

嘉实量化精选股票型证券投资基金(原嘉
实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资
基金)

2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 1 月 21 日

§1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 01 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

嘉实量化精选股票型证券投资基金由嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金转型而成。

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

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

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止。原嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金报告期自 2021 年 10 月 01 日起至 2021 年 11 月 25 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况（转型后）

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 嘉实量化精选股票 |
| 基金主代码 | 001637 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 11 月 26 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 330,951,847.08 份 |
| 投资目标 | 本基金以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将腾讯自选股大数据和行为金融模型相结合，构建大数据量化投资策略模型，在此基础上生成基金股票组合，力争获得长期、持续的超额收益。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 | 中证 500 指数收益率*95%+中证综合债券指数收益率*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。 |
| 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 |

2.1 基金基本情况（转型前）

| | |
|------------|---|
| 基金简称 | 嘉实腾讯自选股大数据策略股票 |
| 基金主代码 | 001637 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 12 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 364,323,192.22 份 |
| 投资目标 | 本基金以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将腾讯自选股大数据和行为金融模型相结合,构建大数据量化投资策略模型,在此基础上生成基金股票组合,力争获得长期、持续的超额收益。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 | 中证 500 指数收益率*95%+中证综合债券指数收益率*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。 |
| 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 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标（转型后）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 11 月 26 日-2021 年 12 月 31 日） |
|-----------------|--|
| 1. 本期已实现收益 | 3,963,590.54 |
| 2. 本期利润 | 10,016,732.83 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0279 |
| 4. 期末基金资产净值 | 648,173,570.19 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.9585 |

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。

3.1 主要财务指标（转型前）

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021 年 10 月 1 日-2021 年 11 月 25 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | -1,313,200.21 |
| 2. 本期利润 | 9,183,179.97 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0302 |
| 4. 期末基金资产净值 | 702,387,677.94 |

| | |
|-------------|-------|
| 5. 期末基金份额净值 | 1.928 |
|-------------|-------|

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）自 2021 年 11 月 26 日起，《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。

3.2 基金净值表现（转型后）

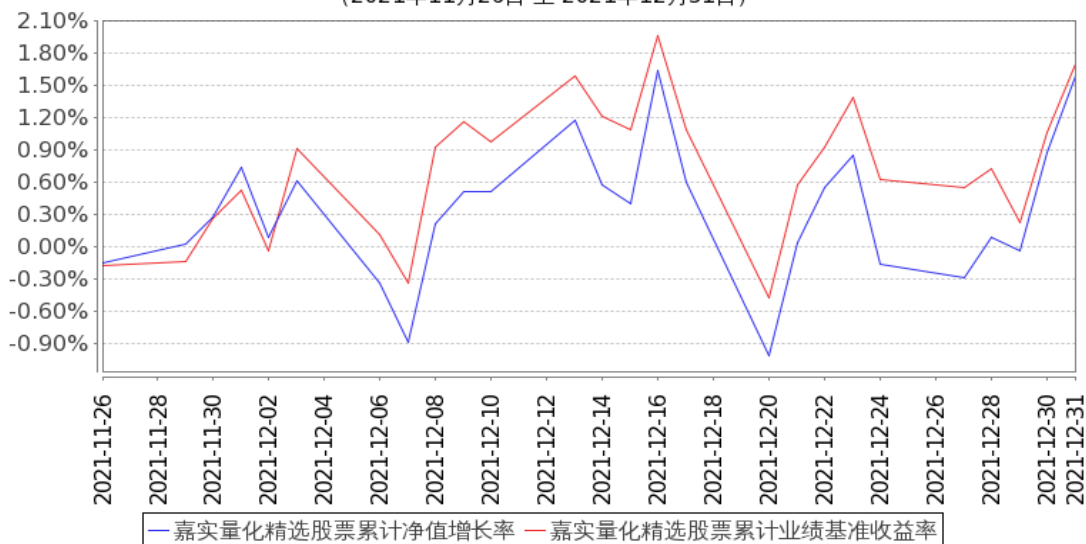
基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|-------|
| 自基金合同 生效起至今 | 1.58% | 0.73% | 1.69% | 0.68% | -0.11% | 0.05% |

