

嘉实优化红利混合型证券投资基金 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	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人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	13
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	13
§ 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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8 其他重大事件	66
§ 11 备查文件目录	66
11.1 备查文件目录	66
11.2 存放地点	67
11.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实优化红利混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实优化红利混合	
基金主代码	070032	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 6 月 26 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,324,240,956.02 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实优化红利混合 A	嘉实优化红利混合 C
下属分级基金的交易代码	070032	012616
报告期末下属分级基金的份额总额	1,322,927,136.34 份	1,313,819.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票。在高现金红利的股票中精选具备成长潜力的公司股票进行投资，追求稳定的股息收入和长期的资本增值。股票的收益由两部分构成，当期红利和未来的资本利得。本基金主要投资于盈利稳定增长的红利股票，稳定的股息收入是当期收益的重要组成部分，且是公司利润中最货真价实的部分，因而也是投资者衡量上市公司投资价值的重要指标。市场的波动也为投资者进行红利再投资以获得高额复利回报提供了机会。红利策略在牛市中是锦上添花，在熊市中提供复利回报，这是红利策略能够穿越牛熊市，实现长期价值投资回报的基本逻辑。监管层提出的要求上市公司树立牢固的分红意识，上市公司采取措施完善分红政策及其决策机制，进一步加强对上市公司利润分配决策过程和执行情况监管，以及要求在公司招股说明书中细化回报规划、分红政策和分红计划是对分红理念的肯定。</p> <p>其他投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、衍生品投资策略、风险管理策略等。</p>
业绩比较基准	中证红利指数收益率×95%+上证国债指数收益率×5%
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，属较高风险、较高收益的品种。

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	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010)65215588	95566
	电子邮箱	service@jsfund.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	400-600-8800	95566	
传真	(010)65215588	(010)66594942	
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	北京西城区复兴门内大街1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	北京西城区复兴门内大街1号	
邮政编码	100005	100818	
法定代表人	经雷	刘连舸	

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01月01日-2022年06月30日)	
	嘉实优化红利混合 A	嘉实优化红利混合 C
本期已实现收益	-3,452,380.26	-5,794.08
本期利润	-172,664,522.33	-96,880.22
加权平均基金份额本期利润	-0.1293	-0.0810
本期加权平均净值利润率	-7.50%	-4.73%
本期基金份额净	-6.37%	-6.53%

值增长率		
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	57,457,048.23	49,876.56
期末可供分配基金份额利润	0.0434	0.0380
期末基金资产净值	2,448,091,882.72	2,423,758.56
期末基金份额净值	1.851	1.845
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	449.91%	-8.87%

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

嘉实优化红利混合 A

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	12.05%	1.07%	0.69%	0.80%	11.36%	0.27%
过去三个月	11.98%	1.35%	-3.45%	1.37%	15.43%	-0.02%
过去六个月	-6.37%	1.41%	-1.73%	1.41%	-4.64%	0.00%
过去一年	-15.57%	1.34%	-0.54%	1.25%	-15.03%	0.09%

过去三年	76.74%	1.42%	16.01%	1.12%	60.73%	0.30%
自基金合同生效起 至今	449.91%	1.42%	111.85%	1.35%	338.06 %	0.07%

嘉实优化红利混合 C

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	12.02%	1.07%	0.69%	0.80%	11.33%	0.27%
过去三个月	11.89%	1.35%	-3.45%	1.37%	15.34%	-0.02%
过去六个月	-6.53%	1.42%	-1.73%	1.41%	-4.80%	0.01%
自基金合同生效起 至今	-8.87%	1.33%	3.28%	1.28%	-12.15 %	0.05%

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：

$$\text{Return}(t) = 95\% \times \text{中证红利指数收益率}(t) + 5\% \times \text{上证国债指数收益率}(t)$$

