

# 嘉实事件驱动股票型证券投资基金 2021 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经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 2022 年 03 月 24 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。

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

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 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	65
8.7 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	65
8.8 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	65
8.9 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	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例	66
8.13 投资组合报告附注	66
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>67</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
9.3 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	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	68
11.2 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	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11.8 其他重大事件	75
<b>§ 12 备查文件目录</b>	<b>76</b>
12.1 备查文件目录	76
12.2 存放地点	76
12.3 查阅方式	76

## § 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	1,149,490,312.60 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	593,826,479.56	2,065,939,082.41	117,287,308.01
本期利润	58,710,587.00	1,813,842,427.26	1,650,212,310.10
加权平均基金份额本期利润	0.0429	0.4891	0.2693
本期加权平均净值利润率	3.22%	50.35%	37.24%
本期基金份额净值增长率	1.30%	61.01%	47.28%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末

指标			
期末可供分配利润	375,041,551.04	523,408,249.69	-1,886,191,190.58
期末可供分配基金份额利润	0.3263	0.2766	-0.3420
期末基金资产净值	1,524,531,863.64	2,476,159,160.52	4,484,091,113.02
期末基金份额净值	1.326	1.309	0.813
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	32.60%	30.90%	-18.70%

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
过去三个月	-1.04%	1.07%	1.50%	0.63%	-2.54%	0.44%
过去六个月	-3.56%	1.32%	-3.70%	0.82%	0.14%	0.50%
过去一年	1.30%	1.48%	-2.94%	0.94%	4.24%	0.54%
过去三年	140.22%	1.50%	53.94%	1.03%	86.28%	0.47%
过去五年	59.95%	1.37%	45.67%	0.96%	14.28%	0.41%

自基金合同生效起至今	32.60%	1.47%	1.86%	1.15%	30.74%	0.32%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

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：

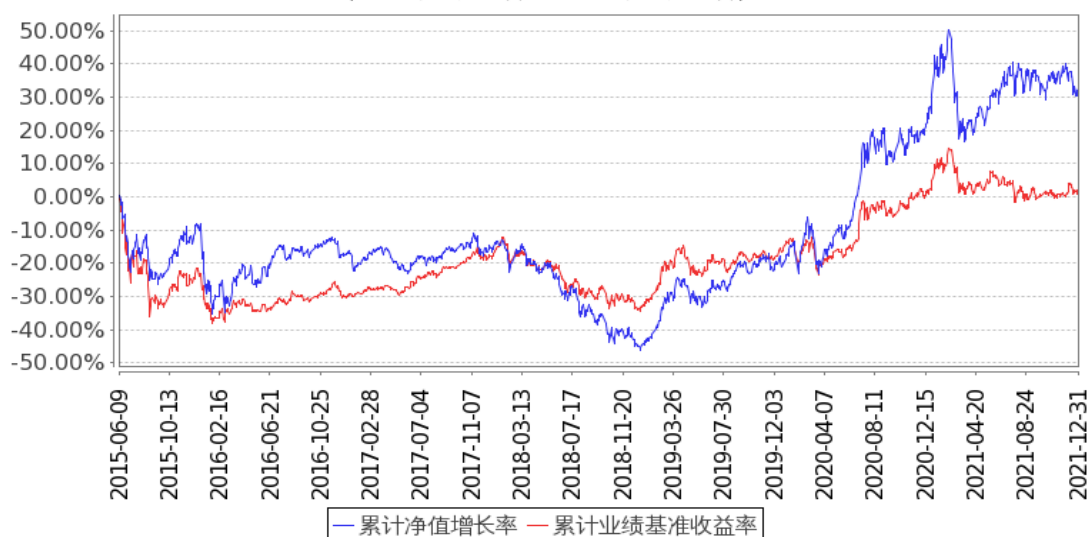
$$\text{Return}(t) = 80\% \times (\text{沪深 300 指数}(t) / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1) + 20\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

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

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)

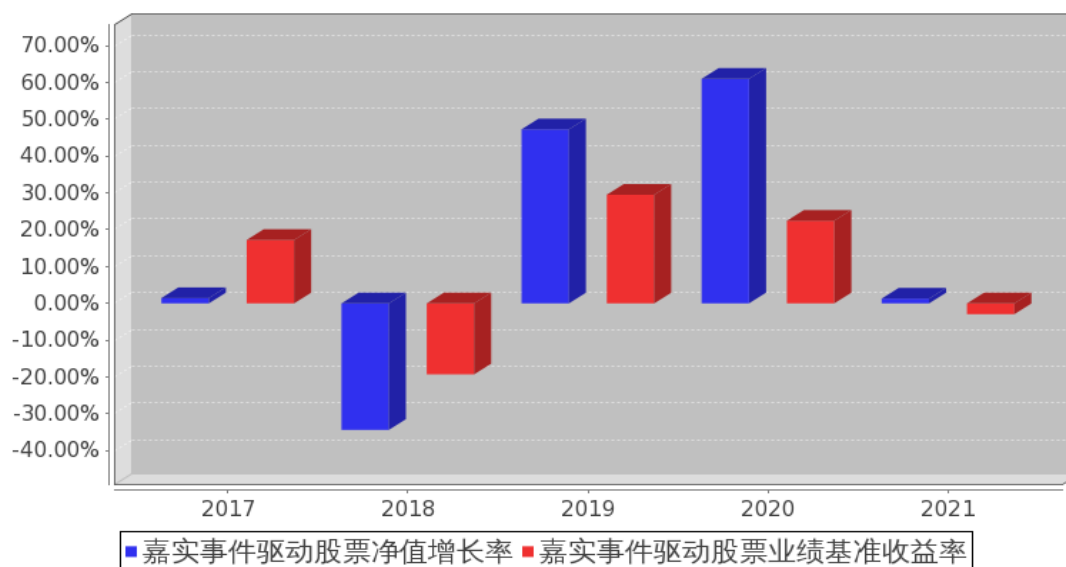


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实事件驱动股票基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国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，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止2021年12月31日，基金管理人共管理258只开放式证券投资基金，覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、资产配置、海外投资、FOF等不同类别。同时，还管理多个全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和单一/集合资产管理计划。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

张自力	本基金、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实全球价值机会股票（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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，

交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《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；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

### 4.3.3 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 2 次，其中 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，另 1 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期 2021 全年度内，A 股市场整体经历了超过前两年的波动，市场内部结构变化增强，部分市场核心指数全年度收益率为负。

2021 年初，A 股以延续近两年的整体向上趋势启动，积极上行，至春节前市场指数点位与各类投资工具净值持续上扬，市场风险偏好乐观向上，且风格上延续了前期的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。春节后首个交易日开始，市场风格骤变，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。进入三季度，市场整体呈现窄幅波动，行业间出现较显著的分化，大盘股权重行业银行延续二季度下行趋势，一定程度拖累市场指数，直至 8 月中旬有所企稳；化工等制造业、煤炭钢铁等顺周期行业，在业绩驱动下表现较好；产业链分布广泛的新能源主题，以及涉及碳中和相关宏观主题的领域，在国家政策类事件的驱动下，表现较好。四季度，市场整体呈现正回报，市值风格及行业间再现较显著的分化，小盘风格的各个宽基指数较大幅度的领先大盘指数，如单四季度中证 1000 领先中证 100 达到约 680bps。

