

嘉实事件驱动股票型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62

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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	65
10.1 基金份额持有人大会决议	65
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	71
§ 11 备查文件目录	71
11.1 备查文件目录	71
11.2 存放地点	71
11.3 查阅方式	71

§ 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	1,092,733,737.03 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

传真	(010)65215588	(010)66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	经雷	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-58,184,243.26
本期利润	-212,489,849.94
加权平均基金份额本期利润	-0.1898
本期加权平均净值利润率	-16.90%
本期基金份额净值增长率	-13.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	155,505,265.25
期末可供分配基金份额利润	0.1423
期末基金资产净值	1,248,239,002.28
期末基金份额净值	1.142
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.20%

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

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

于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	6.43%	0.97%	7.65%	0.86%	-1.22%	0.11%
过去三个月	3.07%	1.26%	5.26%	1.14%	-2.19%	0.12%
过去六个月	-13.88%	1.32%	-6.92%	1.16%	-6.96%	0.16%
过去一年	-16.95%	1.32%	-10.37%	1.00%	-6.58%	0.32%
过去三年	57.52%	1.47%	17.55%	1.01%	39.97%	0.46%
自基金合同生效起至今	14.20%	1.46%	-5.19%	1.15%	19.39%	0.31%

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：

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

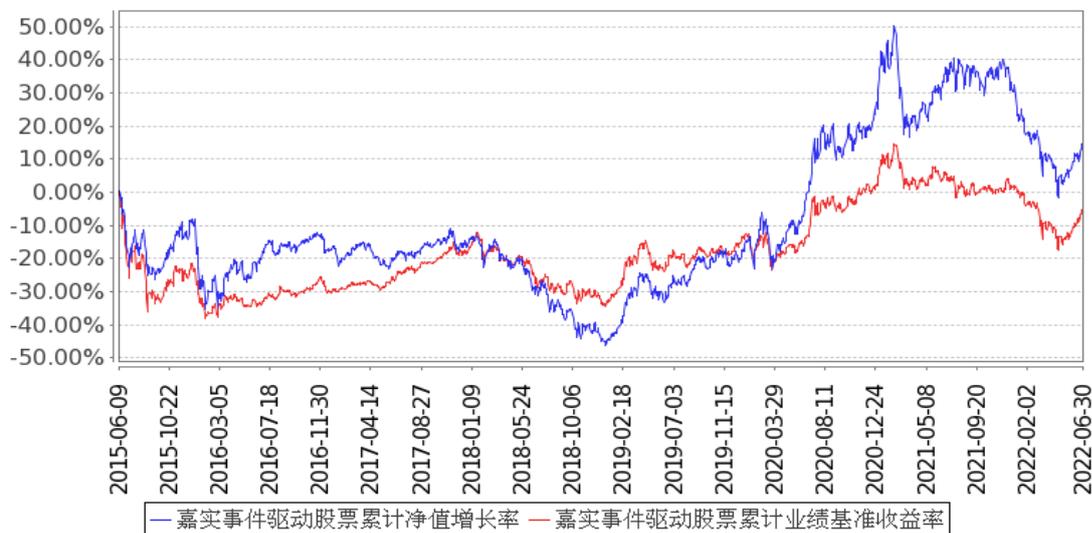
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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2022年06月30日)



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

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[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2022年6月30日，基金管理人共管理277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	-	26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	-	10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行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 4 次，其中 1 次为旗下组合被动跟踪模拟组合权重配置需要与其他组合发生反向交易，另 3 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

2022 年上半年报告期内，一季度 A 股市场经历了整体全面回撤，沪深 300 跌幅接近 15%，创业板指跌幅接近 20%，其后在二季度中开始逐步走出相对全球主要股指更加独立的趋势，转入上行趋势。大盘指数沪深 300 等指数仅在 6 月份就实现单月 9% 以上的反弹，创业板指在五、六两个月累积反弹达到 20% 水平。

全球资本市场开年就进入下行趋势，在一月份，A 股与美股等发达资本市场回撤幅度相近。各国资本市场在国际大宗商品，包括油气能源、金属矿产原材料、农业大宗等上游基础价格的持续上涨、以及美联储对全球流动性收缩的环境下，基本经历了相似的结构切换，资本市场内部的能源等周期上游、价值风格相对强势，煤炭行业在报告期内发布了较大比例的业绩预增报告，行业指数也大幅上行，对比而言，新能源、电子、军工等高估值高成长板块则回撤较强，白酒与生物医药波动较大。

国内而言，报告期内对经济冲击较大的事件，最直观的是上海等地疫情反复及相应的管控措施带来的停工停产以及消费下降的短期情况，国内经济在一季度面临较大增长压力，居民消费、出行以及工业生产等全面受到疫情影响，在二季度中期疫情成功控制在有限范围内后，经济活力开始恢复。同时全球资本环境在美联储的加息过程中逐步收紧，权益类市场在估值维度内受到利率政策的直接影响。在多方面影响下，A 股在一季度逐步走弱并加速下探，二季度 4 月份随着北京防疫管控加大力度，并利用假期实现动态清零后，生产生活活动逐步放开，包括汽车等耐用品消费的累积需求逐步释放，市场信心逐步增强，投资者情绪也逐步抬升，成长股、主题板块等在五月份迎来持续和强劲的反弹。

本组合在实际管理过程中，根据宏观经济形式与政策导向的变化进行组合积极优化，避免追逐市场短期热点主题或板块，在适当的持仓分散性下以较强的盈利能力、较好的流动性、与产业发展匹配的适当的估值水平为核心要素进行筛选。

本报告期内较为重大且有较广范围影响的事件，主要是国内疫情的再次抬头和相关管控对经济活动的短暂影响，另外美联储的加息节奏以及其定期会议对全球资本市场风向影响的因素也是重要的观测指标。本组合不持有直接受俄乌冲突的上市公司，并以规避风险原则积极梳理现有持仓。新冠疫情若再次出现局部严重情况，会触发相应的社会流动管理并由此直接影响经济活动，组合将密切关注后续的新冠控制和清零进度。

本组合在报告期内，在操作上通过负面清单方法在多类事件指标中对股票池进行筛选，在选股上倾向于规避基本面增长乏力、估值过高、市场过度追捧等标的，在风格和行业上以风险为度

量，相对于往期采取更加均衡的配置，在价值、周期等有所偏转。后续组合将根据全球经济与货币环境变化、国际政治局势对资本市场的影响、国内经济增速情况和国家对应的宏观政策变量调整，以及上市公司具体的经营质量和盈利预期，对组合进行均衡调整，通过逐步调整以增加对市场波动的抵抗能力。

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，在报告期内满足 80%-95% 的股票高仓位约束，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 1.142 元；本报告期基金份额净值增长率为-13.88%，业绩比较基准收益率为-6.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以上海和北京在二季度内完成对疫情有效控制后的情况来看，随着常态化检测和动态清零等管控方式的执行，预期工业生产和出行消费等领域的正常化可以得到持续保障。在政府在下半年对 GDP 目标增速的坚持达成态度、对失业率的积极干预以及相应的对产业和居民消费的支持手段下，预期经济将继续呈现出较强的复苏韧性。