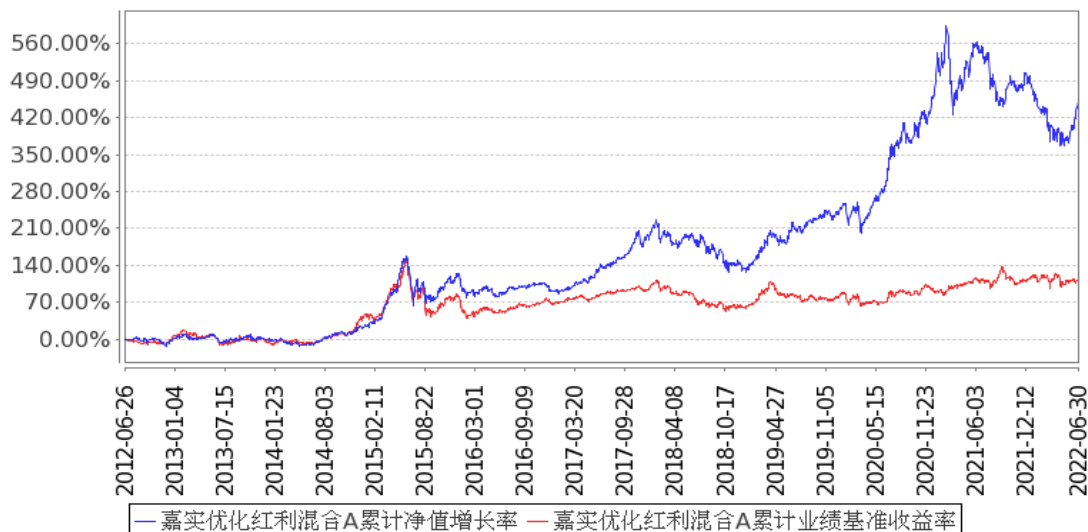
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

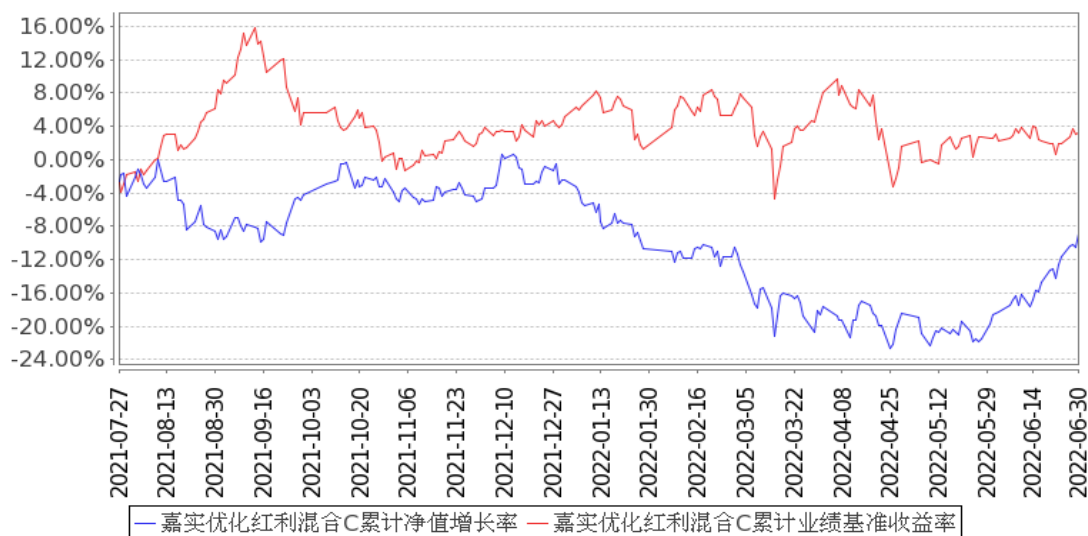
嘉实优化红利混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年06月26日至2022年06月30日)



嘉实优化红利混合C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07月27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		
常蓁	本基金、嘉实服务增值行业混合、嘉实回报混合、嘉实回报精选股票、嘉实品质回报混合、嘉实匠心回报混合基金经理	2018 年 10 月 11 日	-	15 年	曾任建信基金管理公司行业研究员。2010 年加入嘉实基金管理有限公司, 先后担任行业研究员及基金经理, 现任平衡风格投资总监。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、《嘉实优化红利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 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

回顾上半年，无论是国内外政治经济形势，还是证券市场均是波澜起伏的半年。政治经济形势方面，外部看，俄乌局势波谲云诡，全球能源粮食面临危机，美联储加息喋喋不休；内部看，海外疫情持续反复，国内疫情也经历了 2020 年以来最困难的一季，部分地区人民生活受到较大影响。在这样的背景下，国内稳增长促消费保生产政策持续加码，上半年市场也走出了史上罕见的“深 V”行情。2022 年上半年万德全 A 整体下跌 9.5%，上证 50 下跌 6.6%，沪深 300 下跌 9.2%，创业板指下跌 15.4%。市场在 1-4 月单边持续下跌，万德全 A 年内一度下跌近 30%，而从 5 月起，随着流动性的恢复，市场迎来了迅速的反弹，万德全 A 自底部反弹 23%，上证 50 反弹 14%，沪深 300 反弹 19%，创业板指更是反弹超过 30%。以光伏、新能源车为代表的成长板块迅速收复实地，部分标的再创新高。

