

# 嘉实基础产业优选股票型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 25 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期中的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	嘉实基础产业优选股票
基金主代码	009126
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 月 15 日
报告期末基金份额总额	179,661,119.48 份
投资目标	本基金主要在基础产业中优选公司质地优良并具有长期回报潜力的个股，力争在风险可控的前提下获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金聚焦投资于基础产业领域，主要集中在基础设施、基础工业和基础服务等领域。本基金将重点配置行业景气度较高、发展前景良好、技术基本成熟、政策重点扶持的基础产业子行业，优选长期竞争力突出、具有长期回报潜力的优质公司进行投资。具体包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证全指资本品指数收益率*30%+中证全指运输指数收益率*30%+中证全指原材料指数收益率*20%+恒生指数收益率*5%+中债综合财富指数收益率*15%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，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。本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。
基金管理人	嘉实基金管理有限公司

基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	嘉实基础产业优选股票 A	嘉实基础产业优选股票 C
下属分级基金的交易代码	009126	009127
报告期末下属分级基金的份额总额	160,022,676.97 份	19,638,442.51 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日）	
	嘉实基础产业优选股票 A	嘉实基础产业优选股票 C
1. 本期已实现收益	2,346,123.48	110,777.99
2. 本期利润	-30,236,364.58	-2,715,198.36
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1845	-0.2505
4. 期末基金资产净值	173,666,681.86	21,053,808.62
5. 期末基金份额净值	1.0853	1.0721

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实基础产业优选股票 A

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	-14.50%	1.27%	-10.56%	0.99%	-3.94%	0.28%
过去六个月	-9.57%	1.50%	-4.84%	1.25%	-4.73%	0.25%
过去一年	-22.16%	1.59%	-11.86%	1.16%	-10.30%	0.43%
自基金合同生效起至今	8.53%	1.36%	26.42%	1.09%	-17.89%	0.27%

嘉实基础产业优选股票 C

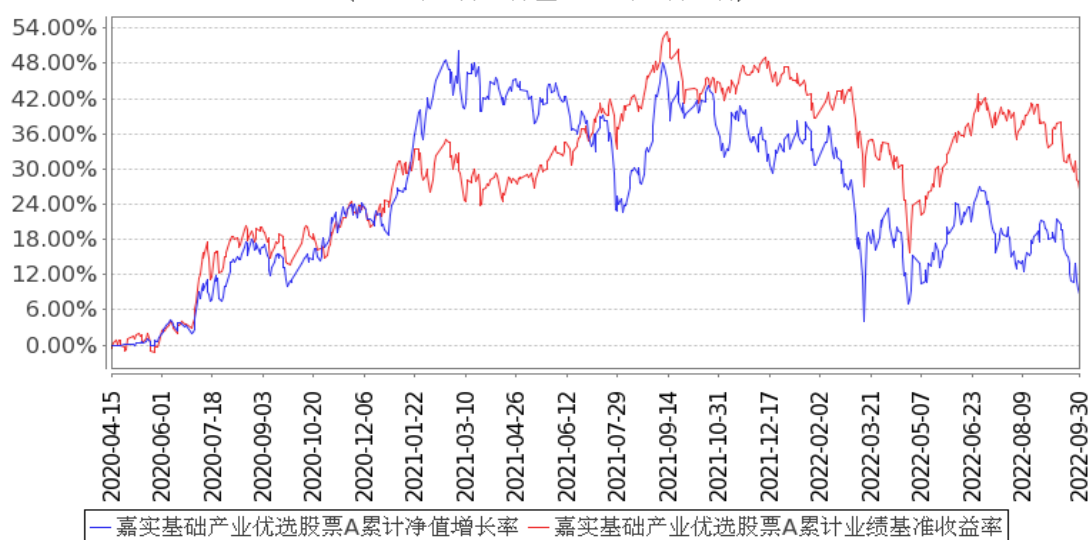
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	-14.61%	1.27%	-10.56%	0.99%	-4.05%	0.28%
过去六个月	-9.80%	1.50%	-4.84%	1.25%	-4.96%	0.25%
过去一年	-22.54%	1.59%	-11.86%	1.16%	-10.68%	0.43%
自基金合同 生效起至今	7.21%	1.36%	26.42%	1.09%	-19.21%	0.27%

