嘉实新兴产业股票型证券投资基金
2020年年度报告

2020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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 23 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 其他指标 9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 9
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遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人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 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
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 15
§6 审计报告 15
6.1 审计报告基本信息 15
6.2 审计报告的基本内容 15
§7 年度财务报表 17
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 21

§8 投资组合报告 47

8.1 期末基金资产组合情况 47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 48
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 48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 51
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 54
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 54
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 54
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 54
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 54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
8.12 投资组合报告附注 55

§9 基金份额持有人信息 56

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
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 56

§10 开放式基金份额变动 56

§11 重大事件揭示 57

11.1 基金份额持有人大会决议 57
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 57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 57
11.4 基金投资策略的改变 57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
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 57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 57
11.8 其他重大事件 61

§12 备查文件目录 61

12.1 备查文件目录 61
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实新兴产业股票型证券投资基金
基金简称	嘉实新兴产业股票
基金主代码	000751
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 9 月 17 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,726,167,027.20 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，分享新兴产业带来的投资机会，力求获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金相对淡化宏观指标，从中观层面分析各行业和上市公司的不同特征,识别经济发展过程中具有良好发展前景、竞争结构相对稳定的行业，从中挑选具备卓越商业模式和较强竞争力的优质企业。本基金所指的新兴产业是指对经济社会全局和长远发展具有重大引领带动作用，知识技术密集、高附加值、低能耗、低污染、成长潜力大、综合效益好的产业。 具体投资策略包括：大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募投资策略、衍生品投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证新兴产业指数收益率×95%＋中国债券总指数收益率×5%
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	胡勇钦	秦一楠
	联系电话	(010)65215588	010-66060069
	电子邮箱	service@jsfund.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-600-8800	95599
传真		(010)65215588	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100005	100031
法定代表人	经雷	周慕冰

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	750,114,937.98	113,257,944.21	-79,538,094.03
本期利润	4,739,287,434.85	487,691,715.05	-153,461,513.72
加权平均基金份额本期利润	2.1843	1.2711	-0.4245
本期加权平均净值利润率	49.31%	49.66%	-20.76%
本期基金份额净值增长率	76.59%	76.74%	-20.15%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	2,828,485,490.30	512,416,298.68	112,982,661.50
期末可供分配基金份额利润	1.0375	0.6864	0.3569

期末基金资产净值	14,702,752,484.48	2,279,740,970.22	546,966,475.53
期末基金份额净值	5.393	3.054	1.728
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	439.30%	205.40%	72.80%

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	14.11%	1.39%	14.63%	1.21%	-0.52%	0.18%
过去六个月	23.95%	1.57%	24.22%	1.52%	-0.27%	0.05%
过去一年	76.59%	1.70%	44.45%	1.66%	32.14%	0.04%
过去三年	149.21%	1.55%	34.45%	1.49%	114.76%	0.06%
过去五年	237.91%	1.43%	22.55%	1.41%	215.36%	0.02%
自基金合同生效起至今	439.30%	1.56%	86.56%	1.68%	352.74%	-0.12%

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：

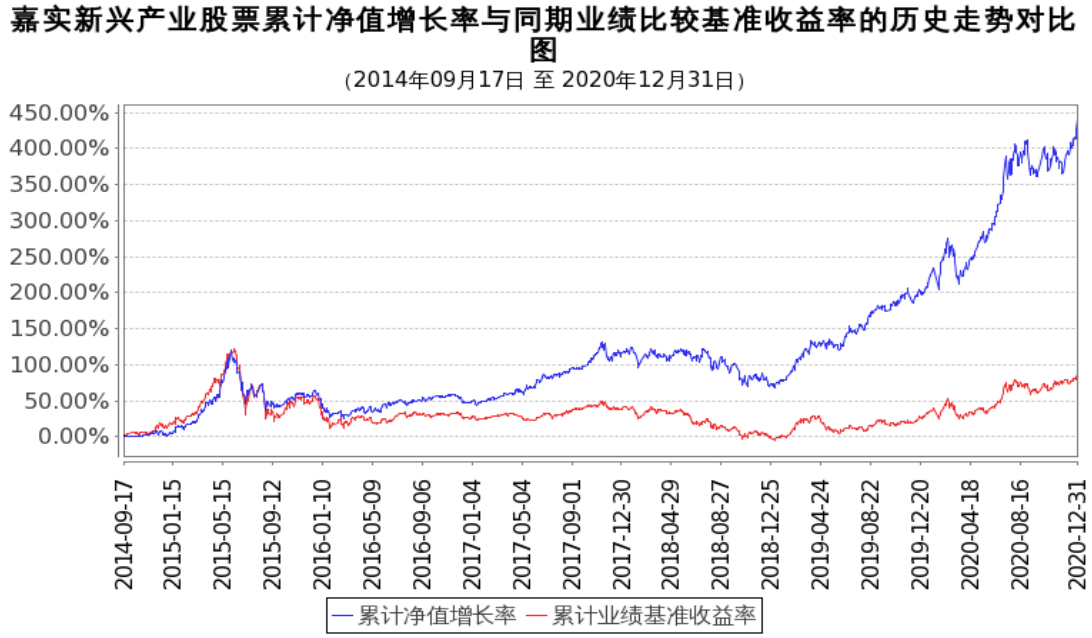
Return(t)=95%*（中证新兴产业指数(t)/中证新兴产业指数(t-1)-1)+5%*(中国债券总指数