2022 上半年 A/H 股整体公募基金收益率普遍录得负收益，股票基金平均收益率在-10%左右。行业层面上，板块间表现分化巨大，煤炭板块一直独秀，涨幅超过 20%，汽车、交运、消费者服务、食品饮料等疫后修复逻辑板块在 5 月以来的反弹中表现较好，电子、传媒、计算机、医药、轻工制造等表现较弱，跌幅接近或超过 20%。板块间估值的高度分化，疫情的演变与外部宏观的不确定性共振，带来了板块间、同板块季度间迥异的表现。大幅波动的行情对基金投资选股提出了更高的要求，也为权益类基金在年内获得高收益率带来更大的挑战。截止 2021 年底，公募基金基金总规模已经超过 25 万亿元，较 20 万亿的 2020 年底显著增加，更多的人选择通过专业的

机构分享权益市场的发展，这对于提升专业机构市场定价权、降低市场波动，优化资源配置都是有利的。这也是广大受托人对我们的信任。在市场剧烈波动中，基金净值的波动在所难免，如何在持仓上平衡短期避险与长期看好之间的关系，如何在控制好回撤幅度的情况下做好获得长期优质回报的准备，如何在市场剧烈下跌下坚守框架并买入持续看好的优质标的/板块，也是我们需要持续思考的方向。

本基金上半年持仓仍然主要集中在长期方向较好，稳定增长的优质个股上，并维持了相对较低的换手率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实优化红利混合 A 基金份额净值为 1.851 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.37%；截至本报告期末嘉实优化红利混合 C 基金份额净值为 1.845 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.53%；业绩比较基准收益率为-1.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

虽然当前我国面临的外部环境日趋复杂，全球范围内各种冲突、地缘政治风险和博弈仍在加剧，但我们依然长期看好中国的权益市场，这是中国相比海外显著的利率差、增长差、效率差决定的，中国具备全球范围内稀缺的稳健成长性，必然会成为全球资金的长期配置方向。

展望 2022 下半年，全球经济区域衰退，而在疫情防控“常态化”下，国内经济在波动中逐步走入复苏，稳经济政策持续发力，在全球范围具备比较性的优势，且货币端利率中枢下移是长期逻辑，“易松难紧”是大的方向。中微观层面，优质标的经历年初的大幅调整后，非热门板块估值整体上趋向合理，但部分热门行业交易较为拥挤，在前期反弹中涨幅较多，市场对于行业的景气和中短期趋势给予了较高溢价。因此，我们判断下半年仍然存在一定的结构性机会的。也坚持在继续努力挖掘战略性投资机会的同时，避免在热门板块“扎堆”，注重防范高估值风险。

我们主要从长期角度，把握下面的几类机会：1) 长期发展逻辑较好，竞争壁垒较高的以高端白酒、家电、医疗服务为代表的消费类优质个股；2) 在国际上具有竞争优势的制造业龙头；3) 商业模式稳定、长期空间较大、竞争优势明显、估值有吸引力的，符合经济转型需要的科技创新型企业。我们认为，以合理的价格买入优质公司并长期持有是持续获得超额回报的有效途径，希望从最本质的规律出发，在不确定的未来中寻找更确定的机会，继续优化组合，力求赢得长期稳定的回报。

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遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实优化红利混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：嘉实优化红利混合型证券投资基金

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	281,501,701.93	257,826,112.59
结算备付金		-	799,128.29
存出保证金		105,020.89	288,371.99
交易性金融资产	6.4.7.2	2,174,332,512.61	2,402,106,270.94
其中：股票投资		2,081,096,932.58	2,282,813,348.44
基金投资		-	-
债券投资		93,235,580.03	119,292,922.50
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		4,922,076.57	74,489.38
应收股利		-	-
应收申购款		1,573,127.88	2,258,938.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,705,263.15
资产总计		2,462,434,439.88	2,665,058,574.58
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		-	-
应付赎回款		8,260,861.05	5,047,933.83

应付管理人报酬		2,819,514.10	3,419,501.51
应付托管费		469,919.03	569,916.92
应付销售服务费		739.41	457.30
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	367,765.01	501,295.88
负债合计		11,918,798.60	9,539,105.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,324,240,956.02	1,343,508,696.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,126,274,685.26	1,312,010,773.05
净资产合计		2,450,515,641.28	2,655,519,469.14
负债和净资产总计		2,462,434,439.88	2,665,058,574.58