相比于疫情而言，目前对经济恢复和资本市场更有影响的是美联储对基本利率和全球流动性的影响。随着美联储进一步继续提高基础利率，以及当前国际上游资源价格上行、全球消费需求回落、工业产业链以中国为唯一有效控制疫情后并持续稳健生产的经济体，各国货币汇率出现较大波动，欧元、日元等的汇率变化达到历史级别，也影响东南亚等具备对中国产业链的替代能力。在此背景下，预期中国的工业出口将继续稳健增长，国际贸易盈余以及出口对经济拉动能力将保持。

目前，美国和欧洲等主要经济体在多方面影响下增长乏力，包括持续收紧的货币环境和能源资源供应链的国际问题，但目前尚未有国家明显进入衰退，在通胀但经济增长预期依然保持的假

设下，权益类资产将是相对债券资产更好的选择。

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行业政策对盈利的影响、国企改革等事件。

结合 2022 年市场面临的外部环境、国内政策以及上游原材料涨价等现实情况，我们将会进一步扩展和增强风控类事件对组合下行风险的控制，利用投资框架的稳健性，积极调整模型，控制风险，希望取得更好的投资效果，回馈投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	21,425,403.19	35,067,111.68
结算备付金		98,108,759.96	68,379,647.09
存出保证金		5,277,443.40	4,130,494.06
交易性金融资产	6.4.7.2	1,115,469,950.54	1,416,591,396.15
其中：股票投资		1,053,733,309.17	1,326,564,396.15
基金投资		-	-
债券投资		61,736,641.37	90,027,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		21,168,189.78	8,716,991.93
应收股利		-	-
应收申购款		162,504.44	47,731.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,626,315.47
资产总计		1,261,612,251.31	1,534,559,688.07
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,858,210.04	5,687,902.74
应付赎回款		1,020,583.64	1,015,056.14
应付管理人报酬		1,496,792.33	1,995,259.55
应付托管费		249,465.39	332,543.25
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	748,197.63	997,062.75
负债合计		13,373,249.03	10,027,824.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,092,733,737.03	1,149,490,312.60
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	155,505,265.25	375,041,551.04
净资产合计		1,248,239,002.28	1,524,531,863.64
负债和净资产总计		1,261,612,251.31	1,534,559,688.07

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.142 元，基金份额总额 1,092,733,737.03 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实事件驱动股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-201,412,722.29	138,692,586.68
1. 利息收入		312,795.77	1,739,473.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	271,006.72	220,746.58
债券利息收入		-	1,518,726.68
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		41,789.05	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-47,432,441.42	467,442,354.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-54,283,957.35	451,776,189.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	808,976.34	2,291,314.29
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-3,270,852.94	4,860,541.14
股利收益	6.4.7.19	9,313,392.53	8,514,310.11
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-154,305,606.68	-330,622,994.36
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	12,530.04	133,753.05
减：二、营业总支出		11,077,127.65	22,267,847.63
1. 管理人报酬		9,385,059.48	14,789,761.06
2. 托管费		1,564,176.59	2,464,960.20
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	27,849.46
8. 其他费用	6.4.7.23	127,891.58	4,985,276.91
三、利润总额（亏损总额以		-212,489,849.94	116,424,739.05

“-”号填列)			
减：所得税费用			-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		-212,489,849.94	116,424,739.05
五、其他综合收益的税后净额			-
六、综合收益总额		-212,489,849.94	116,424,739.05

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,149,490,312.60	-	375,041,551.04	1,524,531,863.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,149,490,312.60	-	375,041,551.04	1,524,531,863.64
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-56,756,575.57	-	-219,536,285.79	-276,292,861.36
(一)、综合收益总额	-	-	-212,489,849.94	-212,489,849.94
(二)、本期基金份额交易产生的基	-56,756,575.57	-	-7,046,435.85	-63,803,011.42

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中:1. 基金申购款	8,674,608.69	-	1,329,955.56	10,004,564.25
2. 基金赎回款	-65,431,184.26	-	-8,376,391.41	-73,807,575.67
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,092,733,737.03	-	155,505,265.25	1,248,239,002.28
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,892,235,926.21	-	583,923,234.31	2,476,159,160.52
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错	-	-	-	-

更正				
其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	1,892,235,926.21	-	583,923,234.31	2,476,159,160.52
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-529,572,503.11	-	-72,499,377.01	-602,071,880.12
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	116,424,739.05	116,424,739.05
(二)、 本 期 基 金 份 额 交 易 产 生 的 基 金 净 值 变 动 数 (净 值 减 少 以 “-” 号 填 列)	-529,572,503.11	-	-188,924,116.06	-718,496,619.17
其中:1. 基 金 申 购 款	39,109,709.26	-	13,306,671.93	52,416,381.19
2 .基 金 赎 回 款	-568,682,212.37	-	-202,230,787.99	-770,913,000.36
(三)、 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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	1,362,663,423.10	-	511,423,857.30	1,874,087,280.40

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实事件驱动股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1064 号《关于准予嘉实事件驱动股票型证券投资基金注册的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 9 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 16,549,730,858.05 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融负债。本基金目前暂无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。基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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相关交易费用及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。

本基金参与的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“证金公司”）出借证券，证金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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.4 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用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。

以摊余成本计量的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。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 35,067,111.68 元、68,379,647.09 元、4,130,494.06 元、1,626,315.47 元、8,716,991.93 元和 47,731.69 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 35,071,560.56 元、68,387,620.57 元、4,130,551.56 元、0.00 元、8,716,991.93 元和 47,731.69 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,416,591,396.15 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 1,418,205,231.76 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,687,902.74 元、1,015,056.14 元、1,995,259.55 元、332,543.25 元、785,035.28 元和 212,027.47 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,687,902.74 元、1,015,056.14

元、1,995,259.55 元、332,543.25 元、785,035.28 元和 212,027.47 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日, 本基金根据新金融工具准则下的计量类别, 将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示, 无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》, 本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露, 这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为, 以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	21,425,403.19
等于：本金	21,423,314.54
加：应计利息	2,088.65
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	21,425,403.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	940,393,331.76	-	1,053,733,309.17	113,339,977.41	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	11,012,800.00	159,176.99	11,170,476.99	-1,500.00
	银行间市场	50,084,350.00	486,164.38	50,566,164.38	-4,350.00
	合计	61,097,150.00	645,341.37	61,736,641.37	-5,850.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,001,490,481.76	645,341.37	1,115,469,950.54	113,334,127.41	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	38,235,660.00	-	-	
其中：股指期货投资	38,235,660.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	38,235,660.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2207	IC2207	15.00	19,303,800.00	458,640.00
IF2207	IF2207	15.00	20,129,400.00	738,900.00
合计				1,197,540.00
减：可抵销期货 暂收款				1,197,540.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	43.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	551,025.67
其中：交易所市场	550,750.67
银行间市场	275.00
应付利息	-
预提费用	197,128.42
合计	748,197.63

