

# 嘉实新财富灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实新财富混合
基金主代码	002211
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 3 月 14 日
报告期末基金份额总额	2,538,000,874.96 份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过优化大类资产配置和选择高安全边际的证券，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将从宏观面、政策面、基本面和资金面等四个角度进行综合分析，在控制风险的前提下，合理确定本基金在股票、债券、现金等各类资产类别的投资比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。 具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	沪深 300*50%+中债总指数*50%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于较高风险、较高收益的品种。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 10 月 1 日-2022 年 12 月 31 日）
1. 本期已实现收益	-38,745,833.91
2. 本期利润	74,172,090.97
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0302
4. 期末基金资产净值	2,562,367,601.31
5. 期末基金份额净值	1.010

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。

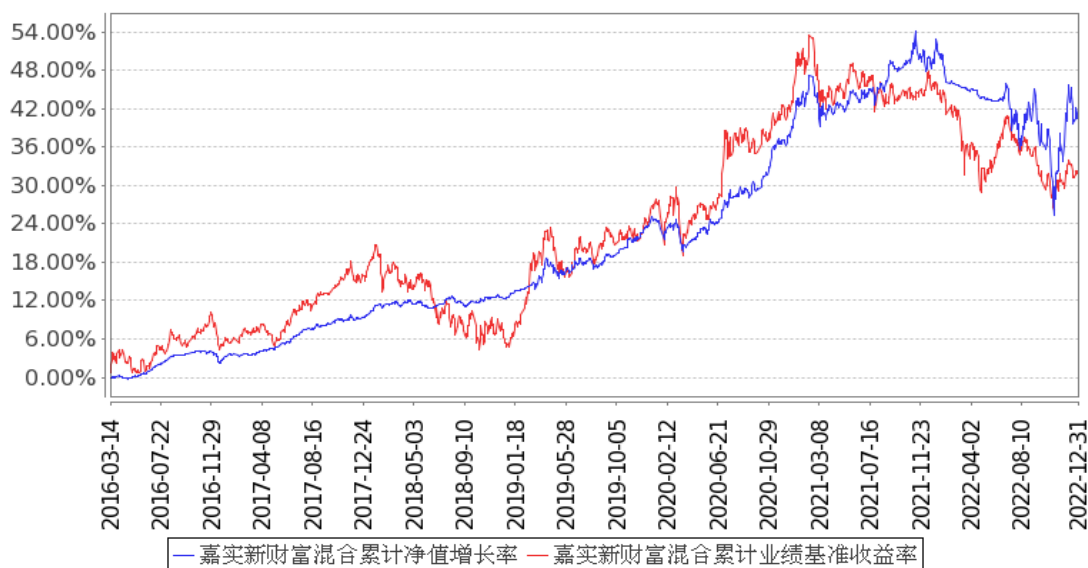
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.99%	1.21%	1.14%	0.63%	1.85%	0.58%
过去六个月	-3.43%	1.08%	-6.06%	0.54%	2.63%	0.54%
过去一年	-7.79%	0.79%	-9.53%	0.64%	1.74%	0.15%
过去三年	13.20%	0.55%	4.84%	0.64%	8.36%	-0.09%
过去五年	28.72%	0.45%	14.29%	0.64%	14.43%	-0.19%
自基金合同 生效起至今	40.95%	0.38%	32.17%	0.58%	8.78%	-0.20%

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

嘉实新财富混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2016年03月14日至2022年12月31日)



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

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖觅	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实周期优选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实物流产业股票、嘉实基础产业优选股票、嘉实核心蓝筹混合、嘉	2022年5月26日	-	13年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司任职于研究部，先后任钢铁行业、交通运输行业研究员等职位，现任大周期研究总监。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

	实品质蓝筹一年持有期混合基金经理				
李欣	本基金、嘉实金融精选股票基金经理	2022 年 5 月 26 日	-	11 年	曾任普华永道高级精算师、中国国际金融有限公司研究员、海通证券股份有限公司高级分析师。2014 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司研究部，任研究员。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
颜伟鹏	本基金、嘉实产业领先混合基金经理	2021 年 10 月 22 日	2022 年 10 月 28 日	11 年	曾任上海申银万国证券研究所、交银施罗德基金、农银汇理基金管理有限公司投研部分析师。2021 年 3 月加入嘉实基金管理有限公司任职于股票投研部。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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。