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，嘉实优化红利混合 A 基金份额净值 1.851 元，基金份额总额 1,322,927,136.34 份，嘉实优化红利混合 C 基金份额净值 1.845 元，基金份额总额 1,313,819.68 份，基金份额总额合计为 1,324,240,956.02 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实优化红利混合型证券投资基金

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 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
一、营业总收入		-152,580,913.57	259,742,684.81
1. 利息收入		516,789.89	2,969,022.23
其中：存款利息收入	6.4.7.13	493,658.30	377,386.87
债券利息收入		-	1,654,656.21
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		23,131.59	936,979.15
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		15,920,725.50	470,030,821.08
其中：股票投资收益	6.4.7.14	773,286.73	463,323,412.49
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	937,533.24	20,280.00
资产支持证券投资收	6.4.7.16	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	14,209,905.53	6,687,128.59
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	-169,303,228.21	-214,806,461.77
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	284,799.25	1,549,303.27
减：二、营业总支出		20,180,488.98	24,036,912.35
1. 管理人报酬		17,192,110.95	19,020,732.80
2. 托管费		2,865,351.77	3,170,122.14
3. 销售服务费		4,051.50	-
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		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	118,974.76	1,846,057.41
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-172,761,402.55	235,705,772.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-172,761,402.55	235,705,772.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-172,761,402.55	235,705,772.46

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实优化红利混合型证券投资基金

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	1,343,508,696.09	-	1,312,010,773.05	2,655,519,469.14

金净值)				
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)	1,343,508,696.09	-	1,312,010,773.05	2,655,519,469.14
三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列)	-19,267,740.07	-	-185,736,087.79	-205,003,827.86
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	-172,761,402.55	-172,761,402.55
(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)	-19,267,740.07	-	-12,974,685.24	-32,242,425.31
其中:1. 基 金 申 购 款	156,838,057.80	-	115,231,885.91	272,069,943.71
2 .基 金 赎 回 款	-176,105,797.87	-	-128,206,571.15	-304,312,369.02
(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)	1,324,240,956.02	-	1,126,274,685.26	2,450,515,641.28
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)	995,590,458.29	-	1,585,565,150.15	2,581,155,608.44
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)	995,590,458.29	-	1,585,565,150.15	2,581,155,608.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	154,785,477.65	-	105,094,611.54	259,880,089.19
(一)、综合收益总额	-	-	235,705,772.46	235,705,772.46
(二)、本期基金份额	154,785,477.65	-	204,610,587.55	359,396,065.20

交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	663,790,955.14	-	993,962,196.03	1,657,753,151.17
2. 基金赎回款	-509,005,477.49	-	-789,351,608.48	-1,298,357,085.97
（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）	-	-	-335,221,748.47	-335,221,748.47
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,150,375,935.94	-	1,690,659,761.69	2,841,035,697.63

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：

经雷

基金管理人负责人

梁凯

主管会计工作负责人

李袁

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实优化红利混合型证券投资基金(原名为嘉实优化红利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[2012]684号《关于核准嘉实优化红利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《嘉实优化红利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,《嘉实优化红利股票型证券投资基金基金合同》于2012年6月26日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为588,616,310.91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》、《嘉实优化红利混合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业务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 257,826,112.59 元、799,128.29 元、288,371.99 元、1,705,263.15 元、74,489.38 元和 2,258,938.24 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 257,847,264.05 元、799,487.89 元、288,501.69 元、0.00 元、74,489.38 元和 2,258,982.50 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 2,402,106,270.94 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 2,403,789,849.07 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,047,933.83 元、3,419,501.51 元、569,916.92 元、457.30 元、274,141.51 元和 227,154.37 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、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 5,047,933.83 元、3,419,501.51 元、569,916.92 元、457.30 元、274,141.51 元和 227,154.37 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	281,501,701.93
等于：本金	281,477,604.93
加：应计利息	24,097.00
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	281,501,701.93

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	1,663,718,103.45	-	2,081,096,932.58	417,378,829.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	21,928,954.30	212,774.70	22,128,599.20	-13,129.80
	银行间市场	69,873,640.00	1,067,980.83	71,106,980.83	165,360.00

	合计	91,802,594.30	1,280,755.53	93,235,580.03	152,230.20
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,755,520,697.75	1,280,755.53	2,174,332,512.61	417,531,059.33

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

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

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	23,685.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	146,950.76
其中：交易所市场	146,600.76
银行间市场	350.00
应付利息	-
预提费用	197,128.42
合计	367,765.01

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实优化红利混合 A

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	1,342,610,378.58	1,342,610,378.58
本期申购	155,915,214.78	155,915,214.78
本期赎回（以“-”号填列）	-175,598,457.02	-175,598,457.02
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	1,322,927,136.34	1,322,927,136.34