(t)/中国债券总指数(t-1)-1)

Benchmark(t)=(1+Return(t))×（1+Benchmark(t-1)）-1

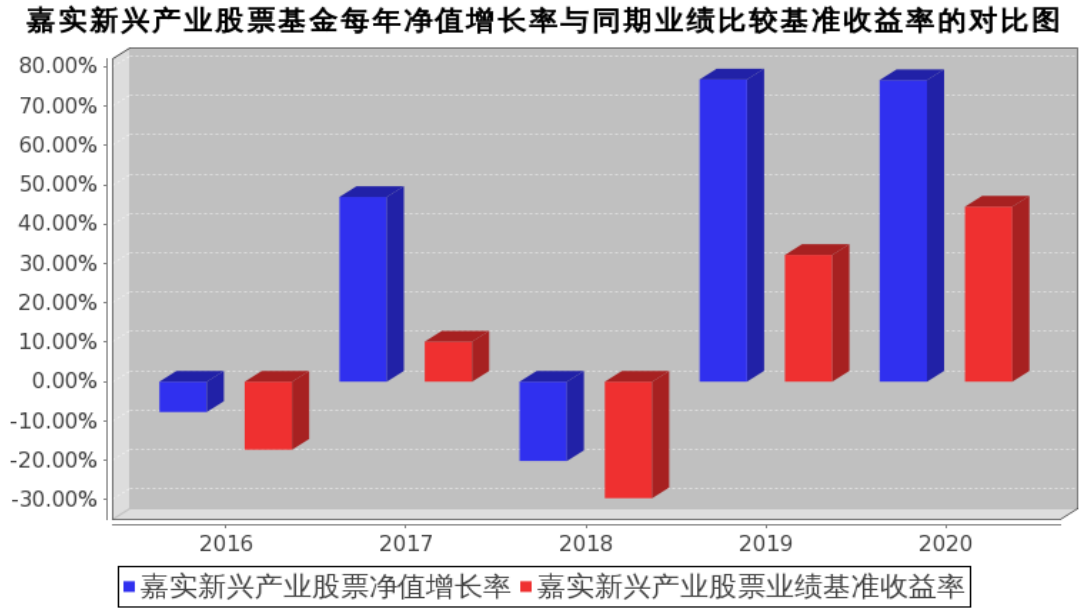
其中，t =1，2，3，…T，T 表示时间截至日。

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



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



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 资格和特定资产管理业务资格。

截止 2020 年 12 月 31 日，基金管理人共管理 205 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略

股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定

期混合、嘉实 H 股 50ETF（QDII）、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
归凯	本基金、嘉实增长混合、嘉实领先成长混合、嘉实泰和混合、嘉实成长增强混合、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实核心成长混合基金经理	2018 年 12 月 4 日	-	14 年	曾任国都证券研究所研究员、投资经理。2014 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任机构投资部投资经理、策略组投资总监，现任主基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。

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遵规守信情况的说明

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、《嘉实新兴产业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同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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年是复杂的一年，全球资本市场也经历了较大的波动，年初新冠疫情在全球范围内快速

扩散，疫情一度引发资本市场恐慌性抛售，市场风险偏好遭受严重打击，但随后全球主要央行纷纷注入较多的流动性，二季度市场也迎来了快速反弹，三季度市场在经历一定盘整之后，四季度在疫情得到控制、全球经济迎来复苏的良好预期下，全球主要股票市场多数录得两位数涨幅。

从国内情况看，中国疫情控制良好，经济领先全球迎来非常好的复苏势头，主要的经济指标也表现强劲，下半年市场曾一度担心国内经济复苏促使货币政策显著收紧，但全球疫情肆虐的背景下国内货币政策环境仍较为温和，逐步从宽松向稳健中过度；与此同时，也出现了不少优质企业在如此复杂的政治经济环境下提升了自身竞争力，获取了更多的市场份额并提升了盈利能力，从而在业绩表现上超出年初预期。所以我们认为 2020 年较好的资本市场表现得益于较为宽松的流动性和部分优秀企业盈利的持续超预期，而基本面层面的分化也导致了全年个股层面极其分化的市场表现。

本基金主要聚焦于科技、制造、消费和医药健康领域内优质公司的投资，全年维度本基金持续在持仓结构上进行优化，下半年以来本基金制造业和医药健康的持仓占比有所上升，消费占比有所下降。截止本报告期末，本基金大类板块占比依次为制造、科技、医药健康、消费。