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,149,490,312.60	1,149,490,312.60
本期申购	8,674,608.69	8,674,608.69
本期赎回（以“-”号填列）	-65,431,184.26	-65,431,184.26
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	1,092,733,737.03	1,092,733,737.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	781,612,610.58	-406,571,059.54	375,041,551.04
本期利润	-58,184,243.26	-154,305,606.68	-212,489,849.94
本期基金份额交易	-38,361,142.10	31,314,706.25	-7,046,435.85

产生的变动数			
其中：基金申购款	5,919,695.82	-4,589,740.26	1,329,955.56
基金赎回款	-44,280,837.92	35,904,446.51	-8,376,391.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	685,067,225.22	-529,561,959.97	155,505,265.25

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	75,801.28
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	193,899.57
其他	1,305.87
合计	271,006.72

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-54,283,957.35
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	-54,283,957.35

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	1,185,199,856.98
减：卖出股票成本总额	1,236,534,894.82
减：交易费用	2,948,919.51
买卖股票差价收入	-54,283,957.35

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	787,937.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,038.82
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	808,976.34

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	100,245,897.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	97,990,010.00
减：应计利息总额	2,234,546.84
减：交易费用	302.18
买卖债券差价收入	21,038.82

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-3,270,852.94

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,313,392.53
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	9,313,392.53

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-155,349,746.68
股票投资	-155,295,106.68
债券投资	-54,640.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	1,044,140.00
权证投资	-
期货投资	1,044,140.00
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	-154,305,606.68

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	10,761.79
基金转出费收入	1,768.25
合计	12,530.04

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	45,621.05
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	4,163.16
债券托管账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	127,891.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司（“嘉实基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,385,059.48	14,789,761.06
其中：支付销售机构的客户维护费	3,268,450.73	2,767,421.84

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,564,176.59	2,464,960.20

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

无。

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	21,425,403.19	75,801.28	40,280,648.84	57,596.56

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(2022年1月1日至2022年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位: 股)			
300834	星辉环材	2022年 1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301097	天益医疗	2022年 3月25日	6个月	新股锁定	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301102	兆讯传媒	2022年 3月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301110	青木股份	2022年 3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301112	信邦智能	2022年 6月20日	6个月	新股锁定	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股锁定	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股锁定	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301123	奕东电子	2022年 1月14日	6个月	新股锁定	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股锁定	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022年 4月1日	6个月	新股锁定	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301137	哈焊华通	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301139	元道通信	2022年 6月30日	1个月内(含)	新发未上市	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
301139	元道通信	2022年 6月30日	6个月	新股锁定	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301148	嘉戎	2022年	6个月	新股锁	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-

	技术	4月14日		定							
301150	中一科技	2022年4月14日	6个月	新股锁定	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04		-
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04		-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301162	国能日新	2022年4月19日	6个月	新股锁定	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74		-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股锁定	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41		-
301175	中科环保	2022年6月30日	1个月内(含)	新发未上市	3.82	3.82	57,324	218,977.68	218,977.68		-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个月	新股锁定	3.82	3.82	6,370	24,333.40	24,333.40		-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股锁定	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股锁定	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04		-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股锁定	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
301200	大族数控	2022年2月18日	6个月	新股锁定	76.56	51.92	851	65,152.56	44,183.92		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股锁定	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-

301215	中汽股份	2022年 2月28日	6个月	新股锁定	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301217	铜冠铜箔	2022年 1月20日	6个月	新股锁定	17.27	14.83	3,764	65,004.28	55,820.12	-
301219	腾远钴业	2022年 3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	410	39,667.44	36,006.20	-
301220	亚香股份	2022年 6月15日	6个月	新股锁定	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301222	浙江恒威	2022年 3月2日	6个月	新股锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	1个月内(含)	新发未上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	6个月	新股锁定	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16	-
301236	软通动力	2022年 3月8日	6个月	新股锁定	72.88	31.38	1,359	66,029.28	42,645.42	-
301238	瑞泰新材	2022年 6月10日	6个月	新股锁定	19.18	32.07	3,497	67,072.46	112,148.79	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	1个月内(含)	新发未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新股锁定	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年 3月14日	6个月	新股锁定	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年 3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年 4月18日	6个月	新股锁定	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-

		日									
301263	泰恩康	2022年 3月22日	6个月	新股锁定	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16		-
301268	铭利达	2022年 3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67		-
301279	金道科技	2022年 4月6日	6个月	新股锁定	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76		-
301286	侨源股份	2022年 6月6日	6个月	新股锁定	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36		-
301288	清研环境	2022年 4月14日	6个月	新股锁定	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96		-
301302	华如科技	2022年 6月16日	6个月	新股锁定	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72		-
688220	翱捷科技	2022年 1月6日	6个月	新股锁定	164.54	68.59	6,947	1,143,059.38	476,494.73		-
688234	天岳先进	2022年 1月5日	6个月	新股锁定	82.79	65.19	6,759	559,577.61	440,619.21		-
688279	峰昭科技	2022年 4月13日	6个月	新股锁定	82.00	67.34	5,505	451,410.00	370,706.70		-
688400	凌云光	2022年 6月27日	1个月内(含)	新发未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23		-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会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

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同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 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理

的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	21,425,403.19	-	-	-	21,425,403.19
结算备付金	98,108,759.96	-	-	-	98,108,759.96
存出保证金	159,383.40	-	-	5,118,060.00	5,277,443.40
交易性金融资产	61,736,641.37	-	-	1,053,733,309.17	1,115,469,950.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	21,168,189.78	21,168,189.78
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	162,504.44	162,504.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	181,430,187.92	-	-	1,080,182,063.39	1,261,612,251.31
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	9,858,210.04	9,858,210.04
应付赎回款	-	-	-	1,020,583.64	1,020,583.64
应付管理人报酬	-	-	-	1,496,792.33	1,496,792.33
应付托管费	-	-	-	249,465.39	249,465.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	748,197.63	748,197.63
负债总计	-	-	-	13,373,249.03	13,373,249.03
利率敏感度缺口	181,430,187.92	-	-	-1,066,808,814.36	1,248,239,002.28
上年度末 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

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-75,993.59	-58,298.74
	市场利率下降 25 个基点	76,192.92	58,406.26

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

无。

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 2022年6月30日		上年度末 2021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	1,053,733,309.17	84.42	1,326,564,396.15	87.01
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	1,053,733,309.17	84.42	1,326,564,396.15	87.01

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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	业绩比较基准上升5%	64,615,436.24	99,322,961.57
	业绩比较基准下降5%	-64,615,436.24	-99,322,961.57

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	1,050,543,841.71	1,319,489,421.36
第二层次	62,743,636.21	97,101,974.79
第三层次	2,182,472.62	-
合计	1,115,469,950.54	1,416,591,396.15

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告中资产负债表和利润表的上期比较数据，已根据本年《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〉》中的格式要求进行列示调整。其中：