嘉实优化红利混合 C

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	898,317.51	898,317.51
本期申购	922,843.02	922,843.02

本期赎回（以“-”号填列）	-507,340.85	-507,340.85
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	1,313,819.68	1,313,819.68

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

嘉实优化红利混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	61,755,967.39	1,249,379,550.64	1,311,135,518.03
本期利润	-3,452,380.26	-169,212,142.07	-172,664,522.33
本期基金份额交易产生的变动数	-846,538.90	-12,459,710.42	-13,306,249.32
其中：基金申购款	6,431,087.08	108,124,125.97	114,555,213.05
基金赎回款	-7,277,625.98	-120,583,836.39	-127,861,462.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,457,048.23	1,067,707,698.15	1,125,164,746.38

嘉实优化红利混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	39,434.67	835,820.35	875,255.02
本期利润	-5,794.08	-91,086.14	-96,880.22
本期基金份额交易产生的变动数	16,235.97	315,328.11	331,564.08
其中：基金申购款	34,358.59	642,314.27	676,672.86
基金赎回款	-18,122.62	-326,986.16	-345,108.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,876.56	1,060,062.32	1,109,938.88

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	488,154.61
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	3,581.15
其他	1,922.54
合计	493,658.30

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	773,286.73
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	773,286.73

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	157,129,569.44
减：卖出股票成本总额	155,923,171.26
减：交易费用	433,111.45
买卖股票差价收入	773,286.73

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	1,062,026.40
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-124,493.16
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	937,533.24

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	71,031,669.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	69,469,121.10

本总额	
减：应计利息总额	1,686,669.00
减：交易费用	372.06
买卖债券差价收入	-124,493.16

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

无。

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	14,209,905.53
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	14,209,905.53

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	-169,303,228.21
股票投资	-169,488,707.01
债券投资	185,478.80
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	-169,303,228.21

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	264,408.56
基金转出费收入	20,390.69
合计	284,799.25

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	4,846.34
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	118,974.76

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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	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
当期发生的基金应支付的管理费	17,192,110.95	19,020,732.80
其中：支付销售机构的客户维护费	5,170,198.58	2,979,188.48

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	2,865,351.77	3,170,122.14

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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实优化红利混合 A	嘉实优化红利混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	1,072.52	1,072.52
中国银行	-	-	-
嘉实财富	-	-	-
合计	-	1,072.52	1,072.52
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	嘉实优化红利混合 A	嘉实优化红利混合 C	合计
合计	-	-	-

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天

数。(2) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司_活期	281,501,701.93	488,154.61	568,125,780.39	340,792.28

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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	-

		日									
301148	嘉戎技术	2022年 4月14日	6个月	新股锁定	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40		-
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	857	65,611.92	44,495.44		-
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	2022年	6个月	新股锁	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-

	化学	4月7日		定							
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	4,284	73,984.68	63,531.72		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96		-
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	2,076	100,865.92	65,144.88		-
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	-
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	12,181	2,004,261.74	835,494.79	-
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	-
688295	中复神鹰	2022年 3月28日	6个月	新股锁定	29.33	34.42	13,998	410,561.34	481,811.16	-
688331	荣昌生物	2022年 3月24日	6个月	新股锁定	48.00	42.94	15,915	763,920.00	683,390.10	-
688400	凌云光	2022年 6月27日	6个月	新股锁定	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，属较高风险、较高收益的品种。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主要投资于盈利增长稳定的红利股票，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。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 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	281,501,701.93	-	-	-	281,501,701.93
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	105,020.89	-	-	-	105,020.89

交易性金融资产	93,235,580.03	-	-	-2,081,096,932.58	2,174,332,512.61
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,922,076.57	4,922,076.57
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,573,127.88	1,573,127.88
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	374,842,302.85	-	-	-2,087,592,137.03	2,462,434,439.88
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,260,861.05	8,260,861.05
应付管理人报酬	-	-	-	2,819,514.10	2,819,514.10
应付托管费	-	-	-	469,919.03	469,919.03
应付销售服务费	-	-	-	739.41	739.41
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	-	-	-	367,765.01	367,765.01
负债总计	-	-	-	11,918,798.60	11,918,798.60
利率敏感度缺口	374,842,302.85	-	-	-2,075,673,338.43	2,450,515,641.28
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	257,826,112.59	-	-	-	257,826,112.59
结算备付金	799,128.29	-	-	-	799,128.29
存出保证金	288,371.99	-	-	-	288,371.99
交易性金融资产	119,292,922.50	-	-	-2,282,813,348.44	2,402,106,270.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	74,489.38	74,489.38
应收利息	-	-	-	1,705,263.15	1,705,263.15
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,258,938.24	2,258,938.24
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	378,206,535.37	-	-	-2,286,852,039.21	2,665,058,574.58
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	-	-	5,047,933.83	5,047,933.83
应付管理人报酬	-	-	3,419,501.51	3,419,501.51
应付托管费	-	-	569,916.92	569,916.92
应付销售服务费	-	-	457.30	457.30
应付交易费用	-	-	274,141.51	274,141.51
应付税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	227,154.37	227,154.37
负债总计	-	-	9,539,105.44	9,539,105.44
利率敏感度缺口	378,206,535.37	-	-2,277,312,933.77	2,655,519,469.14