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 5.393 元；本报告期基金份额净值增长率为 76.59%，业绩比较基准收益率为 44.45%。

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 2021 年，我们认为宏观流动性将总体维持稳定并存在小幅趋紧的可能，但整体经济特别是非银企业盈利会有不错的增长，在此背景下我们判断整体市场仍然会是震荡走势，但个股的走势会持续分化，市场结构性的行情会成为常态。

中长期看我们对于国内经济持续转型升级保持很强的信心，这轮疫情过程中更加凸显国内企业的韧性和强大的供应链优势，使得不少企业在全球范围的竞争力大幅提升，同时我们也很欣喜的看到富有创新意识和拼搏精神的企业家们的不断涌现和进化，他们才是支撑未来资本市场表现最中坚的力量。

具体到细分行业，我们持续看好先进制造、互联网、企业级软件、汽车智能化、医疗器械和服务、可选消费等细分赛道。在后续投资中，管理人将继续立足于长期、审慎投资，争取为投资者实现长期卓越回报！

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。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，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）主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

（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）负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），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，未发现新增产品、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机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成合规报告和各项统计、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历。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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—嘉实基金管理有限公司 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为， 嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，嘉实基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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(2021)第 23537 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	嘉实新兴产业股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了嘉实新兴产业股票型证券投资基金(以下简称“嘉实新兴产业股票基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 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。

	(二) 我们的意见 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，公允反映了嘉实新兴产业股票基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实新兴产业股票基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
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	嘉实新兴产业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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实新兴产业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新兴产业股票基金、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新兴产业股票基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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。 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： (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。

	(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。 (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。 (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，就可能导致对嘉实新兴产业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新兴产业股票基金不能持续经营。 (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。 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。	
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	周祎
会计师事务所的地址	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	
审计报告日期	2021 年 03 月 25 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实新兴产业股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	353,984,713.09	141,390,185.32
结算备付金		10,918,523.55	3,998,928.40
存出保证金		2,483,291.60	308,405.95
交易性金融资产	7.4.7.2	14,530,840,945.75	2,143,564,432.03
其中：股票投资		14,040,355,945.75	2,111,264,463.23
基金投资		-	-
债券投资		490,485,000.00	32,299,968.80
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		22,193,097.36	-
应收利息	7.4.7.5	5,004,098.87	604,954.43
应收股利		-	-
应收申购款		44,317,449.26	15,395,588.72
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		14,969,742,119.48	2,305,262,494.85
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 12 月 31 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			
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		-	2,272,759.99
应付赎回款		241,571,497.03	19,263,998.64
应付管理人报酬		18,217,299.99	2,610,510.67
应付托管费		3,036,216.65	435,085.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,345,319.20	710,071.20
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	819,302.13	229,099.03
负债合计		266,989,635.00	25,521,524.63
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,726,167,027.20	746,526,932.04
未分配利润	7.4.7.10	11,976,585,457.28	1,533,214,038.18
所有者权益合计		14,702,752,484.48	2,279,740,970.22
负债和所有者权益总计		14,969,742,119.48	2,305,262,494.85

注： 报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.393 元，基金份额总额 2,726,167,027.20 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实新兴产业股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

一、收入		4,929,087,746.42	507,717,367.32
1.利息收入		7,381,468.53	1,368,210.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,000,637.60	415,527.19
债券利息收入		1,317,523.58	952,683.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		63,307.35	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		860,461,620.14	127,841,394.31
其中：股票投资收益	7.4.7.12	820,644,990.04	121,513,766.49
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-43,210.34	255,944.46
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	39,859,840.44	6,071,683.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,989,172,496.87	374,433,770.84
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	72,072,160.88	4,073,991.33
减：二、费用		189,800,311.57	20,025,652.27
1．管理人报酬		142,078,748.68	14,654,591.31
2．托管费		23,679,791.44	2,442,431.88
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.19	23,677,888.05	2,681,083.83
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	7.97
7．其他费用	7.4.7.20	363,883.40	247,537.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,739,287,434.85	487,691,715.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,739,287,434.85	487,691,715.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实新兴产业股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	746,526,932.04	1,533,214,038.18	2,279,740,970.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,739,287,434.85	4,739,287,434.85
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）	1,979,640,095.16	5,704,083,984.25	7,683,724,079.41
其中：1.基金申购款	5,936,890,533.00	19,068,741,229.19	25,005,631,762.19
2.基金赎回款	-3,957,250,437.84	-13,364,657,244.94	-17,321,907,682.78
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）	2,726,167,027.20	11,976,585,457.28	14,702,752,484.48
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	316,597,987.59	230,368,487.94	546,966,475.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	487,691,715.05	487,691,715.05
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）	429,928,944.45	815,153,835.19	1,245,082,779.64