本年度内，全球经历了早前疫情爆发初期对产业链冲击强烈的阶段，各经济体在政府的经济

提振措施下逐步步入经济复苏进程，美联储于年内启动了退出货币宽松的进程。疫情、货币及国际贸易摩擦等多种因素驱动上游资源等逐步走强，带来资本市场内上游产业包括周期与价值板块的盈利大增，美国企业在今年多次季报都盈利大幅超预期，以资源行业领头、价值风格走强，高科技也同样享受到货币环境的优势。A 股也经历了部分相同的运行逻辑，包括资源价格对周期股的利润贡献等，在此背景下，A 股内沉寂较久的周期板块和价值风格，以及小市值风格，比前两年有更好的表现。与前两年的高质量高成长大盘风格不同，本年内，双碳主题及新能源产业链，货币宽松和通胀环境下的大宗商品以及上游产业链，下半年高景气度的军工等多个区域，都有较好的投资机会。实际上，受高景气度行业和热点主题的快速拉动，以及在热点区域间切换过程中，A 股风格因子有更大的波动性，在剔除单一主题或行业的短期冲击后的因子更能反映宏观基础变量包括利率中枢、流动性等的影响。

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 1.326 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.30%，业绩比较基准收益率为-2.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，在实体经济层面，我国经济依然面临压力。相对于美国的高通胀而言，我国 CPI 等指标运行在合理区间，有较好的宽松货币政策投放空间以提振经济，预计将通过降准降息等较强方法直接进行刺激，在 2022 年初已经进行了首次操作。经济结构上，国内将继续以科技产业攻坚、向自主可控和核心层面进一步发展，进行结构上的进一步优化，但对于 A 股而言，高成长股票的过高的估值，在美元加息周期下会在盈利扩张放缓时成为风险。我们对未来的各类资产回报率保持谨慎的态度，需要随时跟踪核心指标的变化，总体上，在 2022 年度，需要更加强调股

票的估值水平，价值风格本身将有较好的表现，成长股则需要有足够的估值边界。

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。

结合未来年市场面临的外部环境和内部运行情况，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，利用量化框架的优势，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

（1）继续内控前置。在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。全力支持创新业务，新产品新业务从战略规划到具体产品方案、业务模式，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

（2）全流程开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

（3）按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

（4）基金法务工作。包括合同、协议审查，主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，重点防控新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

（5）加强差错管理。继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所

有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管，按时完成合规报告和各项统计报表及调查、专题报告。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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“7.4.11 利润分配情况”。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

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

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在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，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金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 托管人对本年度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本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 23900 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实事件驱动股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实事件驱动股票型证券投资基金(以下简称“嘉实事件驱动股票基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了嘉实事件驱动股票基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实事件驱动股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实事件驱动股票基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实事件驱动股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实事件驱动股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实事件驱动股票基金的财务报告过程。</p>	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对嘉实事件驱动股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实事件驱动股票基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周玮
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	



## § 7 年度财务报表

## 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	35,067,111.68	20,114,379.55
结算备付金		68,379,647.09	71,619,156.64
存出保证金		4,130,494.06	9,647,571.21
交易性金融资产	7.4.7.2	1,416,591,396.15	2,397,528,759.46
其中：股票投资		1,326,564,396.15	2,267,636,821.36
基金投资		-	-
债券投资		90,027,000.00	129,891,938.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		8,716,991.93	5,628,698.11
应收利息	7.4.7.5	1,626,315.47	3,809,593.75
应收股利		-	-
应收申购款		47,731.69	395,695.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,534,559,688.07	2,508,743,854.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,687,902.74	-
应付赎回款		1,015,056.14	26,430,332.39
应付管理人报酬		1,995,259.55	3,123,961.40
应付托管费		332,543.25	520,660.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	785,035.28	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	7.4.7.8	212,027.47	231,306.29
负债合计		10,027,824.43	32,584,693.67
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,149,490,312.60	1,892,235,926.21
未分配利润	7.4.7.10	375,041,551.04	583,923,234.31
所有者权益合计		1,524,531,863.64	2,476,159,160.52
负债和所有者权益总计		1,534,559,688.07	2,508,743,854.19

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.326 元，基金份额总额 1,149,490,312.60 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		98,813,328.79	1,899,493,322.05
1. 利息收入		3,038,197.43	6,996,008.69
其中：存款利息收入	7.4.7.11	423,470.76	905,789.15
债券利息收入		2,614,726.67	6,090,219.54
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）		630,692,174.72	2,144,169,081.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	608,441,956.81	2,107,018,974.54
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,222,514.29	-36,829.50
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	6,515,623.14	14,516,403.43
股利收益	7.4.7.16	13,512,080.48	22,670,532.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-535,115,892.56	-252,096,655.15
4. 汇兑收益（损失以“-”		-	-

号填列)			
5. 其他收入 (损失以 “-” 号填列)	7. 4. 7. 18	198, 849. 20	424, 887. 16
减: 二、费用		40, 102, 741. 79	85, 650, 894. 79
1. 管理人报酬	-	27, 463, 286. 53	54, 297, 019. 08
2. 托管费	-	4, 577, 214. 46	9, 049, 503. 13
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 19	7, 764, 772. 17	21, 945, 597. 93
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	52, 286. 78
7. 其他费用	7. 4. 7. 20	269, 619. 17	306, 487. 87
三、利润总额 (亏损总额以 “-” 号填列)		58, 710, 587. 00	1, 813, 842, 427. 26
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以 “-” 号填列)		58, 710, 587. 00	1, 813, 842, 427. 26

### 7.3 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 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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)	-	58, 710, 587. 00	58, 710, 587. 00
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)	-742, 745, 613. 61	-267, 592, 270. 27	-1, 010, 337, 883. 88
其中: 1. 基金申购款	53, 080, 697. 19	18, 144, 536. 00	71, 225, 233. 19
2. 基金赎回款	-795, 826, 310. 80	-285, 736, 806. 27	-1, 081, 563, 117. 07
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）	1,149,490,312.60	375,041,551.04	1,524,531,863.64
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	-	1,813,842,427.26	1,813,842,427.26
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）	-3,622,977,696.11	-198,796,683.65	-3,821,774,379.76
其中：1. 基金申购款	124,305,843.71	3,671,998.68	127,977,842.39
2. 基金赎回款	-3,747,283,539.82	-202,468,682.33	-3,949,752,222.15
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）	1,892,235,926.21	583,923,234.31	2,476,159,160.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

#### 7.4.2 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》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的

公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到

的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 20%。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础



确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	35,067,111.68	20,114,379.55
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	35,067,111.68	20,114,379.55

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,057,929,312.06	1,326,564,396.15	268,635,084.09
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	89,978,210.00	90,027,000.00
	合计	89,978,210.00	90,027,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,147,907,522.06	1,416,591,396.15	268,683,874.09
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,467,678,719.28	2,267,636,821.36	799,958,102.08