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	-74,736.19	-117,067.42
	市场利率下降 25 个基点	74,938.19	117,348.17

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	2,081,096,932.58	84.92	2,282,813,348.44	85.96
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	2,081,096,932.58	84.92	2,282,813,348.44	85.96

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%	66,241,466.70	23,161,234.91

	业绩比较基准下降 5%	-66,241,466.70	-23,161,234.91
--	----------------	----------------	----------------

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	2,076,708,694.16	2,279,748,770.32
第二层次	94,242,574.87	122,357,500.62
第三层次	3,381,243.58	-
合计	2,174,332,512.61	2,402,106,270.94

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	2,081,096,932.58	84.51
	其中：股票	2,081,096,932.58	84.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	93,235,580.03	3.79
	其中：债券	93,235,580.03	3.79
	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	281,501,701.93	11.43
8	其他各项资产	6,600,225.34	0.27
9	合计	2,462,434,439.88	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,557,247,264.17	63.55
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	35,089,809.76	1.43
G	交通运输、仓储和邮政业	21,880.98	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,462,965.49	3.49
J	金融业	89,938,220.87	3.67
K	房地产业	140,607,911.70	5.74
L	租赁和商务服务业	106,829,079.56	4.36
M	科学研究和技术服务业	13,597,256.37	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	278,945.50	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	52,023,598.18	2.12
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,081,096,932.58	84.92

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	600519	贵州茅台	105,054	214,835,430.00	8.77
2	600809	山西汾酒	481,917	156,526,641.60	6.39
3	000858	五粮液	730,134	147,435,958.62	6.02
4	600048	保利发展	8,053,145	140,607,911.70	5.74
5	002311	海大集团	1,896,941	113,835,429.41	4.65
6	601888	中国中免	458,546	106,809,119.78	4.36
7	603369	今世缘	2,087,913	106,483,563.00	4.35
8	603179	新泉股份	3,516,323	101,973,367.00	4.16
9	600036	招商银行	2,119,606	89,447,373.20	3.65
10	601799	星宇股份	520,338	88,977,798.00	3.63
11	000661	长春高新	373,884	87,272,003.28	3.56
12	300760	迈瑞医疗	272,228	85,261,809.60	3.48
13	002410	广联达	1,544,500	84,082,580.00	3.43
14	300750	宁德时代	154,878	82,704,852.00	3.37
15	000568	泸州老窖	321,085	79,160,295.90	3.23
16	300628	亿联网络	1,024,826	78,040,499.90	3.18
17	002415	海康威视	2,097,526	75,930,441.20	3.10
18	603833	欧派家居	458,613	69,103,806.84	2.82

19	300015	爱尔眼科	1,157,337	51,813,977.49	2.11
20	300122	智飞生物	447,107	49,633,348.07	2.03
21	301177	迪阿股份	472,591	35,066,252.20	1.43
22	000651	格力电器	305,495	10,301,291.40	0.42
23	603259	药明康德	86,100	8,953,539.00	0.37
24	688105	诺唯赞	45,636	3,874,496.40	0.16
25	688120	华海清科	4,822	1,197,784.80	0.05
26	688326	经纬恒润	6,832	1,004,713.92	0.04
27	688220	翱捷科技	12,181	835,494.79	0.03
28	688568	中科星图	11,020	746,715.20	0.03
29	688331	荣昌生物	15,915	683,390.10	0.03
30	300888	稳健医疗	10,265	682,622.50	0.03
31	688301	奕瑞科技	1,227	580,420.08	0.02
32	300896	爱美客	851	510,608.51	0.02
33	002142	宁波银行	13,707	490,847.67	0.02
34	688295	中复神鹰	13,998	481,811.16	0.02
35	688234	天岳先进	6,759	440,619.21	0.02
36	688131	皓元医药	2,737	388,900.33	0.02
37	688238	和元生物	12,836	349,909.36	0.01
38	301207	华兰疫苗	5,687	336,163.36	0.01
39	688606	奥泰生物	2,703	328,738.86	0.01
40	688167	炬光科技	2,014	299,582.50	0.01
41	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.01
42	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.01
43	688182	灿勤科技	16,055	236,490.15	0.01
44	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.01
45	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.01
46	688059	华锐精密	1,023	141,153.54	0.01
47	688733	壹石通	1,909	140,101.51	0.01
48	688259	创耀科技	1,595	128,509.15	0.01
49	688257	新锐股份	2,899	114,858.38	0.00
50	301238	瑞泰新材	3,497	112,148.79	0.00
51	688575	亚辉龙	4,809	100,604.28	0.00
52	688609	九联科技	10,372	86,502.48	0.00
53	688798	艾为电子	566	76,908.08	0.00
54	688229	博睿数据	1,643	66,541.50	0.00
55	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
56	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
57	301217	铜冠铜箔	4,284	63,531.72	0.00
58	688511	天微电子	1,490	55,785.60	0.00
59	688314	康拓医疗	1,085	52,676.75	0.00
60	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00