其中：1.基金申购款	853,411,851.68	1,511,407,026.65	2,364,818,878.33
2.基金赎回款	-423,482,907.23	-696,253,191.46	-1,119,736,098.69
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)	746,526,932.04	1,533,214,038.18	2,279,740,970.22

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	罗丽丽	罗丽丽
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

嘉实新兴产业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[2014]708 号《关于核准嘉实新兴产业股票型证券投资基金募集的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实新兴产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实新兴产业股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 9 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 617,795,162.85 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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》、《嘉实新兴产业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、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外)，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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	353,984,713.09	141,390,185.32
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	353,984,713.09	141,390,185.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020 年 12 月 31 日_		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,691,636,739.42	14,040,355,945.75	4,348,719,206.33
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	490,555,480.00	490,485,000.00	-70,480.00
	合计	490,555,480.00	490,485,000.00	-70,480.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,182,192,219.42	14,530,840,945.75	4,348,648,726.33
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,751,831,138.53	2,111,264,463.23	359,433,324.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,256,884.04	2,248,968.80	-7,915.24
	银行间市场	30,000,180.00	30,051,000.00	50,820.00
	合计	32,257,064.04	32,299,968.80	42,904.76
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,784,088,202.57	2,143,564,432.03	359,476,229.46

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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	上年度末

	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	85,681.87	25,636.60
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	4,913.30	1,799.50
应收债券利息	4,912,386.30	577,137.78
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	-	241.75
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1,117.40	138.80
合计	5,004,098.87	604,954.43

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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,342,230.72	710,071.20
银行间市场应付交易费用	3,088.48	-
合计	3,345,319.20	710,071.20

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	549,302.13	29,099.03
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	270,000.00	200,000.00
合计	819,302.13	229,099.03

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	746,526,932.04	746,526,932.04
本期申购	5,936,890,533.00	5,936,890,533.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,957,250,437.84	-3,957,250,437.84
- 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	2,726,167,027.20	2,726,167,027.20

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	512,416,298.68	1,020,797,739.50	1,533,214,038.18
本期利润	750,114,937.98	3,989,172,496.87	4,739,287,434.85
本期基金份额交易产生的变动数	1,565,954,253.64	4,138,129,730.61	5,704,083,984.25
其中：基金申购款	5,072,722,373.25	13,996,018,855.94	19,068,741,229.19
基金赎回款	-3,506,768,119.61	-9,857,889,125.33	-13,364,657,244.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,828,485,490.30	9,148,099,966.98	11,976,585,457.28

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	5,783,014.64	380,586.57
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	172,695.47	22,014.73
其他	44,927.49	12,925.89
合计	6,000,637.60	415,527.19

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	820,644,990.04	121,513,766.49
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	820,644,990.04	121,513,766.49

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,257,084,635.12	716,062,929.63
减:卖出股票成本总额	6,436,439,645.08	594,549,163.14
买卖股票差价收入	820,644,990.04	121,513,766.49

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-43,210.34	255,944.46
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	-43,210.34	255,944.46

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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	35,513,250.40	33,770,619.99
减：卖出债券（、债转股	34,579,210.34	32,515,310.00

及债券到期兑付)成本总额		
减：应收利息总额	977,250.40	999,365.53
买卖债券差价收入	-43,210.34	255,944.46

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。

7.4.7.14 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

无。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	39,859,840.44	6,071,683.36
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	39,859,840.44	6,071,683.36

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	3,989,172,496.87	374,433,770.84
股票投资	3,989,285,881.63	374,525,846.00
债券投资	-113,384.76	-92,075.16
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2.衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,989,172,496.87	374,433,770.84

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	67,246,613.00	3,112,962.15
基金转出费收入	4,825,547.88	961,029.18
合计	72,072,160.88	4,073,991.33

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	23,675,163.05	2,680,858.83
银行间市场交易费用	2,725.00	225.00
合计	23,677,888.05	2,681,083.83

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	150,000.00	80,000.00
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	75,883.40	29,537.28
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	363,883.40	247,537.28

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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人
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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	142,078,748.68	14,654,591.31
其中：支付销售机构的客户维护费	47,051,633.76	4,314,039.27

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	23,679,791.44	2,442,431.88

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
立信投资有限责任公司	859,309.49	0.03	-	-

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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
中国农业银行股份有限公司_活期	353,984,713.09	5,783,014.64	141,390,185.32	380,586.57

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(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2020 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
002230	科大讯飞	2019年7月17日	2021年7月19日	非公开发行锁定	27.10	38.41	110,701	2,999,997.10	4,252,025.41	-
002791	坚朗五金	2020年11月11日	2021年5月11日	大宗交易受让减持锁定	126.44	135.10	390,000	49,311,600.00	52,689,000.00	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300496	中科创达	2020年8月7日	2021年2月18日	非公开发行锁定	82.36	112.74	444,390	36,599,960.40	50,100,528.60	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新股锁定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐	2020	2021	新股	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-