原“应收利息”、“其他资产”项目，合并列示在“其他资产”项目；

原“应付交易费用”、“应付利息”、“其他负债”项目，合并列示在“其他负债”项目；

原“交易费用”、“其他费用”项目，合并列示在“其他费用”项目。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,053,733,309.17	83.52
	其中：股票	1,053,733,309.17	83.52
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	61,736,641.37	4.89
	其中：债券	61,736,641.37	4.89
	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	119,534,163.15	9.47
8	其他各项资产	26,608,137.62	2.11
9	合计	1,261,612,251.31	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	8,585,946.50	0.69
B	采矿业	109,928,684.00	8.81
C	制造业	689,544,795.23	55.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,654,818.20	3.42
E	建筑业	8,780,847.84	0.70
F	批发和零售业	16,215,971.16	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	33,531,243.00	2.69
H	住宿和餐饮业	2,943,720.00	0.24

I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,167,293.06	1.86
J	金融业	80,603,101.12	6.46
K	房地产业	24,261,523.00	1.94
L	租赁和商务服务业	2,127,394.58	0.17
M	科学研究和技术服务业	5,998,760.29	0.48
N	水利、环境和公共设施管理业	399,922.50	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,989,288.69	0.40
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,053,733,309.17	84.42

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000733	振华科技	181,600	24,692,152.00	1.98
2	601088	中国神华	651,300	21,688,290.00	1.74
3	300750	宁德时代	40,100	21,413,400.00	1.72
4	601225	陕西煤业	995,200	21,078,336.00	1.69
5	600048	保利发展	1,175,400	20,522,484.00	1.64
6	002594	比亚迪	60,900	20,309,541.00	1.63
7	600519	贵州茅台	8,907	18,214,815.00	1.46
8	600188	兖矿能源	441,600	17,434,368.00	1.40
9	002049	紫光国微	90,419	17,154,292.68	1.37
10	300059	东方财富	628,729	15,969,716.60	1.28
11	600809	山西汾酒	46,681	15,161,988.80	1.21
12	600036	招商银行	358,916	15,146,255.20	1.21
13	600873	梅花生物	1,304,100	14,710,248.00	1.18
14	601009	南京银行	1,382,518	14,405,837.56	1.15
15	601012	隆基绿能	209,517	13,960,117.71	1.12
16	601838	成都银行	825,161	13,681,169.38	1.10
17	600900	长江电力	588,600	13,608,432.00	1.09
18	300628	亿联网络	164,100	12,496,215.00	1.00
19	603606	东方电缆	162,010	12,409,966.00	0.99
20	002142	宁波银行	340,598	12,196,814.38	0.98
21	601899	紫金矿业	1,269,200	11,841,636.00	0.95
22	600887	伊利股份	303,238	11,811,120.10	0.95

23	002459	晶澳科技	140,120	11,055,468.00	0.89
24	600886	国投电力	1,044,300	10,965,150.00	0.88
25	002179	中航光电	173,078	10,959,298.96	0.88
26	600089	特变电工	366,800	10,046,652.00	0.80
27	300450	先导智能	151,142	9,549,151.56	0.77
28	002258	利尔化学	364,500	8,609,490.00	0.69
29	300496	中科创达	65,880	8,596,022.40	0.69
30	600985	淮北矿业	581,300	8,463,728.00	0.68
31	002756	永兴材料	55,400	8,432,434.00	0.68
32	600123	兰花科创	493,900	8,124,655.00	0.65
33	600438	通威股份	135,600	8,117,016.00	0.65
34	300373	扬杰科技	113,400	8,079,750.00	0.65
35	601001	晋控煤业	437,300	7,762,075.00	0.62
36	002648	卫星化学	299,114	7,732,096.90	0.62
37	603605	珀莱雅	45,620	7,535,511.60	0.60
38	600803	新奥股份	403,100	7,493,629.00	0.60
39	002271	东方雨虹	145,131	7,469,892.57	0.60
40	600674	川投能源	592,400	7,061,408.00	0.57
41	300627	华测导航	204,220	7,023,125.80	0.56
42	600426	华鲁恒升	238,940	6,977,048.00	0.56
43	002372	伟星新材	282,600	6,793,704.00	0.54
44	603613	国联股份	76,170	6,748,662.00	0.54
45	002025	航天电器	96,400	6,730,648.00	0.54
46	600546	山煤国际	340,300	6,622,238.00	0.53
47	000983	山西焦煤	477,800	6,397,742.00	0.51
48	603456	九洲药业	123,500	6,384,950.00	0.51
49	002180	纳思达	125,200	6,337,624.00	0.51
50	603799	华友钴业	65,090	6,223,905.80	0.50
51	002541	鸿路钢构	183,560	6,130,904.00	0.49
52	601111	中国国航	498,600	5,788,746.00	0.46
53	601666	平煤股份	420,800	5,718,672.00	0.46
54	300696	爱乐达	129,900	5,709,105.00	0.46
55	600004	白云机场	382,500	5,703,075.00	0.46
56	002920	德赛西威	38,500	5,698,000.00	0.46
57	601166	兴业银行	284,900	5,669,510.00	0.45
58	601689	拓普集团	82,500	5,645,475.00	0.45
59	000568	泸州老窖	22,800	5,621,112.00	0.45
60	300363	博腾股份	70,500	5,498,295.00	0.44
61	300769	德方纳米	13,220	5,402,749.60	0.43
62	600085	同仁堂	101,100	5,346,168.00	0.43
63	600009	上海机场	89,200	5,057,640.00	0.41
64	600486	扬农化工	37,000	4,931,360.00	0.40

65	300661	圣邦股份	26,746	4,868,306.92	0.39
66	603236	移远通信	35,906	4,799,195.96	0.38
67	603596	伯特利	59,100	4,738,638.00	0.38
68	000858	五粮液	23,365	4,718,094.45	0.38
69	300390	天华超净	53,900	4,710,860.00	0.38
70	002484	江海股份	200,700	4,684,338.00	0.38
71	300014	亿纬锂能	47,200	4,602,000.00	0.37
72	600563	法拉电子	21,700	4,451,972.00	0.36
73	601668	中国建筑	810,662	4,312,721.84	0.35
74	601699	潞安环能	292,900	4,282,198.00	0.34
75	300395	菲利华	94,450	4,250,250.00	0.34
76	300896	爱美客	7,000	4,200,070.00	0.34
77	600499	科达制造	201,400	4,156,896.00	0.33
78	002176	江特电机	163,500	4,094,040.00	0.33
79	600884	杉杉股份	136,400	4,053,808.00	0.32
80	002714	牧原股份	72,800	4,023,656.00	0.32
81	601615	明阳智能	113,100	3,822,780.00	0.31
82	002001	新和成	166,048	3,787,554.88	0.30
83	002709	天赐材料	60,100	3,729,806.00	0.30
84	300327	中颖电子	74,780	3,724,791.80	0.30
85	002311	海大集团	61,800	3,708,618.00	0.30
86	600436	片仔癀	10,200	3,638,646.00	0.29
87	002466	天齐锂业	28,700	3,581,760.00	0.29
88	002244	滨江集团	412,600	3,568,990.00	0.29
89	600141	兴发集团	81,123	3,568,600.77	0.29
90	000893	亚钾国际	102,400	3,523,584.00	0.28
91	002353	杰瑞股份	87,200	3,514,160.00	0.28
92	002430	杭氧股份	111,743	3,493,086.18	0.28
93	002402	和而泰	181,200	3,453,672.00	0.28
94	002812	恩捷股份	13,783	3,451,952.35	0.28
95	603713	密尔克卫	25,200	3,444,840.00	0.28
96	000963	华东医药	76,100	3,436,676.00	0.28
97	300015	爱尔眼科	75,200	3,366,704.00	0.27
98	300316	晶盛机电	49,754	3,362,872.86	0.27
99	002371	北方华创	12,077	3,346,778.24	0.27
100	601658	邮储银行	607,400	3,273,886.00	0.26
101	603259	药明康德	31,048	3,228,681.52	0.26
102	300596	利安隆	73,000	3,220,030.00	0.26
103	002821	凯莱英	11,100	3,207,900.00	0.26
104	300638	广和通	120,050	3,180,124.50	0.25
105	000498	山东路桥	314,700	3,040,002.00	0.24
106	300037	新宙邦	57,680	3,031,660.80	0.24