61	688260	昀冢科技	2,990	48,079.20	0.00
62	688350	富淼科技	2,552	45,910.48	0.00
63	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
64	300973	立高食品	393	40,852.35	0.00
65	688109	品茗股份	1,301	40,200.90	0.00
66	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
67	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
68	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
69	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
70	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
71	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
72	300900	广联航空	882	23,549.40	0.00
73	000596	古井贡酒	93	23,218.38	0.00
74	301039	中集车辆	2,064	22,353.12	0.00
75	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
76	300873	海晨股份	774	21,880.98	0.00
77	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
78	300872	天阳科技	1,568	20,901.44	0.00
79	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
80	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
81	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
82	688819	天能股份	540	18,673.20	0.00
83	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
84	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
85	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
86	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
87	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
88	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
89	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
90	300890	翔丰华	286	15,821.52	0.00
91	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
92	300909	汇创达	579	14,886.09	0.00
93	301168	通灵股份	329	14,831.32	0.00
94	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
95	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
96	300891	惠云钛业	1,143	13,796.01	0.00
97	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
98	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
99	301222	浙江恒威	415	12,169.46	0.00
100	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
101	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
102	300864	南大环境	536	11,256.00	0.00

103	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
104	300895	铜牛信息	374	10,853.48	0.00
105	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
106	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
107	300962	中金辐照	657	9,920.70	0.00
108	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
109	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
110	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
111	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
112	300882	万胜智能	572	8,145.28	0.00
113	301193	家联科技	297	8,063.55	0.00
114	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
115	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
116	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
117	300955	嘉亨家化	314	7,699.28	0.00
118	300889	爱克股份	479	6,840.12	0.00
119	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
120	300963	中洲特材	330	6,395.40	0.00
121	300992	泰福泵业	298	6,350.38	0.00
122	300886	华业香料	191	5,936.28	0.00
123	300892	品渥食品	72	2,156.40	0.00
124	300863	卡倍亿	21	1,554.42	0.00
125	301013	利和兴	107	1,282.93	0.00
126	300943	春晖智控	63	989.73	0.00
127	300901	中胤时尚	11	103.51	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	300750	宁德时代	64,992,587.70	2.45
2	301177	迪阿股份	32,892,192.48	1.24
3	688220	翱捷科技	2,004,261.74	0.08
4	688297	中无人机	1,204,908.10	0.05
5	688223	晶科能源	1,065,000.00	0.04
6	301236	软通动力	1,008,003.28	0.04
7	688349	三一重能	972,970.00	0.04
8	688326	经纬恒润	826,672.00	0.03
9	688331	荣昌生物	763,920.00	0.03
10	301217	铜冠铜箔	739,691.37	0.03
11	301238	瑞泰新材	670,647.88	0.03
12	688120	华海清科	658,974.52	0.02

13	301200	大族数控	655,812.96	0.02
14	688234	天岳先进	559,577.61	0.02
15	301219	腾远钴业	556,909.98	0.02
16	688207	格灵深瞳	528,810.59	0.02
17	688153	唯捷创芯	511,088.40	0.02
18	688047	龙芯中科	501,200.70	0.02
19	688279	峰昭科技	451,410.00	0.02
20	301150	中一科技	438,995.04	0.02