	克	年 11 月 5 日	年 5 月 12 日	锁定						
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股锁定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新股锁定	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11	2021 年 5 月	新股锁定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-

		月 20 日	27 日							
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300925	法本信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股锁定	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新发未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新发未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股锁定	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新发未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688019	安集科技	2020 年 8 月 3 日	2021 年 2 月 3 日	大宗交易受让减持锁定	410.00	287.73	72,000	29,520,000.00	20,716,560.00	-
688301	奕瑞科技	2020 年 9 月	2021 年 3 月	新股锁定	119.60	162.72	2,427	290,269.20	394,921.44	-

		9 日	18 日							
688339	亿华通	2020 年 7 月 31 日	2021 年 2 月 10 日	新股锁定	76.65	257.95	2,761	211,630.65	712,199.95	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新发未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-

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证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在适度控制风险并保持良好流动性的前提下，分享新兴产业带来的投资机会，力求获得超额收益与长期资本增值。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

无。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 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 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	353,984,713.09	-	-	-	353,984,713.09
结算备付金	10,918,523.55	-	-	-	10,918,523.55
存出保证金	2,483,291.60	-	-	-	2,483,291.60
交易性金融资产	490,485,000.00	-	-	14,040,355,945.75	14,530,840,945.75
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	22,193,097.36	22,193,097.36
应收利息	-	-	-	5,004,098.87	5,004,098.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	44,317,449.26	44,317,449.26
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	857,871,528.24	-	-	14,111,870,591.24	14,969,742,119.48
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	-	-	-	241,571,497.03	241,571,497.03

应付管理人报酬	-	-	-	18,217,299.99	18,217,299.99
应付托管费	-	-	-	3,036,216.65	3,036,216.65
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	3,345,319.20	3,345,319.20
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	819,302.13	819,302.13
负债总计	-	-	-	266,989,635.00	266,989,635.00
利率敏感度缺口	857,871,528.24	-	-	13,844,880,956.24	14,702,752,484.48
上年度末 2019 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	141,390,185.32	-	-	-	141,390,185.32
结算备付金	3,998,928.40	-	-	-	3,998,928.40
存出保证金	308,405.95	-	-	-	308,405.95
交易性金融资产	32,299,968.80	-	-	2,111,264,463.23	2,143,564,432.03
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	604,954.43	604,954.43
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	1,458,888.37	-	-	13,936,700.35	15,395,588.72
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	179,456,376.84	-	-	2,125,806,118.01	2,305,262,494.85
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	-	-	-	2,272,759.99	2,272,759.99
应付赎回款	-	-	-	19,263,998.64	19,263,998.64
应付管理人报酬	-	-	-	2,610,510.67	2,610,510.67
应付托管费	-	-	-	435,085.10	435,085.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	710,071.20	710,071.20
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	229,099.03	229,099.03

负债总计	-	-	-	25,521,524.63	25,521,524.63
利率敏感度缺口	179,456,376.84	-	-	2,100,284,593.38	2,279,740,970.22

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

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.34%(2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 1.42%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

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

无。

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 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019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	14,040,355,945.75	95.49	2,111,264,463.23	92.61
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	14,040,355,945.75	95.49	2,111,264,463.23	92.61

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（2020 年 12 月 31 日）	上年度末 （2019 年 12 月 31 日 ）
分析	业绩比较基准上升 5%	680,493,120.43	92,954,382.47
	业绩比较基准下降 5%	-680,493,120.43	-92,954,382.47

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 13,909,567,354.57 元，属于第二层次的余额为 621,273,591.18 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 2,095,028,009.61 元，第二层次 48,536,422.42 元，无属于第三

层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	14,040,355,945.75	93.79
	其中：股票	14,040,355,945.75	93.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	490,485,000.00	3.28
	其中：债券	490,485,000.00	3.28
	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	364,903,236.64	2.44
8	其他各项资产	73,997,937.09	0.49
9	合计	14,969,742,119.48	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,203,068,739.28	55.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,072.88	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	122,638,000.93	0.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,654,757,003.21	24.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	789,080,468.07	5.37
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,270,777,580.28	8.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	14,040,355,945.75	95.49

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	300124	汇川技术	11,920,853	1,112,215,584.90	7.56
2	600763	通策医疗	3,771,012	1,042,760,238.24	7.09
3	300760	迈瑞医疗	2,136,471	910,136,646.00	6.19
4	002410	广联达	10,639,824	837,779,741.76	5.70
5	300285	国瓷材料	18,244,391	823,004,478.01	5.60
6	300012	华测检测	28,830,034	789,078,030.58	5.37
7	300496	中科创达	6,224,501	726,373,515.60	4.94