107	603885	吉祥航空	168,500	3,031,315.00	0.24
108	002352	顺丰控股	54,100	3,019,321.00	0.24
109	603267	鸿远电子	22,420	3,011,678.60	0.24
110	601799	星宇股份	17,600	3,009,600.00	0.24
111	000519	中兵红箭	102,600	2,990,790.00	0.24
112	002129	TCL 中环	50,300	2,962,167.00	0.24
113	300260	新莱应材	58,000	2,950,460.00	0.24
114	600754	锦江酒店	46,800	2,943,720.00	0.24
115	600765	中航重机	91,000	2,928,380.00	0.23
116	600233	圆通速递	142,500	2,905,575.00	0.23
117	600111	北方稀土	82,100	2,886,636.00	0.23
118	000999	华润三九	64,100	2,884,500.00	0.23
119	600741	华域汽车	125,100	2,877,300.00	0.23
120	002597	金禾实业	63,700	2,760,121.00	0.22
121	002407	多氟多	55,700	2,724,287.00	0.22
122	002556	辉隆股份	228,400	2,672,280.00	0.21
123	600025	华能水电	380,900	2,662,491.00	0.21
124	601677	明泰铝业	111,560	2,655,128.00	0.21
125	002056	横店东磁	96,100	2,558,182.00	0.20
126	603179	新泉股份	87,330	2,532,570.00	0.20
127	600522	中天科技	107,700	2,487,870.00	0.20
128	002192	融捷股份	16,100	2,474,570.00	0.20
129	600195	中牧股份	197,300	2,418,898.00	0.19
130	002410	广联达	43,400	2,362,696.00	0.19
131	300568	星源材质	76,900	2,233,176.00	0.18
132	000933	神火股份	167,500	2,190,900.00	0.18
133	601021	春秋航空	37,400	2,182,290.00	0.17
134	600096	云天化	69,200	2,178,416.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	14,601	2,171,168.70	0.17
136	600176	中国巨石	124,100	2,160,581.00	0.17
137	002245	蔚蓝锂芯	91,000	2,112,110.00	0.17
138	002884	凌霄泵业	101,040	2,070,309.60	0.17
139	600348	华阳股份	131,200	2,028,352.00	0.16
140	300763	锦浪科技	9,450	2,012,850.00	0.16
141	600406	国电南瑞	72,648	1,961,496.00	0.16
142	300639	凯普生物	91,650	1,959,477.00	0.16
143	600206	有研新材	101,200	1,957,208.00	0.16
144	300073	当升科技	21,600	1,951,344.00	0.16
145	002539	云图控股	120,500	1,926,795.00	0.15
146	603659	璞泰来	22,100	1,865,240.00	0.15
147	600460	士兰微	35,600	1,851,200.00	0.15
148	002041	登海种业	87,250	1,840,102.50	0.15

149	000625	长安汽车	106,210	1,839,557.20	0.15
150	600309	万华化学	18,800	1,823,412.00	0.15
151	600153	建发股份	137,400	1,795,818.00	0.14
152	002738	中矿资源	18,820	1,742,920.20	0.14
153	600389	江山股份	28,600	1,736,878.00	0.14
154	000818	航锦科技	50,900	1,725,510.00	0.14
155	600596	新安股份	79,300	1,716,845.00	0.14
156	002643	万润股份	80,800	1,685,488.00	0.14
157	002240	盛新锂能	27,800	1,678,008.00	0.13
158	603290	斯达半导	4,300	1,659,370.00	0.13
159	000338	潍柴动力	129,400	1,613,618.00	0.13
160	002832	比音勒芬	62,900	1,585,080.00	0.13
161	600660	福耀玻璃	35,600	1,488,436.00	0.12
162	002472	双环传动	46,700	1,486,928.00	0.12
163	000683	远兴能源	140,100	1,472,451.00	0.12
164	300012	华测检测	63,000	1,462,230.00	0.12
165	000408	藏格矿业	44,200	1,455,948.00	0.12
166	600763	通策医疗	8,100	1,412,964.00	0.11
167	688599	天合光能	21,512	1,403,658.00	0.11
168	600882	妙可蓝多	29,300	1,371,240.00	0.11
169	300776	帝尔激光	7,920	1,368,576.00	0.11
170	002906	华阳集团	29,800	1,350,238.00	0.11
171	002008	大族激光	40,300	1,335,139.00	0.11
172	600285	羚锐制药	105,900	1,326,927.00	0.11
173	601633	长城汽车	35,800	1,326,032.00	0.11
174	688005	容百科技	10,200	1,320,288.00	0.11
175	603008	喜临门	35,100	1,288,170.00	0.10
176	600760	中航沈飞	21,200	1,281,540.00	0.10
177	601006	大秦铁路	194,200	1,279,778.00	0.10
178	688297	中无人机	23,912	1,271,640.16	0.10
179	002050	三花智控	46,169	1,268,724.12	0.10
180	300687	赛意信息	55,160	1,267,025.20	0.10
181	000799	酒鬼酒	6,700	1,244,927.00	0.10
182	603816	顾家家居	21,880	1,239,064.40	0.10
183	603833	欧派家居	8,100	1,220,508.00	0.10
184	002318	久立特材	73,900	1,181,661.00	0.09
185	002396	星网锐捷	51,700	1,170,488.00	0.09
186	002572	索菲亚	42,300	1,163,250.00	0.09
187	600057	厦门象屿	131,900	1,159,401.00	0.09
188	000988	华工科技	49,700	1,151,549.00	0.09
189	603345	安井食品	6,600	1,107,942.00	0.09
190	600801	华新水泥	56,600	1,104,266.00	0.09