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

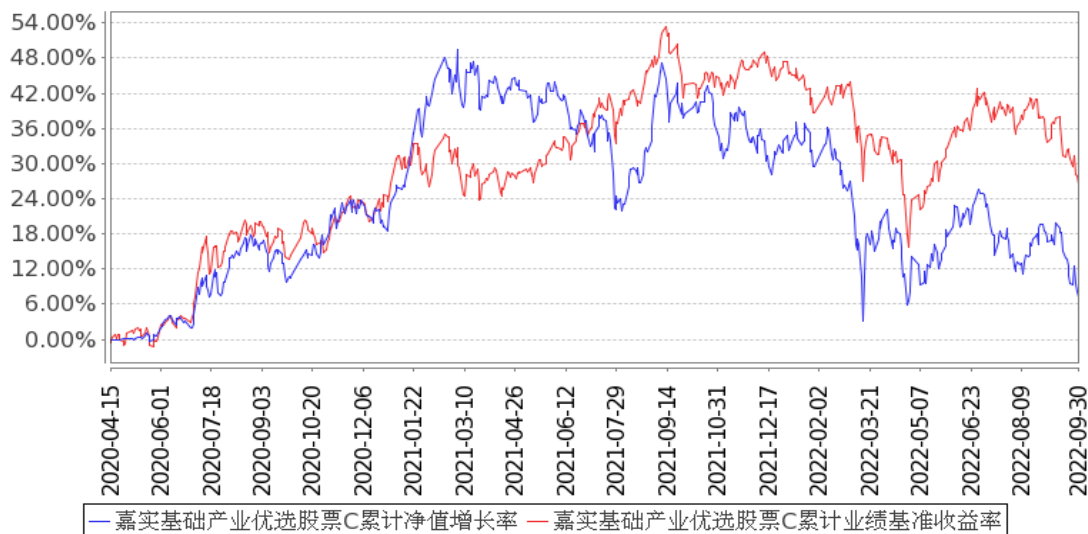
#### 嘉实基础产业优选股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势 对比图

(2020年04月15日至2022年09月30日)



### 嘉实基础产业优选股票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

(2020年04月15日至2022年09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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
肖觅	本基金、嘉实研究精选混合、嘉实周期优选混合、嘉实研究阿尔法股票、嘉实新财富混合、嘉实物流产业股票、嘉实核心蓝筹混合、嘉实品质	2020年4月15日	-	13年	2009年7月加入嘉实基金管理有限公司任职于研究部，先后任钢铁行业、交通运输行业研究员等职位，现任大周期研究总监。管理学硕士，具有基金从业资格。中国国籍。

蓝筹一年 持有期混 合基金经 理				
---------------------------	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
肖觅	公募基金	8	8,741,592,926.03	2016年12月29日
	私募资产管理计划	1	495,547,428.09	2022年3月24日
	其他组合	-	-	-
	合计	9	9,237,140,354.12	-

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、《嘉实基础产业优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

##### 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，均为不同基金经理管理的组合间因投资策略

不同而发生的反向交易，未发现不公平交易和利益输送行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度权益市场总体呈现单边下跌走势，中证 800 下跌 14.28%，恒生指数下跌 21.21%，全球市场基本也以下跌为主。虽然三季度从结构上来看个别子行业出现过短暂的交易性机会，但也很快出现调整，没有带来有意义的结果。从定价逻辑上来看，股价是市场对未来现金流折现的一致预期，那么这种下跌无非就是对未来的预期变差，或者对权益资产的要求回报率（折现率）变高。从常用的 DCF 折现模型的各个因子去划分，在策略研究的角度，基本面层面需要讨论现状是否有变化，以及远期预期是否跟随出现变化；折现率层面需要讨论无风险利率是否有变化，以及对不确定性给出的定价因子：权益风险溢价是否有变化。

当期基本面的层面，看到了几点变化：暑期传统旅游旺季到来后，疫情在全国多点散发，继续对正常的经济活动带来干扰。7 月中旬房地产“断贷”事件打击对新房市场的信心，房地产销售短暂回暖后重新转头向下，连带房地产相关的产业链也持续有收入端的压力。出口在高基数下增速逐渐开始下行，对制造业企业而言意味着景气的环比明显变化。此外，前期影响较大的地缘局势和能源价格等因素，在三季度暂时没有发生实质性变化。

看到了当期的这些变化，接下来要讨论的预期层面的问题：这些偏负面的变化会不会带来中长期的影响。对这个问题不同投资者有不同的判断，对这个层面的分歧也是超额收益最重要的来源之一。一般逻辑，或者说线性思维模式的逻辑下，现实状况的变化会被相当程度的放大为远期预判的同向变化，一致预期发生了变化就会导致股价出现波动，且这种放大效应往往意味着股价的波动要大于公司实际基本面的波动。但因为真实世界中的市场主体是具有主观能动性的，线性外推出来的结果经常和最终实际发生的情形有着较大偏差，那么能跳出线性思维，给出更接近真实世界判断的投资者就能够获得超额回报。最典型的例子就是周期行业的运行逻辑：当前行业非常景气，于是市场觉得未来也会很好，预期好到一定程度就会让市场找到各种方式解释这种好是能持续的（“估值仍有上行空间”）；但事实是这种好大概率会吸引产业资本加大对这个行业的投资（主观能动性的体现），在未来两年带来产能过剩，景气最终还是出现下行。