8	300357	我武生物	8,428,230	646,445,241.00	4.40
9	600570	恒生电子	5,979,335	627,232,241.50	4.27
10	600519	贵州茅台	311,373	622,123,254.00	4.23
11	300454	深信服	2,364,545	586,430,805.45	3.99
12	002475	立讯精密	10,163,592	570,380,783.04	3.88
13	002389	航天彩虹	16,486,111	548,163,190.75	3.73
14	002444	巨星科技	15,669,987	487,493,295.57	3.32
15	600872	中炬高新	5,886,615	392,342,889.75	2.67
16	002675	东诚药业	16,703,554	332,567,760.14	2.26
17	603444	吉比特	773,398	329,467,548.00	2.24
18	002013	中航机电	25,523,414	292,243,090.30	1.99
19	603039	泛微网络	2,846,153	287,347,606.88	1.95
20	601799	星宇股份	1,374,036	275,494,218.00	1.87
21	603882	金域医学	1,779,717	228,017,342.04	1.55
22	603960	克来机电	4,465,167	209,639,590.65	1.43
23	002791	坚朗五金	1,371,396	194,010,024.00	1.32
24	603486	科沃斯	2,057,562	182,073,661.38	1.24
25	300685	艾德生物	1,980,148	154,946,581.00	1.05
26	300829	金丹科技	1,599,812	148,094,596.84	1.01
27	002352	顺丰控股	1,389,745	122,617,201.35	0.83
28	300369	绿盟科技	7,715,421	117,891,632.88	0.80
29	688368	晶丰明源	434,305	74,739,547.45	0.51
30	002956	西麦食品	2,511,550	71,101,980.50	0.48
31	600984	建设机械	5,371,207	66,334,406.45	0.45
32	688016	心脉医疗	257,698	64,733,737.60	0.44
33	603990	麦迪科技	1,961,400	63,019,782.00	0.43
34	002507	涪陵榨菜	1,325,700	56,077,110.00	0.38
35	688019	安集科技	72,000	20,716,560.00	0.14
36	603833	欧派家居	113,623	15,282,293.50	0.10
37	002230	科大讯飞	110,796	4,255,908.06	0.03
38	688608	恒玄科技	4,179	1,383,249.00	0.01
39	688029	南微医学	5,893	1,084,370.93	0.01
40	300999	金龙鱼	12,117	1,069,870.02	0.01
41	688339	亿华通	2,761	712,199.95	0.00
42	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.00
43	300919	中伟股份	6,093	485,591.86	0.00
44	688301	奕瑞科技	2,427	394,921.44	0.00
45	688505	复旦张江	22,688	392,275.52	0.00
46	300896	爱美客	535	326,000.52	0.00
47	688578	艾力斯	10,734	305,704.32	0.00
48	300908	仲景食品	2,847	218,419.26	0.00
49	688229	博睿数据	1,243	131,633.70	0.00

50	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
51	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
52	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
53	300900	广联航空	882	29,283.51	0.00
54	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
55	300910	瑞丰新材	536	26,627.38	0.00
56	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
57	300884	狄耐克	585	20,477.97	0.00
58	300891	惠云钛业	1,225	20,206.44	0.00
59	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
60	300909	汇创达	458	19,503.82	0.00
61	300898	熊猫乳品	553	19,081.26	0.00
62	300892	品渥食品	314	19,072.88	0.00
63	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
64	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
65	300890	翔丰华	354	17,581.22	0.00
66	300925	法本信息	428	16,709.99	0.00
67	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
68	300902	国安达	610	15,324.88	0.00
69	300895	铜牛信息	329	15,095.98	0.00
70	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
71	300889	爱克股份	486	14,648.05	0.00
72	300911	亿田智能	383	13,305.04	0.00
73	300628	亿联网络	177	12,942.24	0.00
74	605009	豪悦护理	68	12,940.40	0.00
75	300882	万胜智能	494	12,823.42	0.00
76	300886	华业香料	264	12,364.59	0.00
77	300888	稳健医疗	65	10,790.00	0.00
78	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
79	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
80	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
81	000651	格力电器	99	6,132.06	0.00
82	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00
83	000858	五 粮 液	17	4,961.45	0.00
84	600298	安琪酵母	93	4,749.51	0.00
85	603232	格尔软件	133	3,559.08	0.00
86	300136	信维通信	99	3,552.12	0.00
87	300903	科翔股份	75	3,171.00	0.00
88	002415	海康威视	65	3,153.15	0.00
89	000710	贝瑞基因	58	2,207.48	0.00
90	600703	三安光电	80	2,160.80	0.00
91	002653	海思科	75	1,314.00	0.00