191	600039	四川路桥	104,700	1,102,491.00	0.09
192	002475	立讯精密	32,100	1,084,659.00	0.09
193	300751	迈为股份	2,200	1,079,980.00	0.09
194	300124	汇川技术	16,350	1,076,974.50	0.09
195	300593	新雷能	25,620	1,063,486.20	0.09
196	002241	歌尔股份	31,600	1,061,760.00	0.09
197	603369	今世缘	20,700	1,055,700.00	0.08
198	000333	美的集团	17,300	1,044,747.00	0.08
199	600378	昊华科技	26,700	1,028,484.00	0.08
200	600690	海尔智家	36,000	988,560.00	0.08
201	000830	鲁西化工	57,000	985,530.00	0.08
202	603939	益丰药房	18,600	982,638.00	0.08
203	002003	伟星股份	100,360	953,420.00	0.08
204	300498	温氏股份	44,000	936,760.00	0.08
205	601311	骆驼股份	83,900	933,807.00	0.07
206	300666	江丰电子	15,200	927,200.00	0.07
207	600845	宝信软件	16,800	917,280.00	0.07
208	300595	欧普康视	15,800	903,602.00	0.07
209	002028	思源电气	24,800	884,368.00	0.07
210	600893	航发动力	19,400	882,894.00	0.07
211	603127	昭衍新药	7,700	876,260.00	0.07
212	300034	钢研高纳	20,700	873,126.00	0.07
213	300604	长川科技	18,900	853,335.00	0.07
214	300054	鼎龙股份	39,200	829,864.00	0.07
215	600350	山东高速	150,200	788,550.00	0.06
216	688047	龙芯中科	8,345	768,991.75	0.06
217	300529	健帆生物	14,900	758,261.00	0.06
218	603855	华荣股份	29,600	754,800.00	0.06
219	603279	景津装备	24,120	747,961.20	0.06
220	603986	兆易创新	5,200	739,492.00	0.06
221	600507	方大特钢	105,700	738,843.00	0.06
222	002932	明德生物	10,728	735,511.68	0.06
223	688122	西部超导	7,800	719,160.00	0.06
224	300035	中科电气	24,500	684,775.00	0.05
225	300087	荃银高科	39,750	654,285.00	0.05
226	000762	西藏矿业	11,600	648,788.00	0.05
227	300775	三角防务	13,400	645,210.00	0.05
228	300662	科锐国际	12,400	643,436.00	0.05
229	002409	雅克科技	11,400	632,814.00	0.05
230	600132	重庆啤酒	4,200	615,720.00	0.05
231	600371	万向德农	45,900	612,765.00	0.05
232	000807	云铝股份	61,700	609,596.00	0.05

233	603260	合盛硅业	5,100	601,596.00	0.05
234	300737	科顺股份	45,200	595,736.00	0.05
235	000921	海信家电	41,900	594,142.00	0.05
236	600329	达仁堂	23,900	587,462.00	0.05
237	601985	中国核电	84,500	579,670.00	0.05
238	002304	洋河股份	3,000	549,450.00	0.04
239	002507	涪陵榨菜	15,700	541,964.00	0.04
240	603599	广信股份	18,760	528,094.00	0.04
241	002043	兔宝宝	45,500	527,800.00	0.04
242	000768	中航西飞	17,400	527,046.00	0.04
243	002568	百润股份	17,500	525,700.00	0.04
244	300394	天孚通信	19,400	525,158.00	0.04
245	002895	川恒股份	15,400	520,674.00	0.04
246	000998	隆平高科	31,000	516,460.00	0.04
247	002254	泰和新材	30,600	512,550.00	0.04
248	002384	东山精密	21,900	502,167.00	0.04
249	601877	正泰电器	13,700	490,186.00	0.04
250	002508	老板电器	13,400	482,802.00	0.04
251	688220	翱捷科技	6,947	476,494.73	0.04
252	002100	天康生物	47,800	464,616.00	0.04
253	300083	创世纪	39,400	453,100.00	0.04
254	300138	晨光生物	29,100	453,087.00	0.04
255	688234	天岳先进	6,759	440,619.21	0.04
256	000902	新洋丰	26,000	439,140.00	0.04
257	601952	苏垦农发	29,900	418,301.00	0.03
258	002677	浙江美大	28,500	418,095.00	0.03
259	002032	苏泊尔	7,200	405,648.00	0.03
260	601636	旗滨集团	31,400	400,350.00	0.03
261	000831	五矿稀土	12,800	400,000.00	0.03
262	600976	健民集团	7,800	398,970.00	0.03
263	300223	北京君正	3,700	393,125.00	0.03
264	002293	罗莱生活	29,300	385,881.00	0.03
265	688279	峰昭科技	5,505	370,706.70	0.03
266	002645	华宏科技	16,300	355,666.00	0.03
267	601965	中国汽研	21,800	353,378.00	0.03
268	002850	科达利	2,200	349,800.00	0.03
269	600862	中航高科	12,384	347,990.40	0.03
270	603501	韦尔股份	1,994	345,021.82	0.03
271	002415	海康威视	9,400	340,280.00	0.03
272	000786	北新建材	9,700	335,814.00	0.03
273	002918	蒙娜丽莎	17,600	329,472.00	0.03
274	603392	万泰生物	2,120	329,236.00	0.03

275	603995	甬金股份	9,585	322,631.10	0.03
276	688516	奥特维	1,200	320,340.00	0.03
277	000708	中信特钢	15,700	316,355.00	0.03
278	603288	海天味业	3,500	316,260.00	0.03
279	002791	坚朗五金	2,400	311,328.00	0.02
280	601898	中煤能源	29,700	308,286.00	0.02
281	601888	中国中免	1,300	302,809.00	0.02
282	002867	周大生	19,300	299,729.00	0.02
283	605399	晨光新材	7,020	298,701.00	0.02
284	600487	亨通光电	20,500	298,070.00	0.02
285	688119	中钢洛耐	33,327	293,944.14	0.02
286	600018	上港集团	49,700	289,751.00	0.02
287	002555	三七互娱	13,600	288,728.00	0.02
288	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.02
289	002091	江苏国泰	26,600	285,950.00	0.02
290	600236	桂冠电力	45,700	278,313.00	0.02
291	300438	鹏辉能源	4,500	276,525.00	0.02
292	601669	中国电建	34,800	273,876.00	0.02
293	600585	海螺水泥	7,500	264,600.00	0.02
294	002126	银轮股份	21,800	249,610.00	0.02
295	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.02
296	600926	杭州银行	16,000	239,680.00	0.02
297	300567	精测电子	5,400	233,280.00	0.02
298	002557	洽洽食品	4,000	227,720.00	0.02
299	688390	固德威	700	219,107.00	0.02
300	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.02
301	603712	七一二	6,800	214,200.00	0.02
302	600066	宇通客车	24,700	213,655.00	0.02
303	301112	信邦智能	3,984	213,281.76	0.02
304	600750	江中药业	14,600	209,072.00	0.02
305	600422	昆药集团	17,200	208,980.00	0.02
306	002138	顺络电子	7,300	198,925.00	0.02
307	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.02
308	603987	康德莱	9,700	193,321.00	0.02
309	603197	保隆科技	3,800	186,922.00	0.01
310	301286	侨源股份	7,839	176,722.11	0.01
311	603520	司太立	6,160	173,219.20	0.01
312	300146	汤臣倍健	8,000	173,200.00	0.01
313	600383	金地集团	12,400	166,656.00	0.01
314	600885	宏发股份	3,640	152,334.00	0.01
315	300470	中密控股	4,300	151,747.00	0.01
316	000738	航发控制	5,000	140,500.00	0.01