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	5,969,500.00	9,592,938.10	3,623,438.10
	银行间市场	122,277,190.00	120,299,000.00	-1,978,190.00
	合计	128,246,690.00	129,891,938.10	1,645,248.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,595,925,409.28	2,397,528,759.46	801,603,350.18

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	28,437,800.00	-	-	
其中：股指期货投资	28,437,800.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	28,437,800.00	-	-	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 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	70,203,323.53	-	-	
其中：股指期货投资	70,203,323.53	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	70,203,323.53	-	-	

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 12 月 31 日，本基金买入 IC2206 持仓量为 20 手，对应合约市值 28,591,200.00

元，公允价值变动 153,400.00 元，公允价值变动总额合计 153,400.00 元，可抵消期货暂收款 153,400.00 元，股指期货投资净额为零(于 2020 年 12 月 31 日：买入 IC2101 持仓量为 11 手，对应合约市值 13,956,360.00 元，公允价值变动 277,400.00 元；买入 IF2101 持仓量为 13 手，对应合约市值 20,343,180.00 元，公允价值变动 924,116.47 元；本基金买入 IH2101 持仓量为 35 手，对应合约市值 38,253,600.00 元，公允价值变动 1,148,300.00 元；公允价值变动总额合计 2,349,816.47 元，可抵消期货暂收款 2,349,816.47 元，股指期货投资净额为零)。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,448.88	2,089.60
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	7,973.48	9,521.08
应收债券利息	1,613,835.61	3,797,685.17
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	57.50	297.90
合计	1,626,315.47	3,809,593.75

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	785,035.28	2,212,163.09
银行间市场应付交易费用	-	175.00
合计	785,035.28	2,212,338.09

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	27.47	1,306.29
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	212,000.00	230,000.00
合计	212,027.47	231,306.29

## 7.4.7.9 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 12 月 31 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	53,080,697.19	53,080,697.19
本期赎回（以“-”号填列）	-795,826,310.80	-795,826,310.80
- 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	1,149,490,312.60	1,149,490,312.60

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 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	593,826,479.56	-535,115,892.56	58,710,587.00
本期基金份额交易产生的变动数	-335,622,118.67	68,029,848.40	-267,592,270.27
其中：基金申购款	24,649,741.05	-6,505,205.05	18,144,536.00
基金赎回款	-360,271,859.72	74,535,053.45	-285,736,806.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	781,612,610.58	-406,571,059.54	375,041,551.04

## 7.4.7.11 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	113,355.08	236,514.74

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	304,910.91	659,728.73
其他	5,204.77	9,545.68
合计	423,470.76	905,789.15

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	608,441,956.81	2,107,018,974.54
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	608,441,956.81	2,107,018,974.54

##### 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	3,351,363,736.72	9,658,106,096.34
减：卖出股票成本总额	2,742,921,779.91	7,551,087,121.80
买卖股票差价收入	608,441,956.81	2,107,018,974.54

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
债券投资收益——买卖	2,222,514.29	-36,829.50

债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入		
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2,222,514.29	-36,829.50

#### 7.4.7.13.2 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	186,237,251.52	417,415,778.64
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	178,315,490.00	406,634,221.07
减：应收利息总额	5,699,247.23	10,818,387.07
买卖债券差价收入	2,222,514.29	-36,829.50

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。



## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 7.4.7.15.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 收益金额 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	6,515,623.14	14,516,403.43

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	13,512,080.48	22,670,532.88
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	13,512,080.48	22,670,532.88

## 7.4.7.17 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-532,919,476.09	-253,840,271.62
股票投资	-531,323,017.99	-255,136,178.79
债券投资	-1,596,458.10	1,295,907.17
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
贵金属投资	—	—
其他	—	—
2. 衍生工具	-2,196,416.47	1,743,616.47
权证投资	—	—
期货投资	-2,196,416.47	1,743,616.47
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	-535,115,892.56	-252,096,655.15

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	172,459.02	370,850.88
基金转出费收入	26,390.18	54,036.28
合计	198,849.20	424,887.16

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	7,763,972.17	21,943,872.93
银行间市场交易费用	800.00	1,725.00
合计	7,764,772.17	21,945,597.93

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	92,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	20,419.17	39,287.87
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	269,619.17	306,487.87

## 7.4.7.21 分部报告

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

无。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

## 7.4.9 关联方关系

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”）	基金托管人

银行”)	
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,463,286.53	54,297,019.08
其中：支付销售机构的客户维护费	9,819,062.18	19,399,185.59

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 1.50%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×1.50%/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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,577,214.46	9,049,503.13

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

##### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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	35,067,111.68	113,355.08	20,114,379.55	236,514.74

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期(2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日)，本基金未实施利润分配。

## 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新发未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
002371	北方华创	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 5 日	非公开发行锁定	304.00	320.77	11,118	3,379,872.00	3,566,320.86	-
300774	倍杰特	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 19 日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021 年 7 月	2022 年 1 月	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

		14 日	24 日							
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信	2021	2022	新股锁	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-

	工业	年 8 月 25 日	年 3 月 1 日	定						
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁 定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁 定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁 定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股锁 定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股锁 定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁 定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁 定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 29 日	新股锁 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股锁 定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股锁 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股锁 定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301087	可孚医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股锁 定	93.09	75.34	665	61,904.85	50,101.10	-

301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟	2021	2022	新股锁	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-



	股份	年 11 月 19 日	年 5 月 26 日	定						
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新发未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	新股锁定	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股锁定	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021 年 12 月	2022 年 6 月	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-

		月 2 日	9 日							
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	新股锁定	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
688105	诺唯赞	2021 年 11 月 5 日	2022 年 5 月 16 日	新股锁定	55.00	93.29	6,180	339,900.00	576,532.20	-
688167	炬光科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股锁定	78.69	176.67	2,014	158,481.66	355,813.38	-
688227	品高股份	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新股锁定	37.09	30.76	4,164	154,442.76	128,084.64	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新发未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688766	普冉股份	2021 年 8 月 12 日	2022 年 2 月 23 日	新股锁定	148.90	342.73	704	104,825.60	241,281.92	-
688798	艾为电子	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁定	76.58	210.33	3,592	275,075.36	755,505.36	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 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 12 月 31 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。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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 7.4.12 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	35,067,111.68	-	-	-	35,067,111.68
结算备付金	68,379,647.09	-	-	-	68,379,647.09
存出保证金	127,726.06	-	-	4,002,768.00	4,130,494.06
交易性金融资产	90,027,000.00	-	-	1,326,564,396.15	1,416,591,396.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	8,716,991.93	8,716,991.93
应收利息	-	-	-	1,626,315.47	1,626,315.47
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	47,731.69	47,731.69
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	193,601,484.83	-	-	1,340,958,203.24	1,534,559,688.07
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	-	-	-	5,687,902.74	5,687,902.74
应付赎回款	-	-	-	1,015,056.14	1,015,056.14
应付管理人报酬	-	-	-	1,995,259.55	1,995,259.55
应付托管费	-	-	-	332,543.25	332,543.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	785,035.28	785,035.28
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	212,027.47	212,027.47
负债总计	-	-	-	10,027,824.43	10,027,824.43
利率敏感度缺口	193,601,484.83	-	-	1,330,930,378.81	1,524,531,863.64
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。

