

嘉实基础产业优选股票型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 24 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 2022 年 01 月 01 日起至 2022 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	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
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	18
§ 5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	27

§ 8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	64
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	64
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	64
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	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 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	73
§ 13 备查文件目录	73
13.1 备查文件目录	73
13.2 存放地点	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实基础产业优选股票型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	228,321,307.57 份	
基金合同存续期	不定期	
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	208,875,948.73 份	19,445,358.84 份

2.2 基金产品说明

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。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-60637103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-600-8800	021-60637228

传真	(010)65215588	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号1806A单元	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100005	100033
法定代表人	经雷	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
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	报告期(2022年1月1日-2022年12月31日)		报告期(2021年1月1日-2021年12月31日)		2020年4月15日(基金合同生效日)-2020年12月31日	
	嘉实基础产业 优选股票 A	嘉实基础产业 优选股票 C	嘉实基础产业 优选股票 A	嘉实基础产业 优选股票 C	嘉实基础产业 优选股票 A	嘉实基础产业 优选股票 C
本期已实现收益	-79,848.86	-166,540.56	32,539,170.28	2,286,858.65	82,076,465.86	2,363,723.32
本期利润	-10,369,624.71	-970,454.39	16,254,085.07	309,887.79	105,494,661.73	2,311,026.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0619	-0.0775	0.1145	0.0227	0.2464	0.2114
本期加权	-5.23%	-6.66%	8.28%	1.64%	22.80%	19.19%

平均 净值 利润 率						
本期 基金 份额 净值 增长 率	-10.18%	-10.63%	9.03%	8.49%	23.80%	23.37%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末 可供 分配 利润	44,363,901.28	3,814,052.13	39,954,197.47	3,422,692.16	43,663,283.93	2,305,871.38
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.2124	0.1961	0.3498	0.3384	0.2380	0.2337
期末 基金 资产 净值	253,239,850.01	23,259,410.97	154,160,251.88	13,536,879.02	227,096,267.48	12,174,382.68
期末 基金 份额 净值	1.2124	1.1961	1.3498	1.3384	1.2380	1.2337
3.1. 3 累 计期 末指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	21.24%	19.61%	34.98%	33.84%	23.80%	23.37%

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

嘉实基础产业优选股票 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
过去三个月	11.71%	1.89%	1.58%	1.02%	10.13%	0.87%
过去六个月	-4.48%	1.61%	-9.15%	1.00%	4.67%	0.61%
过去一年	-10.18%	1.78%	-12.88%	1.21%	2.70%	0.57%
自基金合同生效起至今	21.24%	1.42%	28.41%	1.08%	-7.17%	0.34%

嘉实基础产业优选股票 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
过去三个月	11.57%	1.89%	1.58%	1.02%	9.99%	0.87%
过去六个月	-4.73%	1.61%	-9.15%	1.00%	4.42%	0.61%
过去一年	-10.63%	1.78%	-12.88%	1.21%	2.25%	0.57%
自基金合同生效起至今	19.61%	1.42%	28.41%	1.08%	-8.80%	0.34%

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：

$$\text{Return}(t) = (\text{中证全指资本品指数}(t) / \text{中证全指资本品指数}(t-1) - 1) \times 30\% + (\text{中证全指运输指数}(t) / \text{中证全指运输指数}(t-1) - 1) \times 30\% + (\text{中证全指原材料指数}(t) / \text{中证全指原材料指数}(t-1) - 1) \times 20\% + (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) \times 5\% + (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指}$$