#### 4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
肖觅	公募基金	8	11,103,331,164.47	2016 年 12 月 29 日
	私募资产管理计划	1	566,913,866.06	2022 年 3 月 24 日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	11,670,245,030.53	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，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 9 次，均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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2022 年中国权益市场有比较明显的下跌，中证 800 全年下跌 21.3%，恒生指数全年下跌 15.5%。海外市场也表现不佳，标普 500 全年下跌 19.4%，美国市场也在长牛后出现了明显的回调，日经 225 跌 9.4%，法国、德国市场也有 10%左右的跌幅。回顾 2022 年的权益市场，很快会突显两个问题，一是全球市场虽然都在下跌，但下跌的核心驱动力并不相同；二是中国权益市场年内的走势，在结构上和节奏上呈现出比较明显的分化和波动。前一个问题上，美国市场最敏感的定价因子来自于美联储的货币政策，当然这一点多多少少对全球权益市场的定价都有影响；欧洲市场则是受到了地缘冲突的冲击；中国市场则非常突出了体现了不同的社会经济环境下投资者信心的巨大波动。后一个问题上，和 2018 年基本上所有行业都走出了单边下跌的行情不同，2022 年部分传统行业遇到了供给冲击，基本面颇有亮点；部分行业在政策环境剧烈变化下股价出现巨大的波动；部分行业在投资者非常一致的强烈乐观预期下表现得相当稳健。因为这种分化和波动的存在，2022 年公募基金业绩方面也就对应出现了较大的分化，我们的低波动权益框架比较幸运的相对适应这种市场环境，虽然不可避免的还是有一些遗憾，但相对市场指数还是取得了一定的超额收益。

回到中国市场体现的投资者信心巨大波动这个问题上，我们在前几次季报中反复提到了，短期看各行业的基本面确实遇到了明显的压力，这种压力持续相当长一段时间后就一定程度上被投资者线性外推，相当多的行业似乎看不到改善出现的明确前景，包括海外投资者在内的大部分人的理性选择就是降低权益资产的配置权重，一言概之就是对中国经济的信心有所动摇，市场也随之出现了较大跌幅。但我们也同样强调，我们对中国经济的信心仍然不变，我们坚信中国人民极强的适应能力和主观能动性，相关行业的相关主体会主动采取行动去改变现在的不利状况，权益投资者会看到非线性的正向改变，所以，在面向未来的视角下，对权益市场也没有必要继续悲观。事实上，我们没有能力预计到的是，这种非线性的正向改变出现得如此迅速、如此激烈：时间进

入到 2022 年的最后两个月，正好在三季度季报刚刚披露之后，我们突然发现在导致市场信心动摇的最重要的几个点上，这种正向的非线性变化就这样毫无准备的出现了。首当其冲的是疫情防控思路的转向，大部分行业，尤其是线下服务相关的行业，终于能够重回正常的生产经营环境；其次是房地产也在供给端出现了一揽子的旨在保护诚信开发商主体的支持性政策，解决了民营企业甚至是部分国企的生存问题，宏观经济最大的下行风险得到了有效控制；另一点非常重要的是对民营企业和平台经济定位的表述也发生了细微但重要的变化，市场对民营经济开始重新建立信心。这几个点涉及到的是市场对长期特别重要的两个慢变量（中国特色社会主义市场经济的独特制度优势、中国资产负债表底层基础资产的扎实程度）的信心，看到这些改变后，市场中长期的信心快速得到修复，对应市场也出现了一轮非常可观的反弹。结构上，信心更脆弱的港股市场在这种修复过程中也体现出了更强的上行风险，同时不同行业之间也仍然体现出了相当大的分化。

最后两个月的这种快速反弹主要来自于市场信心的修复，实际上从基本面来看，大部分行业的基本面还没有看到显著的改变，预期走在现实的前面，呈现出所谓“强预期弱现实”的状态。到现在这个时间点，有必要审视一下市场的这种反应是否合理，是否又有一些过度乐观？去看基本面仍然有问题的几个重点行业：房地产供给端的问题已经得到解决，主要是需求端没有看到显著的复苏；出口在连续景气之后增速出现下行，主要是海外经济开始在通胀压力过大的情况下出现收缩；前期影响较大的能源价格仍然较为胶着，并没有快速降下来缓解各行各业的压力。这几个问题评估下来我们更倾向于来自于需求没有充分恢复，但需求是一个会有波动的中短期周期性变量，重要性远远不如市场信心的恢复，这一轮反弹应该还是有相当合理性的。