自基金转型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

嘉实量化精选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

(2021年11月26日至2021年12月31日)



注：（1）本基金合同生效日 2021 年 11 月 26 日至报告期末未满 1 年。

（2）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，本报告期处于建仓期内。

3.2 基金净值表现（转型前）

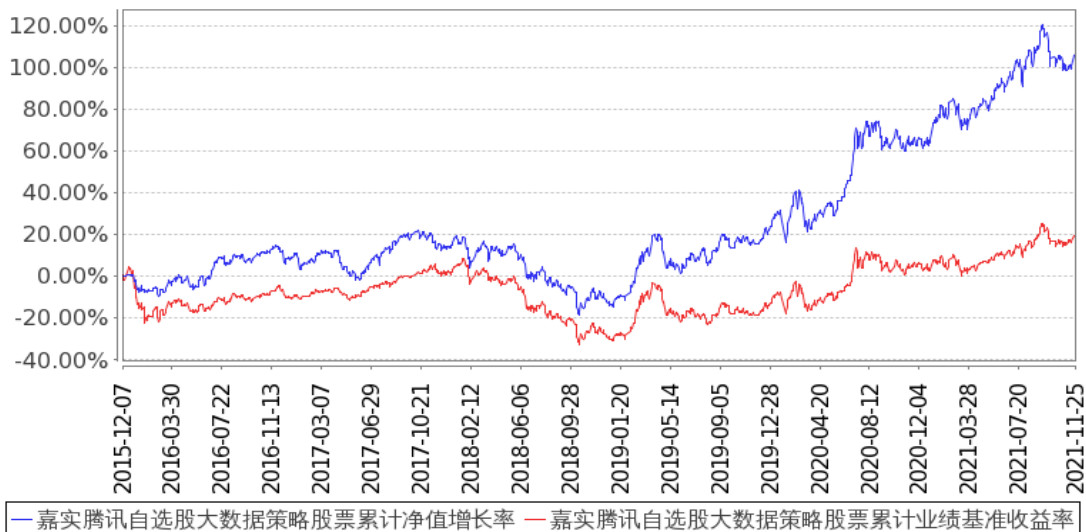
基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.94% | 0.86% | 1.77% | 0.75% | -0.83% | 0.11% |
| 过去六个月 | 4.16% | 1.10% | 6.07% | 0.97% | -1.91% | 0.13% |
| 过去一年 | 21.87% | 1.07% | 13.19% | 0.95% | 8.68% | 0.12% |
| 过去三年 | 138.61% | 1.31% | 70.41% | 1.33% | 68.20% | -0.02% |
| 过去五年 | 89.14% | 1.27% | 32.78% | 1.22% | 56.36% | 0.05% |
| 自基金合同 生效起至今 | 106.06% | 1.22% | 19.04% | 1.25% | 87.02% | -0.03% |

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

嘉实腾讯自选股大数据策略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12月07日至2021年11月25日)



注：（1）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。

（2）自 2021 年 11 月 26 日起，《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》生效，《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》同日起失效。

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（转型后）

| 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 | | |
| 刘斌 | 本基金、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合基金经理 | 2021年11月26日 | - | 15年 | 曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013年12月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作，现任增强风格投资总监。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
| 龙昌伦 | 本基金、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实中证500指数增强基金经理 | 2021年11月26日 | - | 8年 | 曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015年4月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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（转型后）

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|------------------|------------|
| 刘斌 | 公募基金 | 4 | 3,272,474,895.90 | 2018年1月19日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 60,023,212.90 | 2021年12月9日 |
| | 其他组合 | 3 | 5,580,566,967.79 | 2017年3月13日 |
| | 合计 | 8 | 8,913,065,076.59 | - |

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介（转型前）

| 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 | | |
| 刘斌 | 本基金、嘉实沪深300 指数研究增强、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合基金经理 | 2015 年 12 月 7 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 15 年 | 曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013 年 12 月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作，现任增强风格投资总监。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
| 龙昌伦 | 本基金、嘉实沪深300 指数研究增强、嘉实中证 500 指数增强基金经理 | 2017 年 6 月 22 日 | 2021 年 11 月 25 日 | 8 年 | 曾任职于建信基金管理有限责任公司投资管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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（转型前）