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600036	招商银行	54,523,290.32	2.05
2	300015	爱尔眼科	32,511,945.99	1.22
3	601799	星宇股份	13,190,953.00	0.50
4	000651	格力电器	12,532,228.93	0.47
5	603259	药明康德	12,032,303.00	0.45
6	000661	长春高新	4,908,813.00	0.18
7	688223	晶科能源	2,671,056.70	0.10
8	688297	中无人机	2,059,392.66	0.08
9	688032	禾迈股份	1,731,201.95	0.07
10	688349	三一重能	1,297,577.06	0.05
11	301238	瑞泰新材	1,134,174.38	0.04
12	688047	龙芯中科	795,228.33	0.03
13	301217	铜冠铜箔	734,883.00	0.03
14	301236	软通动力	711,005.80	0.03
15	688072	拓荆科技	546,579.64	0.02
16	688798	艾为电子	518,564.18	0.02
17	301200	大族数控	513,537.70	0.02
18	301219	腾远钴业	478,855.80	0.02
19	301215	中汽股份	434,754.35	0.02
20	688119	中钢洛耐	406,446.60	0.02

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	123,695,462.41
卖出股票收入（成交）总额	157,129,569.44

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	42,280,443.04	1.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,955,136.99	2.08
	其中：政策性金融债	50,955,136.99	2.08
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	93,235,580.03	3.80

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	210407	21 农发 07	500,000	50,955,136.99	2.08
2	019666	22 国债 01	218,830	22,128,599.20	0.90
3	220001	22 付息国债 01	100,000	10,113,232.88	0.41
4	220009	22 付息国债 09	100,000	10,038,610.96	0.41

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

无。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，其中，招商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。

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	105,020.89
2	应收清算款	4,922,076.57
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,573,127.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,600,225.34

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

份额级别	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 (%)

嘉实优化红利混合 A	252,293	5,243.61	31,051,787.34	2.35	1,291,875,349.00	97.65
嘉实优化红利混合 C	396	3,317.73	-	-	1,313,819.68	100.00
合计	252,501	5,244.50	31,051,787.34	2.34	1,293,189,168.68	97.66

注：(1)嘉实优化红利混合 A:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实优化红利混合 A 份额占嘉实优化红利混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实优化红利混合 A 份额占嘉实优化红利混合 A 总份额比例；

(2)嘉实优化红利混合 C:机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实优化红利混合 C 份额占嘉实优化红利混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实优化红利混合 C 份额占嘉实优化红利混合 C 总份额比例。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	嘉实优化红利混合 A	325,188.30	0.02
	嘉实优化红利混合 C	249.25	0.02
	合计	325,437.55	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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	嘉实优化红利混合 A	0~10
	嘉实优化红利混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实优化红利混合 A	0
	嘉实优化红利混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实优化红利混合 A	嘉实优化红利混合 C
基金合同生效日 (2012年6月26日)	588,616,310.91	-

基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	1,342,610,378.58	898,317.51
本报告期基金总申购份额	155,915,214.78	922,843.02
减：本报告期基金总赎回份额	175,598,457.02	507,340.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,322,927,136.34	1,313,819.68

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 (%)	
广发证券股份有限公司	4	152,087,633.01	59.64	106,461.67	59.64	-
光大证券股份有限公司	2	74,459,528.13	29.20	52,121.70	29.20	-
方正证券股份有限公司	5	20,916,902.69	8.20	14,641.82	8.20	-
国泰君安证券股份有限公司	3	7,550,285.79	2.96	5,285.23	2.96	-
安信证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

东北证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	5	-	-	-	-	-
华西证券股份有限	3	-	-	-	-	-

公司						
联储证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
平安证券 股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	3	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西部证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
西南证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
信达证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	3	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券 有限公司	2	-	-	-	-	-
英大证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
中国国际 金融股份 有限公司	5	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	5	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	4	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	10	-	-	-	-	-
中银国际 证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-

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. 新时代证券股份有限公司更名为诚通证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：中信证券华南股份有限公司退租交易单元 2 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：德邦证券股份有限公司新增交易单元 2 个，第一创业证券股份有限公司新增交易单元 2 个，华融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 (%)
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	267,100,000.00	100.00	-	-
方正证券股份有限公司	21,928,954.30	100.00	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
诚通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
宏信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-

有限 责任 公司						
民生证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
平安证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
天风证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
西部证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
西南证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
湘财证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
信达证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
野村东 方国 际证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
英大证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
招商证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-
浙商证 券有 限公 司	-	-	-	-	-	-

中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 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
2	关于调整北京雪球基金销售有限公司代销嘉实旗下部分基金最低持有和最低赎回份额的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022年5月30日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实优化红利股票型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实优化红利混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实优化红利混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实优化红利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) 报告期内嘉实优化红利混合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