#### 7.4.13.4.1.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-58,298.74	-177,953.13

	市场利率下降 25 个基点	58,406.26	180,475.71
--	---------------	-----------	------------

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 7.4.13.4.2.2 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 12 月 31 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%	-	-

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	1,326,564,396.15	87.01	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	1,326,564,396.15	87.01	2,267,636,821.36	91.58

#### 7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	99,322,961.57	161,013,983.58
	业绩比较基准下降 5%	-99,322,961.57	-161,013,983.58

#### 7.4.14 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 1,319,489,421.36 元，属于第二层次的余额为 97,101,974.79 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	1,326,564,396.15	86.45
	其中：股票	1,326,564,396.15	86.45
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	90,027,000.00	5.87
	其中：债券	90,027,000.00	5.87
	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	103,446,758.77	6.74
8	其他各项资产	14,521,533.15	0.95
9	合计	1,534,559,688.07	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	17,259,558.50	1.13
B	采矿业	34,045,791.81	2.23
C	制造业	1,027,274,383.96	67.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	65,787,861.00	4.32
E	建筑业	554,302.83	0.04
F	批发和零售业	3,375,544.20	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	8,892,552.60	0.58
H	住宿和餐饮业	1,340,688.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,386,436.50	4.03
J	金融业	56,050,514.77	3.68
K	房地产业	3,796,527.00	0.25
L	租赁和商务服务业	2,848,242.00	0.19
M	科学研究和技术服务业	21,793,695.65	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	16,788,019.04	1.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,763,073.70	0.12
R	文化、体育和娱乐业	3,607,204.59	0.24
S	综合	-	-
	合计	1,326,564,396.15	87.01

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 8.3 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	78,600	46,216,800.00	3.03
2	300059	东方财富	754,791	28,010,294.01	1.84
3	600036	招商银行	513,316	25,003,622.36	1.64
4	300327	中颖电子	345,345	23,448,925.50	1.54
5	300450	先导智能	284,882	21,186,674.34	1.39
6	000733	振华科技	168,800	20,978,464.00	1.38
7	600563	法拉电子	87,400	20,311,760.00	1.33
8	002049	紫光国微	81,819	18,409,275.00	1.21
9	601012	隆基股份	212,538	18,320,775.60	1.20
10	002179	中航光电	181,813	18,283,115.28	1.20
11	300363	博腾股份	196,300	17,559,035.00	1.15
12	002138	顺络电子	434,492	16,588,904.56	1.09
13	300496	中科创达	113,880	15,763,269.60	1.03
14	002821	凯莱英	36,200	15,747,000.00	1.03
15	300124	汇川技术	216,850	14,875,910.00	0.98
16	002371	北方华创	42,877	14,587,329.04	0.96
17	603456	九洲药业	254,600	14,323,796.00	0.94
18	600519	贵州茅台	6,907	14,159,350.00	0.93
19	600900	长江电力	618,800	14,046,760.00	0.92
20	600885	宏发股份	185,400	13,838,256.00	0.91
21	603501	韦尔股份	43,594	13,547,707.38	0.89
22	002460	赣锋锂业	94,301	13,470,897.85	0.88
23	600809	山西汾酒	42,081	13,288,338.18	0.87
24	601899	紫金矿业	1,341,600	13,013,520.00	0.85
25	600406	国电南瑞	323,740	12,959,312.20	0.85
26	002648	卫星化学	323,560	12,952,106.80	0.85
27	000858	五粮液	55,865	12,438,900.90	0.82
28	002025	航天电器	145,000	12,172,750.00	0.80
29	603267	鸿远电子	67,720	12,151,676.80	0.80
30	600436	片仔癀	26,800	11,715,620.00	0.77
31	002484	江海股份	426,300	11,646,516.00	0.76
32	002402	和而泰	422,600	11,591,918.00	0.76
33	002594	比亚迪	42,800	11,475,536.00	0.75
34	002810	山东赫达	185,360	11,412,615.20	0.75
35	600765	中航重机	217,500	10,981,575.00	0.72
36	300628	亿联网络	133,100	10,840,995.00	0.71
37	601799	星宇股份	52,409	10,704,538.25	0.70
38	603678	火炬电子	138,967	10,512,853.55	0.69
39	300034	钢研高纳	180,300	10,385,280.00	0.68
40	002709	天赐材料	89,564	10,268,512.60	0.67
41	002013	中航机电	553,400	10,060,812.00	0.66

42	002459	晶澳科技	106,700	9,891,090.00	0.65
43	600886	国投电力	848,600	9,733,442.00	0.64
44	300316	晶盛机电	135,952	9,448,664.00	0.62
45	600483	福能股份	577,800	9,406,584.00	0.62
46	600862	中航高科	262,250	9,378,060.00	0.62
47	300408	三环集团	203,900	9,093,940.00	0.60
48	002028	思源电气	184,300	9,069,403.00	0.59
49	603588	高能环境	513,100	9,015,167.00	0.59
50	300274	阳光电源	59,500	8,675,100.00	0.57
51	600803	新奥股份	455,900	8,370,324.00	0.55
52	002531	天顺风能	426,200	8,264,018.00	0.54
53	002756	永兴材料	54,700	8,096,694.00	0.53
54	603568	伟明环保	211,500	7,726,095.00	0.51
55	300630	普利制药	139,100	7,656,064.00	0.50
56	603806	福斯特	56,600	7,389,130.00	0.48
57	002920	德赛西威	51,300	7,259,463.00	0.48
58	300751	迈为股份	11,220	7,206,606.00	0.47
59	300687	赛意信息	236,360	6,896,984.80	0.45
60	601088	中国神华	302,900	6,821,308.00	0.45
61	603799	华友钴业	61,800	6,817,158.00	0.45
62	000998	隆平高科	291,800	6,787,268.00	0.45
63	600884	杉杉股份	206,800	6,776,836.00	0.44
64	600674	川投能源	542,100	6,776,250.00	0.44
65	603259	药明康德	56,648	6,717,319.84	0.44
66	002541	鸿路钢构	122,500	6,558,650.00	0.43
67	002241	歌尔股份	120,700	6,529,870.00	0.43
68	002475	立讯精密	132,600	6,523,920.00	0.43
69	002245	蔚蓝锂芯	237,000	6,519,870.00	0.43
70	601311	骆驼股份	424,600	6,509,118.00	0.43
71	601225	陕西煤业	523,200	6,383,040.00	0.42
72	601965	中国汽研	336,200	6,256,682.00	0.41
73	600893	航发动力	93,900	5,958,894.00	0.39
74	300769	德方纳米	12,000	5,893,920.00	0.39
75	002230	科大讯飞	107,000	5,618,570.00	0.37
76	000519	中兵红箭	207,600	5,536,692.00	0.36
77	601677	明泰铝业	125,500	5,533,295.00	0.36
78	300763	锦浪科技	23,790	5,508,574.50	0.36
79	600025	华能水电	834,900	5,501,991.00	0.36
80	600779	水井坊	44,900	5,387,551.00	0.35
81	300285	国瓷材料	125,400	5,338,278.00	0.35
82	000799	酒鬼酒	25,100	5,333,750.00	0.35
83	002041	登海种业	203,250	5,241,817.50	0.34