数 $(t-1)-1) \times 15\%$

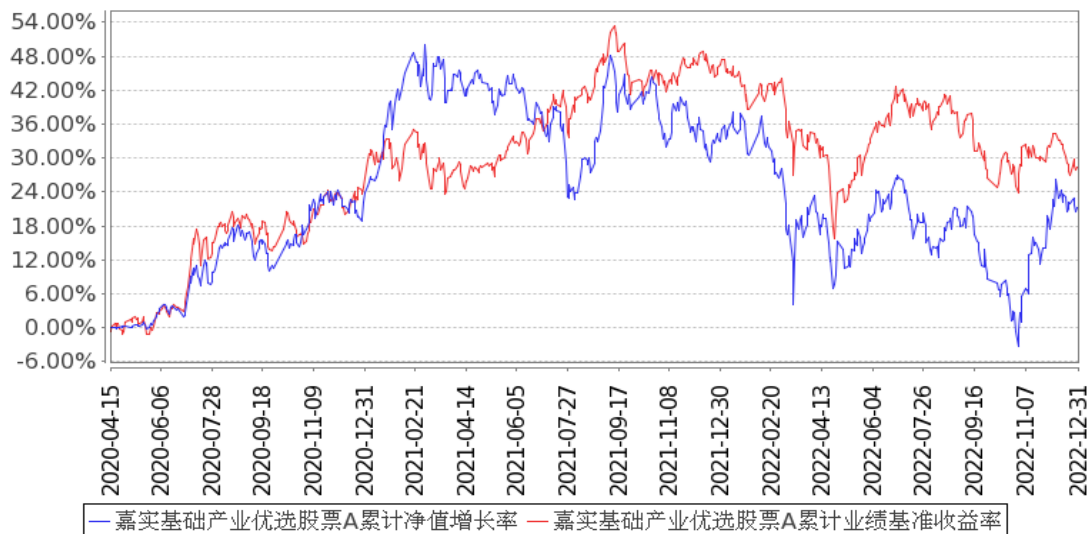
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

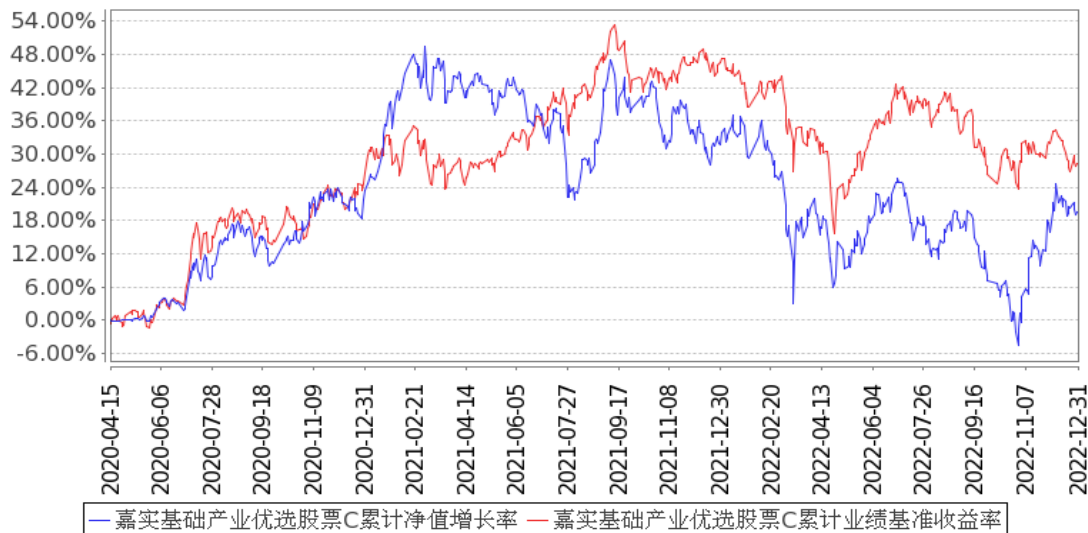
嘉实基础产业优选股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020年04月15日至2022年12月31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