针对我们当前看到的一些基本面层面的变化，很显然市场已经根据这些变化线性外推到至少在一定期限内，这些偏不利的变化不会看到明显的改善。这里就需要思考，相关主体是不是会主动采取一定的行动，去改变现在不利的状况。以房地产的问题为例，当前的悲观预期和销售端迟迟无法出现明显改善是相关的，关注行业的相关方也基本形成了共识，销售端的改善涉及到信心问题、购买力问题、收入预期问题，要马上反转很难。但同时我们已经可以看到已经有大量来自中央和各地方的支持性政策在出台，涵盖范围涉及融资、交付、按揭、利率、税收等各个方面，

实际上主观能动性已经出现。那么，一旦这些政策开始体现出合力，或者有一些真正有突破性的政策在后续出现，开始给到潜在购房者足够强的信心、给到潜在购房者实实在在的支持，断崖式的销售下滑是否就有出现改善的可能？这里就是一个非线性变化可能出现的潜在位置。接下来就可以在这个位置上去跟踪是否能看到量变引发的质变。同样的，疫情防控、出口走弱等因素，也可以建立起类似框架，去观察是否有一些关键因素可以带来相关行业基本面出现非线性的改善。回到定价模型来看，对远期的线性外推已经充分定价的情况下，人的这种主动求变就有可能带来权益市场的机会，而从改革开放 40 多年的历史来看，我们有个基本信仰就是中国人民极强的市场适应能力和主观能动性，市场悲观有悲观的道理，但反过来一定是蕴含着机会的。

折现率的层面，无风险利率的变化，当前影响最大的因素是美联储的货币政策。基金经理不是海外宏观经济专家，会更倾向于把其作为外生变量去处理，简单逻辑来看如果因为供给端约束改善，通胀缓解，有可能看到更友好的货币政策。折现率层面另一个影响因素来自权益风险溢价，这一块简单理解就是对于不确定性的定价。2022 年以来，在地缘局势、能源价格、疫情防控、中美关系等方面确实看到了比往年大得多的不确定性，这种不确定性就要求权益资产有更高的回报来补偿。同时也要注意的，经过 19、20 年的结构性牛市，市场上有相当多的资产给到了相对饱满的估值，也就意味着相对不高的未来回报，在不确定性加强的背景下自然出现了相当幅度的回调。还是用类似的思维方式去分析，首先这些不确定性到底对相关公司有多大影响，其次这些不确定性是否能逐渐看到变得确定的曙光。既然是不确定性，在这些点上做判断意义不大，但定性、主观的看，地缘局势、能源价格、疫情防控这几个因素是在逐渐看清方向，变得更为确定的。

结论上，从策略研究的角度我们对市场并不悲观。回到 DCF 折现模型上也基本可以看到有相当多的资产具备了足够强的吸引力，预期回报是足够丰富的。在这个展望下我们继续去实践低波动权益投资的方法论。

首先遇到的不利因素在于，虽然市场经历了调整，回报率在提升，继续看到绝对回撤的风险在变小，但在这个时间点，单一资产的波动率实际上是在放大的。大部分权益市场的熊市底部，或者大部分处在 deep value 状态的个股，都有波动率阶段性放大的特征。这种情况下，我们的基本处理方式一是用适当的分散去尽量降低整个组合的波动率，二是强调估值在抵抗绝对回撤上的重要意义，另外在风险定位偏高的组合上，我们在现在这个时间点也并不完全机械的强调低波动，既然对市场不悲观，那么在市场的底部还是需要向波动要收益，跳出线性思维，找到非线性变化的行业，去获得超额回报。

其次需要讨论，哪些子版块能够满足我们对预期回报的要求，同时提供相对更低的波动率。现状来看，市场其实是分层的，比如港股市场，我们觉得整体上有很高的预期回报空间，继续出



现大幅回撤的可能性也不大，但确实会面临更高的波动率；而 A 股市场，有越来越多的板块具备足够有吸引力的预期回报，其中部分行业的波动率应该是非常可控的，但也有一部分行业仍然面临基本面的不确定性。具体线索层面，举几个例子，比较容易理解的银行、水电燃气等板块波动率完全符合我们的要求，预期回报没有那么丰厚，但也满足权益资产应该有的回报率。另外比如疫后复苏相关的板块，仍然面对一定的不确定性，波动率会明显更大，但如果看到了第四针疫苗或者二价疫苗开始普及（主观能动性开始体现），基本面非线性地出现好转的概率会明显增加，可能会成为一次空间更大投资机会的起点。