317	301259	艾布鲁	4,828	139,789.02	0.01
318	002128	电投能源	8,800	126,016.00	0.01
319	002182	云海金属	4,900	122,892.00	0.01
320	301220	亚香股份	2,849	121,230.27	0.01
321	300777	中简科技	2,500	120,500.00	0.01
322	300415	伊之密	6,400	116,672.00	0.01
323	600989	宝丰能源	7,900	115,735.00	0.01
324	600875	东方电气	7,000	115,150.00	0.01
325	300748	金力永磁	3,100	114,080.00	0.01
326	300821	东岳硅材	6,200	113,956.00	0.01
327	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.01
328	600779	水井坊	1,200	111,048.00	0.01
329	002405	四维图新	7,200	108,504.00	0.01
330	688363	华熙生物	738	104,928.84	0.01
331	002624	完美世界	7,200	103,464.00	0.01
332	000657	中钨高新	6,800	102,000.00	0.01
332	603313	梦百合	8,500	102,000.00	0.01
333	600219	南山铝业	27,600	101,844.00	0.01
334	688116	天奈科技	600	101,688.00	0.01
335	603707	健友股份	3,600	101,520.00	0.01
336	300101	振芯科技	4,900	101,136.00	0.01
337	002327	富安娜	12,500	99,375.00	0.01
338	002074	国轩高科	2,100	95,760.00	0.01
339	002833	弘亚数控	5,488	91,539.84	0.01
340	300354	东华测试	2,800	90,020.00	0.01
341	300233	金城医药	3,100	88,443.00	0.01
342	000723	美锦能源	7,100	86,620.00	0.01
343	300502	新易盛	3,000	78,600.00	0.01
344	002158	汉钟精机	3,200	74,400.00	0.01
345	603063	禾望电气	1,900	73,055.00	0.01
346	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.01
347	603100	川仪股份	3,200	56,448.00	0.00
348	301217	铜冠铜箔	3,764	55,820.12	0.00
349	002036	联创电子	3,600	55,296.00	0.00
350	000596	古井贡酒	200	49,932.00	0.00
351	301200	大族数控	851	44,183.92	0.00
352	301236	软通动力	1,359	42,645.42	0.00
353	603128	华贸物流	3,900	39,117.00	0.00
354	603444	吉比特	100	38,800.00	0.00
355	002230	科大讯飞	900	37,098.00	0.00
356	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
357	301219	腾远钴业	410	36,006.20	0.00

358	600456	宝钛股份	600	35,640.00	0.00
359	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
360	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
361	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
362	000039	中集集团	2,200	30,470.00	0.00
363	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
364	300618	寒锐钴业	500	28,960.00	0.00
365	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
366	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
367	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
368	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
369	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
370	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
371	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
372	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
373	603489	八方股份	100	19,449.00	0.00
374	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
375	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
376	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
377	301279	金道科技	756	18,357.56	0.00
378	301221	光庭信息	280	18,152.40	0.00
379	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
380	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
381	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
382	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
383	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
384	002545	东方铁塔	1,400	15,932.00	0.00
385	300573	兴齐眼药	100	15,332.00	0.00
386	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
387	603026	石大胜华	100	14,535.00	0.00
388	300759	康龙化成	150	14,283.00	0.00
389	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
390	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
391	603979	金诚信	700	13,517.00	0.00
392	603198	迎驾贡酒	200	13,028.00	0.00
393	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
394	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
395	301163	宏德股份	364	12,210.08	0.00
396	600248	陕西建工	2,200	11,946.00	0.00
397	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
398	601618	中国中冶	3,300	11,550.00	0.00
399	300347	泰格医药	100	11,445.00	0.00

400	603129	春风动力	100	11,372.00	0.00
401	300122	智飞生物	100	11,101.00	0.00
402	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
403	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
404	301135	瑞德智能	376	9,966.48	0.00
405	300274	阳光电源	100	9,825.00	0.00
406	601390	中国中铁	1,600	9,824.00	0.00
407	300033	同花顺	100	9,615.00	0.00
408	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
409	300487	蓝晓科技	150	9,150.00	0.00
410	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
411	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
412	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
413	601800	中国交建	900	8,352.00	0.00
414	002531	天顺风能	500	8,245.00	0.00
415	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
416	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
417	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
418	002959	小熊电器	100	6,233.00	0.00
419	300726	宏达电子	100	6,117.00	0.00
420	603517	绝味食品	100	5,782.00	0.00
421	603899	晨光股份	100	5,608.00	0.00
422	601186	中国铁建	700	5,530.00	0.00
423	600298	安琪酵母	100	4,875.00	0.00
424	601318	中国平安	100	4,669.00	0.00
425	002876	三利谱	100	4,002.00	0.00
426	601865	福莱特	100	3,810.00	0.00
427	688396	华润微	62	3,662.34	0.00
428	300285	国瓷材料	100	3,592.00	0.00
429	603098	森特股份	100	3,586.00	0.00
430	300630	普利制药	100	3,515.00	0.00
431	603568	伟明环保	100	3,337.00	0.00
432	300655	晶瑞电材	169	3,261.70	0.00
433	300207	欣旺达	100	3,160.00	0.00
434	300408	三环集团	100	3,010.00	0.00
435	000977	浪潮信息	100	2,648.00	0.00
436	002851	麦格米特	100	2,626.00	0.00
437	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.00
438	000063	中兴通讯	100	2,553.00	0.00
439	002891	中宠股份	100	2,542.00	0.00
440	603218	日月股份	100	2,540.00	0.00
441	300623	捷捷微电	100	2,480.00	0.00