展望 2023 年，还会有正面变化来自于什么地方？消费复苏是比较容易看到、最具确定性会出现正面复苏的板块。但其中不同子行业我们觉得前景和机会的程度是不同的，出行链看总量不一定能恢复到疫情前，疫情确实是改变了很多人的工作方式和习惯；餐饮链有可能会看到更快的复苏，除了市场已经关注到的餐饮业本身外，我们觉得更值得关注的反而应该是估值相对合理的食品饮料板块，尤其是其中可选的部分；地产链、汽车链的基本面快速修复的概率也很大，但需要额外考虑总量的问题，如果总量在快速恢复后仍然是收缩的，是否能避免总量层面的过剩加剧；而新兴消费，包括新兴场景消费和新兴品牌消费，是一直会有机会，需要持续挖掘的子版块。

另一个值得关注的有确定性的板块是工业服务业，在制造业景气仍然具有较大不确定性的情况下，市场主体之间的竞争一定会倒逼各个市场参与者不断提升产业链运营效率，以实现更低的成本或者交付更好的客户体验。如何提升运营效率？分工专业化是屡试不爽的工具，算是解决这个问题一个基本方法论。这一块涉及到的领域众多，在我们比较熟悉的领域中，物流和供应链

管理、企业数字孪生应该是两个相对比较确定的方向。其他比较确定的线索包括大安全、国企改革、职业教育等，此处不再详细展开。

除此之外，还需要考虑的仍然是还有没有一些可能出现非线性变化的地方？第一个领域可能在房地产。此前提到房地产已经解决了开发商主体的生存问题，伴随着一轮估值的修复，目前从绝对价值来看仍然有一定赔率，但这种赔率的实现需要真正基本面的改善：销售能够恢复。销售究竟能不能恢复？关于需求，尤其是这种总量级别的问题，总是很难在事先有准确的判断，但换个视角，经济增长的压力和财政的压力，在地方政府的级别是相当大的，而要缓解这两个压力，地产是地方政府的必答题，那么除了已经有的供给端的政策，需求端的政策在可预见的未来也会持续出现，甚至不排除中央层面也给出一些支持政策的可能性，直到销售恢复，拉动相关产业和财政收入回到可持续的水平。在这个视角下，销售恢复这件事虽然无法准确预判，但至少可以给出一个逻辑链条，可以期待在这一点上出现一些非线性变化。另外一个可能出现非线性变化的点可能是能源板块，对大多数传统能源来说，资本开支不足和各种因素带来的全球性的摩擦成本导致的供需最紧张的阶段基本已经过去了，在 2023 年上半年可能会迎来相对较宽松的时期，但在更长的维度可能会仍然维持偏紧状态，那么至少在 2023 年，能源价格、甚至是全球的通胀压力可能都会迎来一次非线性的变化，这种变化会对市场有比较大的影响。

我们在 2022 年持续践行低波动权益投资框架，遇到的挑战主要是市场进入了深度价值状态后，单一资产的波动率反而会上升，不太有利于波动率本身的控制。在我们港股占比相对较高的组合上体现得比较明显，波动控制的效果不能算非常理想。我们观察这个特征不仅仅是中国权益市场独有的，全球市场在这种情况下都会体现出波动率放大的特征，甚至波动率本身成了市场恐慌程度的一个表征。实际上 deep value 状态意味着相关资产失去了市场的关注度，流动性变得较差，反过来边际信息驱动的交易带来的波动率也就会较大。面对这种局面，从组合管理的角度，我们强调一是用行业层面的尽量分散去尽可能降低组合对单一行业基本面的风险敞口，二是要用低估值去对抗绝对回撤的风险。同时在这种状态下，我们也强调不应该机械的强调低波动，市场给出了非常好的长期配置机会，在市场的底部就应该向波动要收益，找到非线性变化的行业去获得超额回报。在 2022 年的最后两个月，对波动率的这种理解帮助我们港股占比较高的组合获得了一定的回报上的补偿。站在 2023 年年初的时间点去看，市场应该说接近回到了相对正常的状态，低波动权益投资的方法论可以以相对正常的节奏去运作，我们希望能在尽可能获得权益资产平均回报的情况下，把波动率降下来，提升持有人的持有体验。

具体到新财富这只基金，除了上述我们比较看好的方向外，本季度我们重点调整了能源板块内部的配置，开始重视电力行业的投资机会。整个能源行业当前面临的矛盾，不完全集中在以化