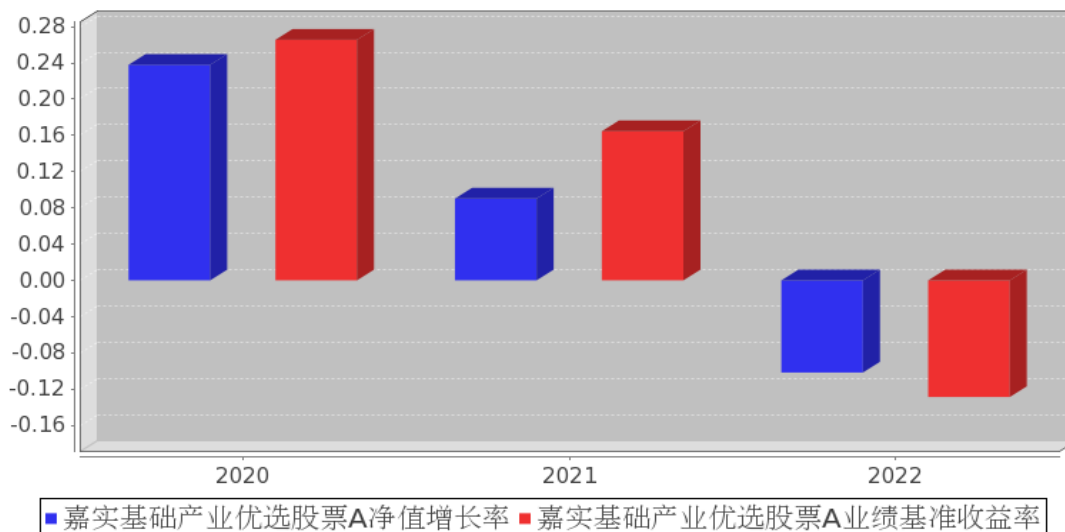
(2020年04月15日至2022年12月31日)



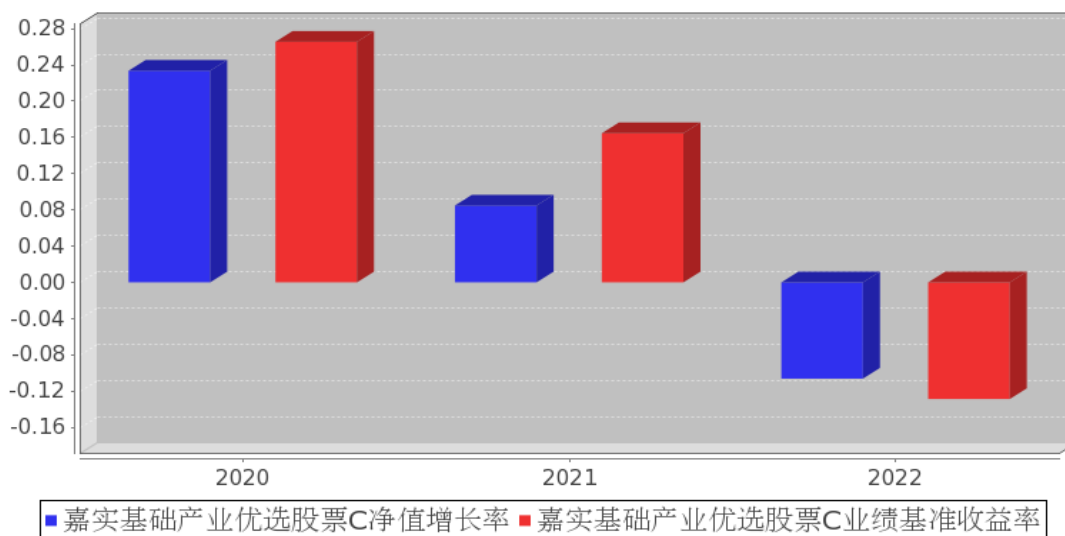
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

嘉实基础产业优选股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实基础产业优选股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



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和特定资产管理业务等资格。

截止2022年12月31日，基金管理人共管理298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		
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、嘉实品质蓝筹一年持有期混合基金经理	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。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。