442	600703	三安光电	100	2,458.00	0.00
442	603681	永冠新材	100	2,458.00	0.00
443	300480	光力科技	130	2,332.20	0.00
444	688099	晶晨股份	23	2,323.00	0.00
445	002705	新宝股份	100	2,199.00	0.00
446	600588	用友网络	100	2,171.00	0.00
447	000739	普洛药业	100	2,064.00	0.00
448	000002	万 科 A	100	2,050.00	0.00
449	002601	龙佰集团	100	2,005.00	0.00
450	000400	许继电气	100	1,920.00	0.00
451	002299	圣农发展	100	1,918.00	0.00
452	000636	风华高科	100	1,879.00	0.00
453	000776	广发证券	100	1,870.00	0.00
454	300476	胜宏科技	100	1,836.00	0.00
455	000887	中鼎股份	100	1,824.00	0.00
456	600362	江西铜业	100	1,783.00	0.00
457	002281	光迅科技	100	1,758.00	0.00
458	300119	瑞普生物	100	1,749.00	0.00
459	688779	长远锂科	86	1,720.00	0.00
460	002048	宁波华翔	100	1,602.00	0.00
461	000001	平安银行	100	1,498.00	0.00
462	002324	普利特	100	1,448.00	0.00
463	600483	福能股份	100	1,407.00	0.00
464	002019	亿帆医药	100	1,398.00	0.00
465	600452	涪陵电力	120	1,393.20	0.00
466	001979	招商蛇口	100	1,343.00	0.00
467	603806	福斯特	20	1,310.40	0.00
468	002013	中航机电	100	1,235.00	0.00
469	002078	太阳纸业	100	1,231.00	0.00
470	601168	西部矿业	100	1,183.00	0.00
471	603588	高能环境	100	1,153.00	0.00
472	000878	云南铜业	100	1,139.00	0.00
473	601058	赛轮轮胎	100	1,127.00	0.00
474	603300	华铁应急	140	1,115.80	0.00
475	600116	三峡水利	100	1,004.00	0.00
476	600970	中材国际	100	969.00	0.00
477	601369	陕鼓动力	100	960.00	0.00
478	600888	新疆众和	100	920.00	0.00
479	002340	格林美	100	910.00	0.00
480	600377	宁沪高速	100	857.00	0.00
481	002064	华峰化学	100	844.00	0.00
482	000591	太阳能	100	835.00	0.00

482	601222	林洋能源	100	835.00	0.00
483	002385	大北农	100	781.00	0.00
484	601128	常熟银行	100	764.00	0.00
485	600516	方大炭素	100	760.00	0.00
486	600919	江苏银行	100	712.00	0.00
487	000875	吉电股份	100	695.00	0.00
488	300215	电科院	100	687.00	0.00
489	002027	分众传媒	100	673.00	0.00
490	002110	三钢闽光	100	609.00	0.00
491	601939	建设银行	100	606.00	0.00
492	600019	宝钢股份	100	602.00	0.00
493	002563	森马服饰	100	592.00	0.00
494	002035	华帝股份	100	582.00	0.00
495	000825	太钢不锈	100	545.00	0.00
496	000932	华菱钢铁	100	509.00	0.00
497	600782	新钢股份	100	504.00	0.00
498	601328	交通银行	100	498.00	0.00
499	000778	新兴铸管	100	482.00	0.00
500	600795	国电电力	100	391.00	0.00
501	601598	中国外运	100	388.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600048	保利发展	25,652,631.99	1.68
2	600383	金地集团	22,611,660.04	1.48
3	601658	邮储银行	17,759,461.00	1.16
4	002142	宁波银行	17,315,448.36	1.14
5	601985	中国核电	16,188,206.00	1.06
6	002594	比亚迪	15,241,717.04	1.00
7	601166	兴业银行	13,977,029.00	0.92
8	601009	南京银行	13,309,882.59	0.87
9	600887	伊利股份	12,968,982.84	0.85
10	688099	晶晨股份	12,248,072.97	0.80
11	001979	招商蛇口	12,205,960.00	0.80
12	601838	成都银行	12,075,660.96	0.79
13	600188	兖矿能源	10,170,700.37	0.67
14	601012	隆基绿能	9,869,819.60	0.65
15	000002	万科 A	9,758,408.00	0.64
16	600900	长江电力	9,753,497.00	0.64
17	600873	梅花生物	9,361,591.72	0.61

18	300059	东方财富	9,208,617.97	0.60
19	601088	中国神华	8,708,684.00	0.57
20	600803	新奥股份	8,702,910.99	0.57

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	300750	宁德时代	25,532,800.36	1.67
2	600383	金地集团	19,417,401.20	1.27
3	300327	中颖电子	18,978,150.61	1.24
4	601985	中国核电	15,162,640.00	0.99
5	300059	东方财富	13,761,595.00	0.90
6	002138	顺络电子	13,589,416.88	0.89
7	300124	汇川技术	13,428,142.50	0.88
8	601012	隆基绿能	13,107,224.60	0.86
9	601658	邮储银行	12,798,044.00	0.84
10	600563	法拉电子	12,439,961.00	0.82
11	002371	北方华创	12,398,108.03	0.81
12	600885	宏发股份	12,039,263.00	0.79
13	002460	赣锋锂业	11,771,754.00	0.77
14	300363	博腾股份	11,463,573.69	0.75
15	603588	高能环境	11,122,283.24	0.73
16	600406	国电南瑞	10,983,557.00	0.72
17	002821	凯莱英	10,840,669.00	0.71
18	600900	长江电力	10,624,068.48	0.70
19	001979	招商蛇口	10,156,602.00	0.67
20	000858	五粮液	9,985,542.82	0.65

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,118,998,914.52
卖出股票收入（成交）总额	1,185,199,856.98

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	61,736,641.37	4.95
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,736,641.37	4.95

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	220001	22 附息国债 01	500,000	50,566,164.38	4.05
2	019658	21 国债 10	40,000	4,076,197.26	0.33
3	019666	22 国债 01	40,000	4,044,893.15	0.32
4	019664	21 国债 16	30,000	3,049,386.58	0.24

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，符合既定的投资政策和投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,277,443.40
2	应收清算款	21,168,189.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	162,504.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,608,137.62

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
26,194	41,716.95	98,814.23	0.01	1,092,634,922.80	99.99

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	178,658.24	0.02

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研部	10~50

门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 6 月 9 日）基金份额总额	16,549,730,858.05
本报告期期初基金份额总额	1,149,490,312.60
本报告期基金总申购份额	8,674,608.69
减：本报告期基金总赎回份额	65,431,184.26
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,092,733,737.03

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

2022 年 5 月 12 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》，龚康先生因工作分工不再担任公司副总经理职务，转任嘉实资本管理有限公司总经理。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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，本基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对公司及相关人员采取

行政监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

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 (%)	
国盛证券有限责任公司	2	661,308,521.85	28.99	417,484.53	27.79	-
长江证券股份有限公司	3	485,985,854.72	21.31	340,192.01	22.65	-
东方证券股份有限公司	2	415,628,264.04	18.22	262,385.31	17.47	-
东方财富证券股份有限公司	2	264,480,273.79	11.60	166,965.50	11.11	-
中国银河证券股份有限公司	1	163,928,629.27	7.19	114,750.06	7.64	-
浙商证券股份有限公司	2	127,538,272.60	5.59	87,011.95	5.79	-
中国国际金融股份有限公司	2	92,299,538.00	4.05	64,609.53	4.30	-
中信证券股份有限公司	4	39,039,614.11	1.71	27,327.75	1.82	-
中信建投证券股份有限公司	3	30,647,611.74	1.34	21,453.33	1.43	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

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	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股份有限	1	-	-	-	-	-

公司						
申万宏源 证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
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，华金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 (%)

国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
长江证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	21,026,799.00	77.77	60,000,000.00	100.00	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券 股份有限 公司	6,009,152.00	22.23	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 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	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
广发证券 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	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 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	-	-	-	-	-	-
华金证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
开源证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中泰证券 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	2022年5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事件驱动股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实事件驱动股票型证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实事件驱动股票型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2022 年 8 月 29 日