84	300087	荃银高科	171,800	5,222,720.00	0.34
85	600111	北方稀土	112,700	5,161,660.00	0.34
86	002850	科达利	32,100	5,146,914.00	0.34
87	002311	海大集团	70,200	5,145,660.00	0.34
88	300014	亿纬锂能	42,173	4,984,005.14	0.33
89	300073	当升科技	57,300	4,977,651.00	0.33
90	688599	天合光能	61,112	4,821,736.80	0.32
91	600452	涪陵电力	236,700	4,767,138.00	0.31
92	300696	爱乐达	89,800	4,664,212.00	0.31
93	603659	璞泰来	28,983	4,654,959.63	0.31
94	300661	圣邦股份	14,931	4,613,679.00	0.30
95	600499	科达制造	183,900	4,564,398.00	0.30
96	300726	宏达电子	44,500	4,452,670.00	0.29
97	002597	金禾实业	86,500	4,441,775.00	0.29
98	300638	广和通	79,600	4,338,200.00	0.28
99	600456	宝钛股份	59,900	4,299,622.00	0.28
100	000738	航发控制	141,400	4,281,592.00	0.28
101	300454	深信服	22,407	4,279,737.00	0.28
102	000739	普洛药业	119,600	4,196,764.00	0.28
103	002407	多氟多	93,200	4,193,068.00	0.28
104	603060	国检集团	214,360	4,137,148.00	0.27
105	600188	兖矿能源	175,100	4,120,103.00	0.27
106	300476	胜宏科技	131,400	3,974,850.00	0.26
107	002080	中材科技	116,656	3,968,637.12	0.26
108	300775	三角防务	77,700	3,798,753.00	0.25
109	600048	保利发展	242,900	3,796,527.00	0.25
110	002410	广联达	58,406	3,736,815.88	0.25
111	601636	旗滨集团	218,000	3,727,800.00	0.24
112	603128	华贸物流	255,600	3,496,608.00	0.23
113	688516	奥特维	13,800	3,390,936.00	0.22
114	000408	藏格矿业	81,900	3,357,900.00	0.22
115	300395	菲利华	50,800	3,339,592.00	0.22
116	601919	中远海控	177,240	3,312,615.60	0.22
117	600426	华鲁恒升	105,640	3,306,532.00	0.22
118	600460	士兰微	60,873	3,299,316.60	0.22
119	601633	长城汽车	67,900	3,295,866.00	0.22
120	600760	中航沈飞	48,140	3,275,445.60	0.21
121	600887	伊利股份	79,000	3,275,340.00	0.21
122	600298	安琪酵母	53,900	3,253,404.00	0.21
123	600132	重庆啤酒	21,300	3,223,116.00	0.21
124	002906	华阳集团	58,500	3,215,160.00	0.21
125	002385	大北农	291,800	3,060,982.00	0.20

126	603707	健友股份	72,800	3,057,600.00	0.20
127	002223	鱼跃医疗	80,800	3,054,240.00	0.20
128	300413	芒果超媒	53,000	3,032,660.00	0.20
129	603613	国联股份	28,000	3,010,000.00	0.20
130	300627	华测导航	65,200	2,999,200.00	0.20
131	600703	三安光电	76,800	2,884,608.00	0.19
132	002466	天齐锂业	26,900	2,878,300.00	0.19
133	600732	爱旭股份	122,300	2,856,928.00	0.19
134	300662	科锐国际	45,600	2,836,776.00	0.19
135	000596	古井贡酒	11,500	2,806,000.00	0.18
136	603392	万泰生物	12,600	2,790,900.00	0.18
137	603345	安井食品	16,300	2,783,714.00	0.18
138	603290	斯达半导	7,300	2,781,300.00	0.18
139	002555	三七互娱	100,700	2,720,914.00	0.18
140	603606	东方电缆	52,500	2,685,900.00	0.18
141	002139	拓邦股份	142,800	2,668,932.00	0.18
142	603605	珀莱雅	12,800	2,666,368.00	0.17
143	603444	吉比特	6,300	2,657,655.00	0.17
144	002318	久立特材	147,300	2,633,724.00	0.17
145	002271	东方雨虹	49,831	2,625,097.08	0.17
146	000338	潍柴动力	146,100	2,613,729.00	0.17
147	603236	移远通信	12,770	2,603,803.00	0.17
148	300373	扬杰科技	38,500	2,586,430.00	0.17
149	300623	捷捷微电	81,900	2,576,574.00	0.17
150	300725	药石科技	17,754	2,524,086.18	0.17
151	603979	金诚信	114,600	2,461,608.00	0.16
152	002884	凌霄泵业	87,640	2,451,290.80	0.16
153	603596	伯特利	34,500	2,401,200.00	0.16
154	002372	伟星新材	98,600	2,397,952.00	0.16
155	603198	迎驾贡酒	33,700	2,340,465.00	0.15
156	000875	吉电股份	253,300	2,302,497.00	0.15
157	600741	华域汽车	80,300	2,272,490.00	0.15
158	002258	利尔化学	67,300	2,270,029.00	0.15
159	002158	汉钟精机	84,200	2,242,246.00	0.15
160	300207	欣旺达	51,900	2,188,104.00	0.14
161	000818	航锦科技	58,000	2,152,380.00	0.14
162	600985	淮北矿业	191,600	2,142,088.00	0.14
163	002142	宁波银行	55,080	2,108,462.40	0.14
164	300685	艾德生物	27,700	2,091,627.00	0.14
165	600085	同仁堂	45,400	2,042,092.00	0.13
166	300760	迈瑞医疗	5,106	1,944,364.80	0.13
167	600882	妙可蓝多	34,100	1,909,600.00	0.13