我们从上述理解出发，构建我们的组合。具体到基础产业这只基金，我们重点做两件事情，一是 A 股部分用相对分散的方式，寻找一些风险收益比合适的行业进行投资，其中包括我们长期看好的快递行业，包括能明显提供较低波动率的燃气、水电等行业，目标是在相对较低的波动率下给组合提供符合权益资产基本要求的回报。二是在港股市场整体上具备非常高预期回报空间的情况下，持续维持港股的高配置。虽然港股市场可能仍然会面临着较大的波动，但一方面我们看到港股市场给出了明显的机会，在现在这个时间点继续机械的强调低波动没有太大的意义，另一方面我们在港股市场的投资也尽量在行业上做好分散，以一定程度对抗这种波动。从阶段性结果来看，港股市场的波动确实超出我们的预期，在组合上体现为净值的阶段性较大幅度回撤，但我们有一个很强的主观判断：现在就是向波动要收益的最好时间点，我们仍然非常、非常、非常看好港股市场未来的表现。

希望我们能通过自己的努力，真正做到实现权益投资应该有的较为丰厚回报的同时，尽可能降低组合波动率，提升基金持有人的持有体验。也希望通过整个基金行业的努力，让市场进行更有利于社会发展的资源配置，真正达成金融服务实体经济这个目标。感谢基金持有人对我们一直以来的信任！

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实基础产业优选股票 A 基金份额净值为 1.0853 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.50%；截至本报告期末嘉实基础产业优选股票 C 基金份额净值为 1.0721 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.61%；业绩比较基准收益率为-10.56%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

## § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	182,744,928.79	93.59
	其中：股票	182,744,928.79	93.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,624,052.49	1.34
	其中：债券	2,624,052.49	1.34
	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	9,845,785.61	5.04
8	其他资产	51,954.40	0.03
9	合计	195,266,721.29	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 82,297,935.03 元，占基金资产净值的比例为 42.26%。

## 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	524,780.00	0.27
B	采矿业	1,249,766.00	0.64
C	制造业	15,134,897.65	7.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,638,624.14	13.17
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	215,271.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	44,441,152.69	22.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,820.62	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,149,176.00	4.19
L	租赁和商务服务业	4,782,156.00	2.46
M	科学研究和技术服务业	235,146.16	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	15,203.50	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	100,446,993.76	51.59

## 5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	19,390,470.05	9.96
非必需消费品	31,565,860.44	16.21
必需消费品	-	-
能源	643,961.28	0.33
金融	-	-
医疗保健	1,837,867.30	0.94
工业	15,569,030.16	8.00
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	12,341,083.80	6.34
公用事业	949,662.00	0.49
合计	82,297,935.03	42.26

## 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	3690 HK	美团-W	120,000	17,973,031.68	9.23
2	002120	韵达股份	1,070,107	16,747,174.55	8.60
3	600233	圆通速递	700,250	14,530,187.50	7.46
4	700 HK	腾讯控股	58,000	13,974,683.33	7.18
5	600803	新奥股份	591,700	10,981,952.00	5.64
6	600886	国投电力	980,161	10,526,929.14	5.41
7	1055 HK	中国南方航空股份	2,500,000	9,360,954.00	4.81
8	667 HK	中国东方教育	3,600,000	8,465,558.40	4.35
9	1030 HK	新城发展	5,000,000	8,320,848.00	4.27
10	601155	新城控股	466,200	8,149,176.00	4.19

## 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	2,624,052.49	1.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,624,052.49	1.35

#### 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	019674	22 国债 09	26,000	2,624,052.49	1.35

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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

无。

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

无。

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

无。

#### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

##### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

##### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 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	23,698.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	28,255.04
4	应收利息	-
5	应收申购款	0.47
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	51,954.40

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实基础产业优选股票 A	嘉实基础产业优选股票 C
报告期期初基金份额总额	168,304,499.34	9,978,431.03
报告期期间基金总申购份额	2,170,142.41	12,928,437.08
减：报告期期间基金总赎回份额	10,451,964.78	3,268,425.60
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	160,022,676.97	19,638,442.51

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

### 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	2022-07-01 至 2022-09-30	70,968,839.95	-	-	70,968,839.95	39.50
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基础产业优选股票型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实基础产业优选股票型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实基础产业优选股票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) 报告期内嘉实基础产业优选股票型证券投资基金公告的各项原稿。

## 9.2 存放地点

- 1) 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) 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼中国建设银行投资托管业务部

## 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 10 月 25 日