92	000063	中兴通讯	34	1,144.10	0.00
93	002120	韵达股份	51	800.70	0.00
94	002508	老板电器	19	774.82	0.00
95	300901	中胤时尚	11	230.01	0.00
96	300883	龙利得	11	163.90	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	002475	立讯精密	532,748,287.36	23.37
2	300454	深信服	527,459,125.27	23.14
3	600570	恒生电子	483,338,413.66	21.20
4	300760	迈瑞医疗	464,753,895.67	20.39
5	002410	广联达	450,183,325.13	19.75
6	300496	中科创达	446,621,504.57	19.59
7	300285	国瓷材料	443,938,906.74	19.47
8	002389	航天彩虹	411,903,399.35	18.07
9	002675	东诚药业	379,012,275.64	16.63
10	300012	华测检测	361,344,053.48	15.85
11	300357	我武生物	360,417,096.48	15.81
12	600519	贵州茅台	349,019,206.70	15.31
13	002444	巨星科技	328,886,307.65	14.43
14	600763	通策医疗	328,126,241.81	14.39
15	300003	乐普医疗	324,843,773.11	14.25
16	300124	汇川技术	301,320,858.82	13.22
17	603444	吉比特	294,418,729.08	12.91
18	300136	信维通信	282,619,044.04	12.40
19	600703	三安光电	278,094,613.59	12.20
20	002013	中航机电	274,898,114.97	12.06
21	603039	泛微网络	273,611,269.26	12.00
22	600872	中炬高新	267,185,424.77	11.72
23	600298	安琪酵母	261,436,148.82	11.47
24	000063	中兴通讯	223,366,788.34	9.80
25	601888	中国中免	219,707,647.90	9.64
26	300750	宁德时代	211,776,656.53	9.29
27	002049	紫光国微	210,257,892.63	9.22
28	601318	中国平安	209,531,556.58	9.19
29	000858	五 粮 液	206,628,700.38	9.06
30	300770	新媒股份	198,213,481.58	8.69
31	603960	克来机电	185,226,894.43	8.12
32	002791	坚朗五金	182,175,400.39	7.99

33	002230	科大讯飞	181,248,100.78	7.95
34	000725	京东方A	178,549,214.88	7.83
35	002653	海思科	174,307,331.62	7.65
36	300685	艾德生物	165,877,754.74	7.28
37	603882	金域医学	161,816,328.33	7.10
38	688019	安集科技	159,233,771.44	6.98
39	300369	绿盟科技	156,796,296.47	6.88
40	603486	科沃斯	143,020,448.29	6.27
41	002956	西麦食品	141,532,181.74	6.21
42	300896	爱美客	123,956,174.06	5.44
43	601966	玲珑轮胎	118,839,564.30	5.21
44	300791	仙乐健康	117,529,074.50	5.16
45	002352	顺丰控股	115,750,709.95	5.08
46	002609	捷顺科技	102,122,870.90	4.48
47	300829	金丹科技	100,163,888.39	4.39
48	000710	贝瑞基因	98,524,581.51	4.32
49	603990	麦迪科技	98,316,301.67	4.31
50	601799	星宇股份	89,702,211.02	3.93
51	000651	格力电器	83,264,262.72	3.65
52	002568	百润股份	78,730,873.74	3.45
53	300628	亿联网络	70,934,730.90	3.11
54	000100	TCL 科技	70,871,580.10	3.11
55	002508	老板电器	68,271,521.04	2.99
56	300609	汇纳科技	64,694,586.27	2.84
57	688016	心脉医疗	62,839,863.53	2.76
58	603589	口子窖	62,457,225.03	2.74
59	300253	卫宁健康	62,256,677.86	2.73
60	603939	益丰药房	61,976,976.15	2.72
61	300674	宇信科技	58,361,117.80	2.56
62	002507	涪陵榨菜	57,602,619.24	2.53
63	600882	妙可蓝多	55,435,948.99	2.43
64	300075	数字政通	54,533,842.32	2.39
65	688095	福昕软件	53,351,976.10	2.34
66	688085	三友医疗	50,337,357.16	2.21
67	600196	复星医药	45,908,910.11	2.01

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	000858	五 粮 液	425,844,644.73	18.68
2	000063	中兴通讯	329,130,725.98	14.44
3	300003	乐普医疗	324,792,702.14	14.25

