

嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	嘉实新财富混合
基金主代码	002211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 14 日
报告期末基金份额总额	1,819,427.33 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析,在控制风险的前提下,合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例,并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 具体包括: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、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300*50%+中债总指数*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,风险与收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金,属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	2,011,972.86
2. 本期利润	995,387.95
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0375
4. 期末基金资产净值	2,529,017.77
5. 期末基金份额净值	1.390

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。

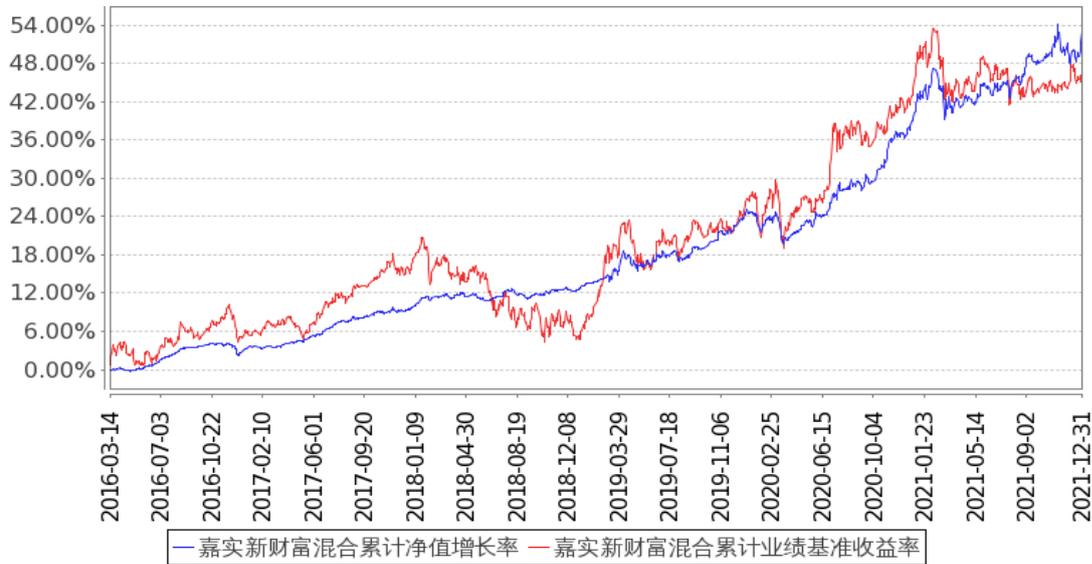
3.2 基金净值表现

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	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.19%	0.51%	1.55%	0.39%	1.64%	0.12%
过去六个月	5.86%	0.43%	-0.89%	0.51%	6.75%	-0.08%
过去一年	9.02%	0.44%	0.52%	0.59%	8.50%	-0.15%
过去三年	35.78%	0.35%	38.79%	0.63%	-3.01%	-0.28%
过去五年	48.41%	0.28%	38.75%	0.59%	9.66%	-0.31%
自基金合同 生效起至今	52.86%	0.26%	46.10%	0.57%	6.76%	-0.31%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

嘉实新财富混合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
(2016年03月14日至2021年12月31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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
颜伟鹏	本基金、嘉实产业领先混合基金经理	2021 年 10 月 22 日	-	10 年	曾任上海申银万国证券研究所、交银施罗德基金、农银汇理基金管理有限公司投研部分分析师。2021 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任职于股票投研部。硕士研究生，具有基金从业资格，中国国籍。
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实新起点混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路	2020 年 11 月 17 日	-	17 年	2004 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理，现任债券基金经理。经济学硕士，具有基金从业资格。中国国籍。

混合、嘉实新添华定期混合、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、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券基金经理				
--	--	--	--	--

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、《嘉实新财富灵活配置混合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 公平交易专项说明

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，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内，疫情仍然反复、“双控政策”、地产调控政策效应继续显现，这三个因素成为影响经济的关键，总量经济走弱。

地产方面，地产在政策持续打压下，全面降温，销售、投资持续走弱，恒大事件对地产行业雪上加霜。消费方面，促进消费政策得到较好落实，但效果并不理想，居民消费受杠杆率高、就业预期差、人口老龄化等因素的影响，消费意愿仍然偏弱；服务性消费受疫情影响，恢复滞后，消费升级步伐放缓；社会消费品零售总额增速明显回落。

通胀方面，CPI 未来温和上涨，但电价提升，服务品价格未来或上涨，未来 CPI 或逐步走高。11 月以来大宗商品价格明显下行，PPI 目前高点已现，未来逐步下行，预计 12 月 PPI 或在 11%-12%，目前货币政策主要关注经济结构，整体政策“易松难紧”，经济下行，短期宽信用效果有限，仍利好利率，但如果 PPI 向 CPI 传导，政策或两难。

权益市场方面，四季度传媒军工汽车等相关个股涨幅领先。传媒受元宇宙相关产业变化刺激，军工行业胜在需求景气稳定度高，汽车相关标的主要受益于汽车智能化电动化升级趋势，估值快速提升。食品等涨幅居中，在受行业提价潮影响，涨幅较大；但随后受终端需求较弱影响，有一定程度回落。而对宏观经济的悲观预期，使金融相关权重标的，表现落后。表现最差的是采掘钢铁等行业，主要受 PPI 见顶回落影响。

报告期内本基金规模缩减明显，主要系绝对收益资金赎回影响。基金操作上以相对收益为目标开展投资，中等股票仓位，行业配置中以产业掌控力较强的优质企业为核心持仓，积极挖掘未来成长空间较大的，估值相对低估的标的。在资产类别上，减少了债券持仓，增配了权益，并取得了市场中位数的收益水平。

4.5 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 1.390 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.19%，业绩比较基准收益率为 1.55%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2021-11-18 至 2021-12-31；未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	613,185.02	22.43
	其中：股票	613,185.02	22.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,971,821.88	72.13
8	其他资产	148,590.73	5.44
9	合计	2,733,597.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	551,543.18	21.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,911.04	1.58
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	21,730.80	0.86
S	综合	-	-
	合计	613,185.02	24.25

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	688303	大全能源	4,914	297,346.14	11.76
2	688768	容知日新	907	98,445.78	3.89
3	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	3.45
4	688071	华依科技	1,101	68,603.31	2.71
5	688038	中科通达	2,132	39,911.04	1.58
6	603230	内蒙新华	840	21,730.80	0.86

注：1. 报告期末，本基金仅持有上述 6 支股票。

2. 报告期末，本基金持有的“大全能源”为科创板网下申购锁定的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

5.5 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债券投资明细

无。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

无。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

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

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	63,545.60
2	应收证券清算款	74,396.49
3	应收股利	-
4	应收利息	553.71
5	应收申购款	10,094.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,590.73

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	688303	大全能源	297,346.14	11.76	新股锁定
2	688768	容知日新	98,445.78	3.89	新股锁定
3	688718	唯赛勃	87,147.95	3.45	新股锁定
4	688071	华依科技	68,603.31	2.71	新股锁定
5	688038	中科通达	39,911.04	1.58	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	54,670,358.28
报告期期间基金总申购份额	896,563.00
减：报告期期间基金总赎回份额	53,747,493.95
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,819,427.33

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。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机	1	2021/11/18	5,851,706.90	-	4,800,000.00	1,051,706.90	57.80

构		至 2021/12/31				
	2	2021/10/01 至 2021/11/17	44,035,779.81		-44,035,779.81	-
产品特有风险						
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20% 的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>						

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实新财富灵活配置混合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) 报告期内嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 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

9.3 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

2022 年 1 月 21 日