138	工业富联	3,199,806	39,709,592.46	0.72
32	002125	湘潭电化	4,461,616	35,559,079.52	0.64
33	002831	裕同科技	1,153,373	34,243,644.37	0.62
34	600990	四创电子	581,224	23,115,278.48	0.42
35	002544	杰赛科技	1,623,100	21,652,154.00	0.39
36	002935	天奥电子	879,600	18,867,420.00	0.34
37	688318	财富趋势	78,885	14,751,495.00	0.27
38	603730	岱美股份	795,575	14,495,376.50	0.26
39	603085	天成自控	1,778,352	12,448,464.00	0.22
40	300192	科德教育	691,050	6,827,574.00	0.12
41	002389	航天彩虹	252,000	5,501,160.00	0.10
42	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.09
43	002230	科大讯飞	73,801	4,864,961.92	0.09
44	300979	华利集团	9,246	1,028,699.40	0.02
45	688425	铁建重工	135,282	827,925.84	0.01
46	688131	皓元医药	1,955	676,801.45	0.01
47	688276	百克生物	3,486	364,565.88	0.01
48	688161	威高骨科	3,069	325,467.45	0.01
49	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.00
50	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.00
51	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
52	688630	芯碁微装	3,397	198,452.74	0.00
53	301013	利和兴	4,704	168,966.51	0.00
54	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.00
55	688700	东威科技	3,049	162,755.62	0.00

56	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.00
57	688621	阳光诺和	1,485	131,868.00	0.00
58	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.00
59	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.00
60	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.00
61	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
62	688698	伟创电气	4,751	94,972.49	0.00
63	688633	星球石墨	1,558	87,045.46	0.00
64	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
65	301011	华立科技	1,750	79,474.50	0.00
66	688571	杭华股份	8,200	73,882.00	0.00
67	688355	明志科技	2,710	72,384.10	0.00
68	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
69	301007	德迈仕	3,022	60,305.15	0.00
70	301012	扬电科技	1,691	56,994.16	0.00
71	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
72	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
73	688597	煜邦电力	3,907	49,306.34	0.00
74	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
75	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
76	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
77	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
78	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
79	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
80	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
81	300884	狄耐克	748	20,106.24	0.00
82	300891	惠云钛业	1,143	19,876.77	0.00
83	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
84	300991	创益通	535	16,894.50	0.00
85	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
86	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.00
87	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
88	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
89	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
90	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
91	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
92	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
93	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
94	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
95	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
96	300895	铜牛信息	340	11,563.40	0.00
97	300908	仲景食品	185	11,024.15	0.00

98	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
99	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
100	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
101	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
102	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
103	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
104	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
105	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
106	688359	三孚新科	232	8,236.00	0.00
107	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
108	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
109	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
110	300909	汇创达	186	8,016.60	0.00
111	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
112	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
113	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
114	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
115	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
116	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
117	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
118	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
119	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
120	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
121	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
122	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
123	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
124	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
125	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
126	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
127	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
128	688314	康拓医疗	28	2,957.92	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	600426	华鲁恒升	212,027,418.23	5.80
2	600346	恒力石化	209,153,195.16	5.72
3	601799	星宇股份	201,450,819.85	5.51
4	000301	东方盛虹	181,332,649.34	4.96
5	600486	扬农化工	148,741,637.51	4.07
6	002475	立讯精密	145,701,757.42	3.99

7	601021	春秋航空	126,086,285.34	3.45
8	601138	工业富联	108,560,829.87	2.97
9	000975	银泰黄金	95,597,412.05	2.62
10	300750	宁德时代	86,141,675.96	2.36
11	603260	合盛硅业	86,099,486.85	2.36
12	688099	晶晨股份	83,110,220.81	2.27
13	600110	诺德股份	78,678,875.23	2.15
14	601233	桐昆股份	72,181,537.20	1.98
15	600567	山鹰国际	71,029,357.92	1.94
16	002025	航天电器	59,625,995.77	1.63
17	603085	天成自控	55,915,591.90	1.53
18	000049	德赛电池	54,328,204.57	1.49
19	603179	新泉股份	51,876,956.74	1.42
20	300115	长盈精密	50,458,168.71	1.38

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	600426	华鲁恒升	147,603,248.35	4.04
2	002466	天齐锂业	144,561,620.65	3.96
3	601233	桐昆股份	141,200,746.13	3.86
4	000301	东方盛虹	125,889,600.41	3.45
5	603260	合盛硅业	119,417,714.72	3.27
6	002179	中航光电	119,056,128.13	3.26
7	600760	中航沈飞	111,019,505.71	3.04
8	688099	晶晨股份	99,704,681.63	2.73
9	002407	多氟多	75,100,678.18	2.06
10	002812	恩捷股份	68,959,438.52	1.89
11	600741	华域汽车	65,773,202.44	1.80
12	601225	陕西煤业	65,702,709.33	1.80
13	300769	德方纳米	64,171,338.36	1.76
14	000002	万科 A	53,560,201.21	1.47
15	000651	格力电器	50,789,659.60	1.39
16	603098	森特股份	50,347,356.95	1.38
17	601138	工业富联	44,705,684.74	1.22
18	603085	天成自控	44,595,029.26	1.22
19	002389	航天彩虹	40,777,827.00	1.12
20	300450	先导智能	40,185,248.09	1.10