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值（元） | 任职时间 |
|----|----------|---------|------------------|-----------------|
| 刘斌 | 公募基金 | 4 | 3,272,474,895.90 | 2018 年 1 月 19 日 |
| | 私募资产管理计划 | 1 | 60,023,212.90 | 2021 年 12 月 9 日 |
| | 其他组合 | 3 | 5,580,566,967.79 | 2017 年 3 月 13 日 |
| | 合计 | 8 | 8,913,065,076.59 | - |

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、《嘉实量化精选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 公平交易专项说明

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。

异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

A 股市场四季度继续维持震荡格局，波动率有所下降，但内部结构高度分化依旧，国证 2000 与中证 1000 等超小市值指数涨幅居前，而红利指数以及中证 100 和沪深 300 等大市值指数则表现靠后，因此，在风格层面，市值是影响四季度股票表现的核心变量。从节奏上看，市场呈现先抑后扬的走势，市场成交量亦在 9 月中旬见顶回落，随后维持在相对稳定的水平，即使后期市场逐渐回暖。前期，在“能耗双控”等政策影响下，市场出现回调，后期则随着对经济衰退的一致预期，货币宽松和经济刺激成为市场的主要交易线索，带动市场情绪和指数点位回升。

无论是宏观经济还是政策导向上，四季度体现出来的主要运行逻辑是经济下行压力继续加大，稳增长走向前台。一方面是地产政策的变化和悲观预期修正，在以恒大为代表的房企信贷风险持续酝酿和暴露的背景下，监管层表态地产防风险与软着陆的诉求，央行明确提出要保持房地产信贷平稳有序投放，维护房地产市场平稳健康发展，随后地产端的信贷呵护逐步升温，政策向放松方向调整，保利、金地以及部分受损严重的中小地产企业率先开启反弹。第二是，“能耗双控”等减碳带来的负面影响日益暴露，在生产层面，无论是价格还是供给端均带来巨大挑战，监管重心也由单纯的能耗双控转为稳价保供。而 12 月召开的中央政治局会议与中央经济工作会议，均明确调“稳增长”将是首要目标，财政加快支出进度，适度超前开展基础设施投资，政府专项债发行速度继续加快，在货币政策方面也提出稳健的货币政策要保持流动性合理充裕，在 12 月降准落地后，1 年期 LPR 也随之下调，宽松货币环境的政策意图明显。

股票市场方面，四季度市值和稳增长成为驱动市场波动的主要因素，稳增长是投资主攻方向，

而小市值股票则受益于宽松的货币环境。行业方面，传媒、国防军工、通信、轻工和电子等涨幅居前，煤炭、钢铁、石油石化、美容护理和社会服务等则表现靠后。

本基金在四季度召开持有人大会，将基金名称变更为“嘉实量化精选”，变更前基金依据腾讯自选股等相关数据，深入挖掘用户的选股行为模式，同时发挥嘉实基金的量化研究优势，结合价值、成长、流动性等传统金融数据指标，选取成长性较好的优质公司，剔除基本面和流动性较差的股票，最终构建大数据组合。变更后，基金基金管理人在资产配置框架下，依据科学技术和系统化方法，深入分析上市公司各类型大数据，包含基本面大数据、交易行为大数据、产业链大数据、互联网大数据，以及嘉实基金研究员基于实地调研、案头研究以及电话访谈等多种对上市公司进行研究所产生的上市公司研究数据，在此基础上构建多种投资策略，以海量、多维度的数据构建对个股全面的评估体系，并运用智能化方法优化策略权重，最终精选具有显著投资价值的上市公司构建股票投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

转型后：

截至 2021 年 12 月 31 日，嘉实量化精选股票基金份额净值为 1.9585 元；自 2021 年 11 月 26 日起至 2021 年 12 月 31 日止，基金份额净值增长率为 1.58%，业绩比较基准收益率为 1.69%。