168	300593	新雷能	34,160	1,857,620.80	0.12
169	601877	正泰电器	34,000	1,832,260.00	0.12
170	300487	蓝晓科技	18,400	1,809,640.00	0.12
171	603599	广信股份	46,400	1,809,600.00	0.12
172	601985	中国核电	215,100	1,785,330.00	0.12
173	002353	杰瑞股份	44,000	1,760,000.00	0.12
174	603010	万盛股份	59,980	1,570,276.40	0.10
175	601208	东材科技	89,349	1,550,205.15	0.10
176	603882	金域医学	13,900	1,548,043.00	0.10
177	002791	坚朗五金	8,498	1,543,151.82	0.10
178	000591	太阳能	132,100	1,479,520.00	0.10
179	002415	海康威视	28,185	1,474,639.20	0.10
180	603712	七一二	33,600	1,454,880.00	0.10
181	600875	东方电气	66,700	1,428,714.00	0.09
182	300347	泰格医药	11,116	1,420,624.80	0.09
183	600486	扬农化工	10,700	1,403,840.00	0.09
184	603063	禾望电气	34,600	1,394,726.00	0.09
185	000538	云南白药	13,200	1,381,380.00	0.09
186	601865	福莱特	23,800	1,378,972.00	0.09
187	002812	恩捷股份	5,483	1,372,943.20	0.09
188	002056	横店东磁	72,600	1,369,962.00	0.09
189	300390	天华超净	16,900	1,368,900.00	0.09
190	002556	辉隆股份	104,300	1,342,341.00	0.09
191	600873	梅花生物	175,000	1,342,250.00	0.09
192	600754	锦江酒店	22,800	1,336,080.00	0.09
193	601233	桐昆股份	61,400	1,300,452.00	0.09
194	002180	纳思达	26,700	1,275,192.00	0.08
195	300054	鼎龙股份	52,100	1,268,114.00	0.08
196	002074	国轩高科	24,700	1,265,875.00	0.08
197	600195	中牧股份	96,200	1,257,334.00	0.08
198	300394	天孚通信	34,078	1,247,254.80	0.08
199	300861	美畅股份	15,900	1,236,543.00	0.08
200	000988	华工科技	42,300	1,178,478.00	0.08
201	300443	金雷股份	20,300	1,172,528.00	0.08
202	002624	完美世界	56,900	1,155,639.00	0.08
203	600329	中新药业	36,500	1,146,465.00	0.08
204	603127	昭衍新药	9,927	1,145,873.61	0.08
205	600285	羚锐制药	70,300	1,110,740.00	0.07
206	601222	林洋能源	91,400	1,108,682.00	0.07
207	603885	吉祥航空	60,500	1,073,875.00	0.07
208	300142	沃森生物	18,600	1,045,320.00	0.07
209	002833	弘亚数控	31,720	1,020,749.60	0.07



210	002876	三利谱	16,200	1,012,176.00	0.07
211	688536	思瑞浦	1,293	993,024.00	0.07
212	300896	爱美客	1,851	992,339.61	0.07
213	300699	光威复材	11,587	978,869.76	0.06
214	300604	长川科技	16,800	966,000.00	0.06
215	601021	春秋航空	16,700	948,560.00	0.06
216	300777	中简科技	15,200	940,576.00	0.06
217	600236	桂冠电力	146,100	937,962.00	0.06
218	600976	健民集团	10,900	859,901.00	0.06
219	300502	新易盛	20,800	814,944.00	0.05
220	601058	赛轮轮胎	51,900	767,601.00	0.05
221	688798	艾为电子	3,592	755,505.36	0.05
222	300596	利安隆	16,800	751,968.00	0.05
223	300415	伊之密	34,100	724,284.00	0.05
224	002430	杭氧股份	24,043	721,530.43	0.05
225	000977	浪潮信息	20,100	720,183.00	0.05
226	002008	大族激光	13,100	707,400.00	0.05
227	000768	中航西飞	18,100	660,650.00	0.04
228	000568	泸州老窖	2,600	660,062.00	0.04
229	688116	天奈科技	4,400	656,876.00	0.04
230	002202	金风科技	39,800	655,506.00	0.04
231	601009	南京银行	72,800	652,288.00	0.04
232	002240	盛新锂能	10,900	631,655.00	0.04
233	000039	中集集团	35,100	602,316.00	0.04
234	603179	新泉股份	13,700	592,936.00	0.04
235	000983	山西焦煤	71,600	592,132.00	0.04
236	688105	诺唯赞	6,180	576,532.20	0.04
237	603986	兆易创新	3,200	562,720.00	0.04
238	002409	雅克科技	6,700	543,839.00	0.04
239	603218	日月股份	16,300	537,085.00	0.04
240	300122	智飞生物	4,300	535,780.00	0.04
241	600116	三峡水利	45,900	535,194.00	0.04
242	002254	泰和新材	27,200	533,392.00	0.03
243	002832	比音勒芬	20,900	531,905.00	0.03
244	300251	光线传媒	41,100	528,135.00	0.03
245	002384	东山精密	19,000	514,900.00	0.03
246	300767	震安科技	4,900	511,315.00	0.03
247	300618	寒锐钴业	6,200	497,116.00	0.03
248	688363	华熙生物	3,138	487,331.40	0.03
249	002036	联创电子	19,500	473,070.00	0.03
250	603939	益丰药房	8,100	446,391.00	0.03
251	300416	苏试试验	12,700	431,165.00	0.03

252	300776	帝尔激光	1,600	409,440.00	0.03
253	603505	金石资源	11,247	407,478.81	0.03
254	300806	斯迪克	6,800	401,200.00	0.03
255	002507	涪陵榨菜	10,500	396,900.00	0.03
256	603026	石大胜华	2,000	395,980.00	0.03
257	603308	应流股份	17,600	392,832.00	0.03
258	002408	齐翔腾达	37,400	392,700.00	0.03
259	300171	东富龙	7,700	389,158.00	0.03
260	300759	康龙化成	2,700	381,429.00	0.03
261	002601	龙佰集团	13,300	380,247.00	0.02
262	000902	新洋丰	22,400	378,336.00	0.02
263	600989	宝丰能源	21,400	371,504.00	0.02
264	300655	晶瑞电材	8,800	367,664.00	0.02
265	300682	朗新科技	9,900	366,597.00	0.02
266	002453	华软科技	20,200	366,428.00	0.02
267	002006	精功科技	13,500	362,880.00	0.02
268	603098	森特股份	7,700	361,669.00	0.02
269	301211	亨迪药业	9,664	359,633.72	0.02
270	002221	东华能源	28,400	357,556.00	0.02
271	688167	炬光科技	2,014	355,813.38	0.02
272	603279	景津环保	7,600	352,488.00	0.02
273	688357	建龙微纳	1,800	345,492.00	0.02
274	000830	鲁西化工	22,200	338,772.00	0.02
275	688192	迪哲医药	8,926	330,351.26	0.02
276	000963	华东医药	7,700	309,540.00	0.02
277	300354	东华测试	8,000	306,000.00	0.02
278	688005	容百科技	2,600	300,508.00	0.02
279	300587	天铁股份	15,000	299,550.00	0.02
280	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
281	300260	新莱应材	6,100	287,737.00	0.02
282	603520	司太立	4,400	286,000.00	0.02
283	600172	黄河旋风	27,100	275,336.00	0.02
284	300083	创世纪	19,200	274,176.00	0.02
285	002645	华宏科技	11,000	268,400.00	0.02
286	300567	精测电子	3,700	267,991.00	0.02
287	300850	新强联	1,500	267,765.00	0.02
288	301221	光庭信息	2,791	264,566.77	0.02
289	002129	中环股份	6,300	263,025.00	0.02
290	300737	科顺股份	15,960	259,350.00	0.02
291	601369	陕鼓动力	19,700	256,494.00	0.02
292	300480	光力科技	7,400	253,968.00	0.02
293	002557	洽洽食品	4,000	245,440.00	0.02