4	600703	三安光电	314,290,565.96	13.79
5	300750	宁德时代	309,697,178.83	13.58
6	300770	新媒股份	293,971,832.47	12.89
7	300136	信维通信	269,483,005.40	11.82
8	601318	中国平安	247,151,734.08	10.84
9	600298	安琪酵母	237,371,121.87	10.41
10	601888	中国中免	228,864,893.94	10.04
11	002049	紫光国微	216,250,609.13	9.49
12	002230	科大讯飞	201,826,862.43	8.85
13	000725	京东方A	179,631,485.82	7.88
14	000651	格力电器	164,203,451.54	7.20
15	000100	TCL 科技	155,050,377.89	6.80
16	300896	爱美客	149,069,993.46	6.54
17	002653	海思科	148,716,006.43	6.52
18	688019	安集科技	143,994,608.72	6.32
19	000710	贝瑞基因	137,108,346.94	6.01
20	002568	百润股份	128,193,405.31	5.62
21	300791	仙乐健康	125,255,786.50	5.49
22	002609	捷顺科技	119,915,225.94	5.26
23	601966	玲珑轮胎	119,288,184.30	5.23
24	300253	卫宁健康	115,975,644.22	5.09
25	603589	口子窖	107,278,217.40	4.71
26	300454	深信服	102,977,194.73	4.52
27	002508	老板电器	90,703,268.93	3.98
28	002292	奥飞娱乐	88,635,550.28	3.89
29	300628	亿联网络	86,692,829.16	3.80
30	600276	恒瑞医药	82,657,633.03	3.63
31	002675	东诚药业	81,270,511.73	3.56
32	601799	星宇股份	74,349,100.04	3.26
33	603939	益丰药房	71,998,041.27	3.16
34	300609	汇纳科技	71,325,613.13	3.13
35	600196	复星医药	69,643,310.06	3.05
36	600556	天下秀	61,696,898.53	2.71
37	300674	宇信科技	61,695,995.87	2.71
38	002384	东山精密	56,076,991.34	2.46
39	688095	福昕软件	55,161,252.89	2.42
40	300661	圣邦股份	54,264,701.30	2.38
41	002475	立讯精密	50,644,802.46	2.22
42	600882	妙可蓝多	48,856,956.00	2.14
43	300369	绿盟科技	48,776,932.67	2.14
44	300075	数字政通	48,596,858.63	2.13

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	14,376,245,245.97
卖出股票收入（成交）总额	7,257,084,635.12

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	490,485,000.00	3.34
	其中：政策性金融债	490,485,000.00	3.34
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	490,485,000.00	3.34

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	200216	20 国开 16	2,100,000	210,357,000.00	1.43
2	200406	20 农发 06	800,000	79,808,000.00	0.54
3	160421	16 农发 21	700,000	70,189,000.00	0.48
4	200211	20 国开 11	500,000	49,800,000.00	0.34
5	180208	18 国开 08	300,000	30,147,000.00	0.21

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

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 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	2,483,291.60
2	应收证券清算款	22,193,097.36
3	应收股利	-
4	应收利息	5,004,098.87
5	应收申购款	44,317,449.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,997,937.09

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300496	中科创达	50,100,528.60	0.34	非公开发行锁定

8.12.6 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（%）
758,419	3,594.54	132,145,548.67	4.85	2,594,021,478.53	95.15

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	3,918,677.36	0.14

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	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 9 月 17 日）基金份额总额	617,795,162.85
本报告期期初基金份额总额	746,526,932.04
本报告期基金总申购份额	5,936,890,533.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,957,250,437.84
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	2,726,167,027.20

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

2020 年 4 月 8 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》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 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》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

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 150,000.00 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

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注

	元数量	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	
长江证券股份有限公司	2	5,196,287,005.21	24.11%	3,280,416.39	22.85%	-
中国银河证券股份有限公司	2	4,983,021,062.79	23.12%	3,488,136.45	24.30%	-
华泰证券股份有限公司	3	2,441,198,817.67	11.33%	1,634,878.39	11.39%	-
光大证券股份有限公司	1	2,068,455,994.09	9.60%	1,447,933.29	10.09%	-
中信证券股份有限公司	3	2,035,182,672.85	9.44%	1,284,817.84	8.95%	-
国盛证券有限责任公司	1	1,642,828,582.32	7.62%	1,037,124.83	7.23%	-
申万宏源证券有限公司	2	1,328,775,933.03	6.16%	930,146.92	6.48%	-
中信建投证券股份有限公司	1	723,456,336.90	3.36%	456,714.57	3.18%	-
国信证券股份有限公司	1	713,008,706.75	3.31%	499,110.05	3.48%	-

安信证券股份有限公司	1	394,239,429.50	1.83%	275,967.63	1.92%	-
广发证券股份有限公司	2	29,245,157.78	0.14%	18,462.64	0.13%	-
长城证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	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：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
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2,322,146.30	100.00%	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

证券股份有限公司						
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
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于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 01 月 22 日
2	嘉实新兴产业股票型证券投资基金暂停大额申购（含转入及定投）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 03 月 12 日
3	嘉实基金管理有限公司关于面向养老金客户实施特定申购费率的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 02 日
4	嘉实基金管理有限公司关于修改旗下部分基金托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 04 月 17 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资中科创达非公开发行股票的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 08 月 08 日
6	嘉实新兴产业股票型证券投资基金调整大额申购（含转入及定投）业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 08 月 11 日
7	嘉实基金管理有限公司关于修订旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020 年 10 月 22 日

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（1）中国证监会核准嘉实新兴产业股票型证券投资基金募集的文件；

（2）《嘉实新兴产业股票型证券投资基金基金合同》；

（3）《嘉实新兴产业股票型证券投资基金招募说明书》；

（4）《嘉实新兴产业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） 报告期内嘉实新兴产业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。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日