转型前：

截至 2021 年 11 月 25 日，嘉实腾讯自选股大数据策略股票份额净值为 1.928 元，自 2021 年 10 月 1 日起至 2021 年 11 月 25 日止，基金份额净值增长率为 0.94%，业绩比较基准收益率为 1.77%。

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（转型后）

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 | 603,020,121.98 | 92.73 |
| | 其中：股票 | 603,020,121.98 | 92.73 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 3,842,223.80 | 0.59 |
| | 其中：债券 | 3,842,223.80 | 0.59 |
| | 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 | 42,229,772.14 | 6.49 |
| 8 | 其他资产 | 1,228,539.16 | 0.19 |
| 9 | 合计 | 650,320,657.08 | 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 | 19,483,933.00 | 3.01 |
| B | 采矿业 | 11,877,635.00 | 1.83 |
| C | 制造业 | 382,657,887.65 | 59.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 31,094,279.31 | 4.80 |
| E | 建筑业 | 13,544,217.80 | 2.09 |
| F | 批发和零售业 | 4,958,052.70 | 0.76 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,981,316.00 | 1.23 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,608.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 59,932,019.21 | 9.25 |
| J | 金融业 | 42,007,167.58 | 6.48 |
| K | 房地产业 | 9,676,336.00 | 1.49 |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,088,094.00 | 1.56 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 5,078,990.32 | 0.78 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 44,659.04 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 18,161.78 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 4,572,764.59 | 0.71 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 603,020,121.98 | 93.03 |

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 | 000039 | 中集集团 | 737,700 | 12,658,932.00 | 1.95 |
| 2 | 600728 | 佳都科技 | 1,455,800 | 12,126,814.00 | 1.87 |
| 3 | 000830 | 鲁西化工 | 787,400 | 12,015,724.00 | 1.85 |
| 4 | 600803 | 新奥股份 | 635,000 | 11,658,600.00 | 1.80 |
| 5 | 002396 | 星网锐捷 | 494,500 | 11,655,365.00 | 1.80 |
| 6 | 002092 | 中泰化学 | 1,212,400 | 11,566,296.00 | 1.78 |
| 7 | 002517 | 恺英网络 | 1,950,100 | 11,349,582.00 | 1.75 |
| 8 | 600116 | 三峡水利 | 973,100 | 11,346,346.00 | 1.75 |
| 9 | 300639 | 凯普生物 | 382,900 | 11,299,379.00 | 1.74 |
| 10 | 600884 | 杉杉股份 | 325,800 | 10,676,466.00 | 1.65 |

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 | 3,399,892.50 | 0.52 |
| 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） | 442,331.30 | 0.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 3,842,223.80 | 0.59 |

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 | 019658 | 21 国债 10 | 34,050 | 3,399,892.50 | 0.52 |
| 2 | 127043 | 川恒转债 | 2,130 | 319,201.80 | 0.05 |
| 3 | 113633 | 科沃转债 | 950 | 123,129.50 | 0.02 |

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 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

| 代码 | 名称 | 持仓量 (买/卖) | 合约市值(元) | 公允价值变动 (元) | 风险说明 |
|--------------------|--------|-----------|--------------|------------|---------------|
| IC2203 | IC2203 | 4 | 5,844,640.00 | 86,120.00 | - |
| 公允价值变动总额合计 (元) | | | | | 86,120.00 |
| 股指期货投资本期收益 (元) | | | | | 1,524,740.97 |
| 股指期货投资本期公允价值变动 (元) | | | | | -1,015,880.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

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

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 (元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 960,034.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | 74,434.45 |
| 3 | 应收股利 | - |

| | | |
|---|-------|--------------|
| 4 | 应收利息 | 42,852.03 |
| 5 | 应收申购款 | 151,218.20 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,228,539.16 |

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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