石能源为代表的传统一次能源因为资本开支长期不足带来的供需紧张这个问题上，目前看更急迫的需求在于电力体系的冬夏两峰的尖峰容量不足，这里的根本原因在于电力市场化体系没有理顺的情况下，有尖峰保障能力的火电在过去几年资本开支不足，产能上得不够。未来在容量电价、电力市场化交易等有利因素的加持下，电力企业的盈利能力有望看到系统性的提升，带来一次基本面驱动的机会。

另外，这一年下来从我们的理解来看，市场还有一点变化：因为市场的研究资源在相当多的板块和个股上已经相对过剩了，对部分行业基本面的定价非常充分，带有博弈属性的抢跑等交易行为反而成了关键的边际定价因子。而公募基金作为规模相当大的机构投资者是无法完全适应这种偏中短期的博弈的，那么要真正实现较好的长期复合回报，要么是改变方法论，不再考虑太多相对收益的问题，完全从预期回报和风险角度出发，用类似绝对收益的视角考虑组合构建，要么就需要在中长期真正创造足够的 alpha，找到并没有被充分定价的基本面变化，这是两个基本的思考方向。而真正创造足够的 alpha，需要的一是研究有足够深度的认知，在知识积累和投研转化上有很深的积淀，能够真正做到对基本面的前瞻领先判断；二是建立高质量信息体系，对政策、行业、公司各个层次和基本面相关的关键数据和公开信息，在完整的研究框架下有迅速而正确的应对。我们的低波动权益投资框架在一定程度上可以算是在第一个方向上做一些尝试，而嘉实现在研究体系就是为了在第二个方向上做到最好。我们还需要继续努力。

在这个时间点上，权益市场仍然有丰富的结构性机会，我们仍然希望能够在我们的方法论框架下，为持有人创造良好的持有体验，让持有人真正能够赚到市场给出的这种机会。对持有人我们也仍然建议用闲钱去投资，拉长持有期限，这样才能真正赚到基金经理所擅长的长期超额收益。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.010 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.99%，业绩比较基准收益率为 1.14%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,394,734,665.63	91.18
	其中：股票	2,394,734,665.63	91.18

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	132,289,673.97	5.04
	其中：债券	132,289,673.97	5.04
	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	98,420,927.86	3.75
8	其他资产	909,044.65	0.03
9	合计	2,626,354,312.11	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	73,710,184.60	2.88
C	制造业	540,768,351.60	21.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	372,983,177.40	14.56
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	30,112,292.07	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	623,549,232.42	24.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	368,720.56	0.01
J	金融业	411,716,925.57	16.07
K	房地产业	225,186,022.00	8.79
L	租赁和商务服务业	116,214,991.36	4.54
M	科学研究和技术服务业	52,566.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,394,734,665.63	93.46

### 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601155	新城控股	10,984,684	225,186,022.00	8.79
2	600919	江苏银行	26,096,800	190,245,672.00	7.42
3	002352	顺丰控股	3,154,036	182,177,119.36	7.11
4	601166	兴业银行	9,376,099	164,925,581.41	6.44
5	600803	新奥股份	8,048,866	129,586,742.60	5.06
6	600233	圆通速递	6,379,363	128,161,402.67	5.00
7	600057	厦门象屿	11,315,968	116,214,991.36	4.54
8	600886	国投电力	10,560,660	114,371,947.80	4.46
9	603369	今世缘	2,181,900	111,058,710.00	4.33
10	603517	绝味食品	1,605,613	98,086,898.17	3.83

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	132,289,673.97	5.16
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	132,289,673.97	5.16

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	210008	21 付息国债 08	1,300,000	132,289,673.97	5.16

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

无。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

无。

**5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

无。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

无。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责或/及处罚的情况。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资管理制度的相关规定。

**5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	908,844.94
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	199.71
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	909,044.65

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

#### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,453,756,703.82
报告期期间基金总申购份额	84,553,762.58
减：报告期期间基金总赎回份额	309,591.44
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,538,000,874.96

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	746,833.80
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	746,833.80
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.03

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	现金红利	2022-12-29	-	32,039.17	-
合计			-	32,039.17	

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2022-10-01 至 2022-12-31	729,089,217.86	30,876,532.51	-	759,965,750.37	29.94
	2	2022-10-01 至 2022-12-31	560,837,428.48	23,751,160.59	-	584,588,589.07	23.03
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

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

## 9.2 存放地点

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

## 9.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2023 年 1 月 20 日