294	601666	平煤股份	29,300	245,241.00	0.02
295	688766	普冉股份	704	241,281.92	0.02
296	603113	金能科技	14,300	233,090.00	0.02
297	300568	星源材质	6,310	231,766.30	0.02
298	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.02
299	688390	固德威	500	229,790.00	0.02
300	000723	美锦能源	13,900	225,597.00	0.01
301	002568	百润股份	3,533	211,379.39	0.01
302	603855	华荣股份	8,100	204,768.00	0.01
303	301168	通灵股份	3,281	194,447.89	0.01
304	301091	深城交	5,240	171,845.80	0.01
305	600309	万华化学	1,700	171,700.00	0.01
306	300919	中伟股份	1,110	168,176.10	0.01
307	600970	中材国际	14,400	164,592.00	0.01
308	688518	联赢激光	3,100	152,737.00	0.01
309	601100	恒立液压	1,794	146,749.20	0.01
310	600795	国电电力	45,700	144,869.00	0.01
311	300009	安科生物	11,000	143,990.00	0.01
312	600660	福耀玻璃	3,000	141,420.00	0.01
313	688169	石头科技	172	139,836.00	0.01
314	601838	成都银行	11,500	138,000.00	0.01
315	603681	永冠新材	3,500	137,550.00	0.01
316	000636	风华高科	4,600	137,080.00	0.01
317	002324	普利特	9,500	134,140.00	0.01
318	603187	海容冷链	2,800	132,860.00	0.01
319	600845	宝信软件	2,168	131,879.44	0.01
320	000807	云铝股份	11,800	131,806.00	0.01
321	300357	我武生物	2,300	131,790.00	0.01
322	002851	麦格米特	4,100	131,282.00	0.01
323	600763	通策医疗	657	130,743.00	0.01
324	300215	电科院	13,000	130,390.00	0.01
325	300748	金力永磁	2,900	130,181.00	0.01
326	300470	中密控股	2,900	129,543.00	0.01
327	300224	正海磁材	7,500	128,100.00	0.01
328	688227	品高股份	4,164	128,084.64	0.01
329	688333	铂力特	600	127,800.00	0.01
330	300811	铂科新材	1,300	127,764.00	0.01
331	002738	中矿资源	1,800	126,648.00	0.01
332	603960	克来机电	3,400	123,692.00	0.01
333	300151	昌红科技	3,000	122,700.00	0.01
334	600030	中信证券	4,600	121,486.00	0.01
335	603690	至纯科技	2,500	120,375.00	0.01

336	601126	四方股份	5,600	117,040.00	0.01
337	600577	精达股份	15,600	116,064.00	0.01
338	603489	八方股份	500	112,800.00	0.01
339	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.01
340	000831	五矿稀土	2,800	109,256.00	0.01
341	300772	运达股份	2,400	105,552.00	0.01
342	688200	华峰测控	200	102,380.00	0.01
343	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
344	688611	杭州柯林	1,400	99,078.00	0.01
345	300595	欧普康视	1,570	90,070.90	0.01
346	300790	宇瞳光学	1,900	85,842.00	0.01
347	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
348	002293	罗莱生活	5,100	73,083.00	0.00
349	600176	中国巨石	4,000	72,800.00	0.00
350	603100	川仪股份	3,200	67,712.00	0.00
351	300015	爱尔眼科	1,564	66,125.92	0.00
352	002304	洋河股份	400	65,892.00	0.00
353	002274	华昌化工	5,000	63,350.00	0.00
354	603915	国茂股份	1,600	62,240.00	0.00
355	002967	广电计量	2,246	60,821.68	0.00
356	601598	中国外运	13,400	60,032.00	0.00
357	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
358	301087	可孚医疗	665	50,101.10	0.00
359	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
360	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
361	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
362	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
363	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
364	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
365	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
366	002414	高德红外	1,040	25,178.40	0.00
367	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
368	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
369	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
370	300982	苏文电能	317	23,328.03	0.00
371	600031	三一重工	1,000	22,800.00	0.00
372	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
373	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
374	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
375	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
376	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
377	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00

378	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
379	688408	中信博	100	17,651.00	0.00
380	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
381	300997	欢乐家	928	16,082.24	0.00
382	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
383	300474	景嘉微	100	15,220.00	0.00
384	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
385	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
386	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
387	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
388	300033	同花顺	100	14,458.00	0.00
389	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
390	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
391	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
392	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
393	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
394	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
395	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
396	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
397	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
398	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
399	002027	分众传媒	1,400	11,466.00	0.00
400	300962	中金辐照	576	11,422.08	0.00
401	300037	新宙邦	100	11,300.00	0.00
402	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
403	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
404	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
405	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
406	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
407	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
408	600570	恒生电子	140	8,701.00	0.00
409	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
410	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
411	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
412	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
413	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
414	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
415	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
416	300012	华测检测	284	7,631.08	0.00
417	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
418	300617	安靠智电	100	7,171.00	0.00
419	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00

420	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
421	603517	绝味食品	100	6,833.00	0.00
422	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
423	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
424	603899	晨光文具	100	6,451.00	0.00
425	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
426	002959	小熊电器	100	6,387.00	0.00
427	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
428	002032	苏泊尔	100	6,224.00	0.00
429	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
430	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
431	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
432	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
433	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
434	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
435	002714	牧原股份	100	5,336.00	0.00
436	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
437	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
438	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
439	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
440	600438	通威股份	100	4,496.00	0.00
441	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
442	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
443	002153	石基信息	140	4,023.60	0.00
444	688396	华润微	62	4,005.20	0.00
445	603008	喜临门	100	3,903.00	0.00
446	300674	宇信科技	160	3,824.00	0.00
447	600141	兴发集团	100	3,788.00	0.00
448	603906	龙蟠科技	100	3,704.00	0.00
449	002508	老板电器	100	3,602.00	0.00
450	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
451	000063	中兴通讯	100	3,350.00	0.00
452	600584	长电科技	100	3,102.00	0.00
453	002891	中宠股份	100	3,024.00	0.00
454	002497	雅化集团	100	2,866.00	0.00
455	002439	启明星辰	100	2,853.00	0.00
456	603877	太平鸟	100	2,788.00	0.00
457	300146	汤臣倍健	100	2,696.00	0.00
458	002867	周大生	150	2,667.00	0.00
459	601615	明阳智能	100	2,610.00	0.00
460	002299	圣农发展	100	2,417.00	0.00
461	002236	大华股份	100	2,348.00	0.00