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 | 632,935,814.67 | 89.91 |
| | 其中：股票 | 632,935,814.67 | 89.91 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 864,257.70 | 0.12 |
| | 其中：债券 | 864,257.70 | 0.12 |
| | 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 | 66,338,173.79 | 9.42 |
| 8 | 其他资产 | 3,849,309.27 | 0.55 |
| 9 | 合计 | 703,987,555.43 | 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 | 17,698,193.00 | 2.52 |
| B | 采矿业 | 9,302,103.00 | 1.32 |
| C | 制造业 | 425,533,108.14 | 60.58 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应 | 24,095,461.31 | 3.43 |

| | 业 | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| E | 建筑业 | 14,843,913.00 | 2.11 |
| F | 批发和零售业 | 11,910,658.88 | 1.70 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,219,100.00 | 0.60 |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,742.56 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 50,795,602.91 | 7.23 |
| J | 金融业 | 24,771,028.64 | 3.53 |
| K | 房地产业 | 17,749,331.00 | 2.53 |
| L | 租赁和商务服务业 | 10,663,314.00 | 1.52 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,601,230.48 | 0.66 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 8,355,051.00 | 1.19 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,451,175.86 | 0.21 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 3,901,300.89 | 0.56 |
| S | 综合 | 3,041,500.00 | 0.43 |
| | 合计 | 632,935,814.67 | 90.11 |

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 | 300618 | 寒锐钴业 | 139,400 | 13,452,100.00 | 1.92 |
| 2 | 000039 | 中集集团 | 761,900 | 12,761,825.00 | 1.82 |
| 3 | 300639 | 凯普生物 | 390,600 | 11,311,776.00 | 1.61 |
| 4 | 600884 | 杉杉股份 | 325,800 | 11,207,520.00 | 1.60 |
| 5 | 000830 | 鲁西化工 | 730,000 | 11,103,300.00 | 1.58 |
| 6 | 600728 | 佳都科技 | 1,405,100 | 11,044,086.00 | 1.57 |
| 7 | 002129 | 中环股份 | 233,500 | 10,488,820.00 | 1.49 |
| 8 | 600116 | 三峡水利 | 1,014,200 | 10,152,142.00 | 1.45 |
| 9 | 600803 | 新奥股份 | 502,000 | 10,034,980.00 | 1.43 |
| 10 | 601689 | 拓普集团 | 169,609 | 10,001,842.73 | 1.42 |

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 | - | - |
| 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） | 864,257.70 | 0.12 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 864,257.70 | 0.12 |

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 | 118000 | 嘉元转债 | 2,020 | 409,979.20 | 0.06 |
| 2 | 127043 | 川恒转债 | 2,130 | 360,651.60 | 0.05 |
| 3 | 113627 | 太平转债 | 640 | 78,816.00 | 0.01 |
| 4 | 110076 | 华海转债 | 130 | 14,810.90 | 0.00 |

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 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

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|---------------|--------------|--------------|
| IC2112 | IC2112 | 18 | 25,961,760.00 | 1,102,000.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 1,102,000.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -709,440.00 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 1,779,680.00 |

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

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

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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 3,741,110.48 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 56,971.91 |
| 5 | 应收申购款 | 51,226.88 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 3,849,309.27 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|--------------|
| 1 | 118000 | 嘉元转债 | 409,979.20 | 0.06 |
| 2 | 110076 | 华海转债 | 14,810.90 | 0.00 |

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（转型后）

单位：份

| | |
|------------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2021年11月26日) | |
| 基金份额总额 | 364,323,192.22 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 11,619,347.29 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 44,990,692.43 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 330,951,847.08 |

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。

§ 6 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 251,805,318.40 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 117,214,442.60 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 4,696,568.78 |
| 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 | 364,323,192.22 |

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型后）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | 报告期末持有基金情况 | | |
|--|----------------|--|---------------|---------------|---------------|----------------|----------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 (%) |
| 机构 | 1 | 2021/10/01 至 2021/10/27, 2021/11/02 至 2021/12/31 | 53,914,815.93 | 52,909,523.80 | - | 106,824,339.73 | 32.28 |
| | 2 | 2021/10/01 至 2021/11/01 | 62,227,131.30 | - | 32,227,131.30 | 30,000,000.00 | 9.06 |
| 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腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金注册的批复文件；
- 中国证监会准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更注册的批复；
- (2) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实量化精选股票型证券投资基金公告的各项原稿。

9.2 存放地点

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

9.3 查阅方式

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

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

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

嘉实基金管理有限公司

2022 年 1 月 21 日