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	2,667,692,066.05
卖出股票收入（成交）总额	1,956,150,967.44

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	64,522,696.78	1.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	64,522,696.78	1.16

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	110047	山鹰转债	307,870	35,919,192.90	0.65
2	127030	盛虹转债	160,376	24,406,019.68	0.44
3	123096	思创转债	22,758	2,437,381.80	0.04
4	118000	嘉元转债	13,440	1,760,102.40	0.03

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 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

无。

7.10.2 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 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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、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	820,253.58
2	应收证券清算款	30,467,815.13
3	应收股利	—
4	应收利息	221,875.08
5	应收申购款	81,360,585.38
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	112,870,529.17

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110047	山鹰转债	35,919,192.90	0.65

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
----	------	------	-------------	---------------	----------

1	002709	天赐材料	69,786,753.54	1.26	非公开发行锁定
---	--------	------	---------------	------	---------

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)	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(%)
嘉实新能源新材料股票 A	620,421	2,311.25	344,698,963.15	24.04	1,089,249,681.66	75.96
嘉实新能源新材料股票 C	134,249	2,019.67	14,900,831.69	5.50	256,238,013.23	94.50
合计	738,272	2,309.57	359,599,794.84	21.09	1,345,487,694.89	78.91

注：(1) 嘉实新能源新材料股票 A：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实新能源新材料股票 A 份额占嘉实新能源新材料股票 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实新能源新材料股票 A 份额占嘉实新能源新材料股票 A 总份额比例；

(2) 嘉实新能源新材料股票 C：机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总

份额比例，分别为机构投资者持有嘉实新能源新材料股票 C 份额占嘉实新能源新材料股票 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实新能源新材料股票 C 份额占嘉实新能源新材料股票 C 总份额比例。

8.2 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	嘉实新能源新材料股票 A	983,250.27	0.07
	嘉实新能源新材料股票 C	272,911.36	0.10
	合计	1,256,161.63	0.07

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	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负责人持有本开放式基金	嘉实新能源新材料股票 A	0
	嘉实新能源新材料股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实新能源新材料股票 A	0
	嘉实新能源新材料股票 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实新能源新材料股票 A	嘉实新能源新材料股票 C
基金合同生效日 (2017 年 3 月 16 日) 基金份额总额	1,293,898,388.44	20,105,178.69
本报告期期初基金份额总额	1,099,266,320.51	198,918,840.03
本报告期基金总申购份额	1,442,035,501.04	354,374,847.39
减：本报告期基金总赎回份额	1,107,353,176.74	282,154,842.50
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	1,433,948,644.81	271,138,844.92

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 1 月 26 日本基金管理人发布《关于新增嘉实新能源新材料股票基金经理的公告》，聘请熊昱洲先生担任本基金基金经理，与姚志鹏先生共同管理本基金。

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

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

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	

光大证券 股份有限 公司	2	1,164,073,638.15	25.53%	814,851.53	25.87%	—
中信建投 证券股份 有限公司	4	653,166,438.73	14.32%	457,216.54	14.51%	—
国泰君安 证券股份 有限公司	3	627,952,639.40	13.77%	439,572.06	13.95%	—
中泰证券 股份有限 公司	5	466,430,067.43	10.23%	304,308.97	9.66%	—
中国银河 证券股份 有限公司	2	387,045,984.55	8.49%	270,933.57	8.60%	—
兴业证券 股份有限 公司	3	355,885,515.45	7.80%	249,119.87	7.91%	—
中国国际 金融股份 有限公司	5	165,193,209.71	3.62%	104,281.44	3.31%	—
申万宏源 证券有限 公司	3	154,811,621.49	3.39%	108,369.22	3.44%	—
长江证券 股份有限 公司	2	145,980,283.32	3.20%	102,187.83	3.24%	—
华泰证券 股份有限 公司	5	138,544,939.86	3.04%	96,983.07	3.08%	—

中信证券 股份有限 公司	7	120,878,961.52	2.65%	76,310.51	2.42%	-
广发证券 股份有限 公司	4	106,586,826.27	2.34%	74,611.33	2.37%	-
海通证券 股份有限 公司	3	73,592,156.77	1.61%	51,515.04	1.64%	-
安信证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
东吴证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-

东兴证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-

民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	2	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券华南股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	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) 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. 华宝证券有限责任公司更名为华宝证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国元证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：信达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
光大证券股份有限公司	43,187,792.40	99.95%	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	21,690.85	0.05%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东北证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 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	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国海证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任	-	-	-	-	-	-

公司						
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华西证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 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	-	-	-	-	-	-
新时代证 券股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券 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						
中信证券 华南股份 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	上海证券报、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	关于新增嘉实新能源新材料股票基金经理的公告	上海证券报、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 26 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旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、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 07 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、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
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资天赐材料非公开发行股票的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 06 月 12 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新能源新材料股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实新能源新材料股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新能源新材料股票型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实新能源新材料股票型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实新能源新材料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