462	002281	光迅科技	100	2,329.00	0.00
463	600362	江西铜业	100	2,233.00	0.00
464	300101	振芯科技	100	2,218.00	0.00
465	600089	特变电工	100	2,117.00	0.00
466	600323	瀚蓝环境	100	2,098.00	0.00
467	603612	索通发展	100	2,052.00	0.00
468	688779	长远锂科	86	2,015.84	0.00
469	000301	东方盛虹	100	1,934.00	0.00
470	601166	兴业银行	100	1,904.00	0.00
471	002677	浙江美大	100	1,735.00	0.00
472	300188	美亚柏科	100	1,719.00	0.00
473	300369	绿盟科技	100	1,586.00	0.00
474	000921	海信家电	100	1,515.00	0.00
475	601168	西部矿业	100	1,361.00	0.00
476	000878	云南铜业	100	1,337.00	0.00
477	002043	兔宝宝	100	1,208.00	0.00
478	600516	方大炭素	100	1,082.00	0.00
479	002340	格林美	100	1,035.00	0.00
480	000933	神火股份	100	909.00	0.00
481	600377	宁沪高速	100	862.00	0.00
482	002563	森马服饰	100	773.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300059	东方财富	25,091,001.00	1.01
2	002371	北方华创	18,414,989.76	0.74
3	300725	药石科技	15,213,830.20	0.61
4	603486	科沃斯	15,074,886.42	0.61
5	300759	康龙化成	14,852,886.00	0.60
6	603128	华贸物流	14,542,579.36	0.59
7	600674	川投能源	14,394,639.18	0.58
8	603816	顾家家居	14,043,226.32	0.57
9	300782	卓胜微	13,991,686.17	0.57
10	002572	索菲亚	13,883,257.30	0.56
11	600900	长江电力	13,844,779.12	0.56
12	002142	宁波银行	13,802,348.28	0.56
13	603127	昭衍新药	13,779,227.00	0.56
14	688169	石头科技	13,648,893.48	0.55
15	002049	紫光国微	13,583,554.70	0.55
16	603833	欧派家居	13,490,417.89	0.54

17	600025	华能水电	13,302,715.00	0.54
18	603801	志邦家居	13,207,726.15	0.53
19	002179	中航光电	12,970,589.60	0.52
20	600803	新奥股份	12,701,339.60	0.51

#### 8.4.2 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	116,236,725.17	4.69
2	000858	五粮液	88,797,528.52	3.59
3	600519	贵州茅台	86,368,942.30	3.49
4	300750	宁德时代	75,083,294.02	3.03
5	600036	招商银行	59,380,419.51	2.40
6	002594	比亚迪	55,516,231.92	2.24
7	002142	宁波银行	52,739,534.56	2.13
8	300760	迈瑞医疗	49,241,723.33	1.99
9	600809	山西汾酒	45,190,863.49	1.83
10	601166	兴业银行	42,825,600.22	1.73
11	000001	平安银行	42,516,179.94	1.72
12	601100	恒立液压	39,784,397.76	1.61
13	300015	爱尔眼科	39,524,639.59	1.60
14	002475	立讯精密	36,273,544.52	1.46
15	300124	汇川技术	34,786,973.42	1.40
16	000333	美的集团	33,753,536.50	1.36
17	600763	通策医疗	32,191,021.22	1.30
18	300014	亿纬锂能	31,438,952.39	1.27
19	600926	杭州银行	30,195,156.12	1.22
20	600031	三一重工	28,993,533.15	1.17

#### 8.4.3 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	2,333,172,372.69
卖出股票收入（成交）总额	3,351,363,736.72

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 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

#### 8.5 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	90,027,000.00	5.91
	其中：政策性金融债	90,027,000.00	5.91



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	90,027,000.00	5.91

## 8.6 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	210304	21 进出 04	500,000	50,015,000.00	3.28
2	210201	21 国开 01	400,000	40,012,000.00	2.62

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 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
IC2206	IC2206	20	28,591,200.00	153,400.00	-
公允价值变动总额合计（元）					153,400.00
股指期货投资本期收益（元）					6,515,623.14
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-2,196,416.47

### 8.10.2 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

## 8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

## 8.13 投资组合报告附注

### 8.13.1 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 7 月 16 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】31 号），对中国进出口银行违规投资企业股权、个别高管人员未经核准实际履职、监管数据漏报错报等违法违规事实，于 2021 年 7 月 13 日作出行政处罚决定，罚款 7345.6 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）”、“21 进出 04（210304）”的决策程序说明：基于对 21 国开 01、21 进出 04 的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“21 国开 01”、“21 进出 04”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，其他七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。

### 8.13.2 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。

### 8.13.3 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	4,130,494.06
2	应收证券清算款	8,716,991.93
3	应收股利	—
4	应收利息	1,626,315.47
5	应收申购款	47,731.69
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	14,521,533.15

### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
27,510	41,784.45	98,814.23	0.01	1,149,391,498.37	99.99

### 9.2 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	178,658.24	0.02

### 9.3 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

## § 10 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	53,080,697.19
减：本报告期基金总赎回份额	795,826,310.80
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	1,149,490,312.60

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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。

2021 年 7 月 23 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》，龚康先生任公司副总经理。

#### （2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 92,000.00 元,该审计机构已连续 7 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
东方财富证券股份有限公司	2	1,424,163,430.97	25.21%	899,085.47	23.79%	-
东方证券股份有限公司	2	1,168,599,264.95	20.68%	772,139.82	20.43%	-
长江证券股份有限公司	3	774,674,590.96	13.71%	542,277.45	14.35%	-
中信证券股份有限公司	4	517,647,952.32	9.16%	362,355.93	9.59%	-
国盛证券有限责任公司	2	469,878,747.49	8.32%	296,633.01	7.85%	-
中国国际金融股份有限公司	2	305,531,385.65	5.41%	213,872.46	5.66%	-

中信建投 证券股份 有限公司	3	240,456,727.11	4.26%	168,319.70	4.45%	-
海通证券 股份有限 公司	3	222,756,283.16	3.94%	155,930.22	4.13%	-
中泰证券 股份有限 公司	1	175,900,764.06	3.11%	123,132.06	3.26%	-
广发证券 股份有限 公司	2	136,530,653.58	2.42%	95,573.14	2.53%	-
国信证券 股份有限 公司	2	89,991,262.92	1.59%	63,081.05	1.67%	-
兴业证券 股份有限 公司	1	60,849,272.98	1.08%	42,594.45	1.13%	-
北京高华 证券有限 责任公司	2	56,238,116.68	1.00%	39,367.13	1.04%	-
华泰证券 股份有限 公司	1	6,287,105.27	0.11%	4,400.98	0.12%	-
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	-	-	-	-	-
华宝证券 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	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	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：广发证券股份有限公司新增交易单元 1 个，海通证券股份有限公司新增交易单元 1 个，华宝证券股份有限公司新增交易单元 2 个，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，中信建投证券股份有限公司



司新增交易单元 1 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

### 11.7.2 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
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	454,180.60	4.31%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	8,639,161.20	81.94%	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1,449,909.72	13.75%	-	-	-	-
兴业证券股份有限	-	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-	-
华宝证券 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						
招商证券 股份有限 公司						
浙商证券 股份有限 公司						
中国银河 证券股份 有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中银国际 证券股份 有限公司						

### 11.8 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 1 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 4 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旗下基金相关销售业务的公告	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 5 月 7 日
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 5 月 29 日
5	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 7 月 23 日
6	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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 9 月 1 日
7	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	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 9 月 18 日
8	嘉实基金管理有限公司关于继续在网上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	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 9 月 28 日
9	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金	中国证券报、基金管理人	2021 年 11 月 5 日

	投资北方华创非公开发行股票的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
10	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	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 11 月 16 日
11	嘉实基金管理有限公司关于对中信银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	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 12 月 3 日
12	嘉实基金管理有限公司关于对中国邮政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	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 12 月 3 日
13	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	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 12 月 24 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实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。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2022 年 3 月 30 日