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

（2）证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理的薪酬激励存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩挂钩的情况，其薪酬激励部分的计算方法如下：

本基金基金经理的奖金与所管理产品的长期业绩表现、为客户创造的回报相关，与公司当年的支付能力相关，其管理产品的长期业绩表现与基金经理本人的奖金正向相关。客户有明确业绩要求的，优先按客户要求的业绩基准考核，达到客户基准要求才有资格获得激励。其次对标公募产品可比竞争组，满3年产品按三年业绩前1/3为合格标准；不满3年的产品看短期业绩，仅区分是否合格，达成合格标准才有资格获得激励。

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 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，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应当符合公平交易的监管要求，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。

公司严格执行《公平交易管理制度》，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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，为防范兼任行为潜在利益冲突，公司增加了公平交易管理环节、公平交易执行力度。

（1）加强投资指令管理：基金经理管理的多个组合，同日购入或出售同一证券时尽量同时发送投资指令，并通过公平交易系统进行价差监控管理。

（2）加强对交易行为管理：兼任组合间不得进行同日反向交易，对多个组合间同日及临近日同向交易的价差强化控制和监测。

（3）加强交易监测和分析：对不同时间窗下（日内、3 日内、10 日内）反向交易和同向交易价差监控的分析，结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素，对是否存在不公平对待的情形进行分析。

（4）加强事后报告机制：对同一基金经理管理的多个组合的收益率差异进行分析，并对公平交易机制的潜在问题和完善情况进行说明。

报告期内，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 17 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 16 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

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

回到中国市场体现的投资者信心巨大波动这个问题上，我们在前几次季报中反复提到了，短期看各行业的基本面确实遇到了明显的压力，这种压力持续相当长一段时间后就一定程度上被投资者线性外推，相当多的行业似乎看不到改善出现的明确前景，包括海外投资者在内的大部分人的理性选择就是降低权益资产的配置权重，一言概之就是对中国经济的信心有所动摇，市场也随之出现了较大跌幅。但我们也同样强调，我们对中国经济的信心仍然不变，我们坚信中国人民极强的适应能力和主观能动性，相关行业的相关主体会主动采取行动去改变现在的不利状况，权益投资者会看到非线性的正向改变，所以，在面向未来的视角下，对权益市场也没有必要继续悲观。事实上，我们没有能力预计到的是，这种非线性的正向改变出现得如此迅速、如此激烈：时间进入到 2022 年的最后两个月，正好在三季度季报刚刚披露之后，我们突然发现在导致市场信心动摇的最重要的几个点上，这种正向的非线性变化就这样毫无准备的出现了。首当其冲的是疫情防控思路的转向，大部分行业，尤其是线下服务相关的行业，终于能够重回正常的生产经营环境；其次是房地产也在供给端出现了一揽子的旨在保护诚信开发商主体的支持性政策，解决了民营企业甚至是部分国企的生存问题，宏观经济最大的下行风险得到了有效控制；另一点非常重要的是对民营企业和平台经济定位的表述也发生了细微但重要的变化，市场对民营经济开始重新建立信心。这几个点涉及到的是市场对长期特别重要的两个慢变量（中国特色社会主义市场经济的独特制度

优势、中国资产负债表底层基础资产的扎实程度)的信心,看到这些改变后,市场中长期的信心快速得到修复,对应市场也出现了一轮非常可观的反弹。结构上,信心更脆弱的港股市场在这种修复过程中也体现出了更强的上行风险,同时不同行业之间也仍然体现出了相当大的分化。

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

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

具体到基础产业这只基金,我们仍然维持了相对较高的港股的配置,具体的配置也仍然相对分散到互联网、房地产、教育、创新药、航空等行业中,践行我们低波动权益投资的方法论。从目前的股价来看,港股相对 A 股仍然有历史上相对较高的折价水平,也因此至少在表观上具备更好的风险收益比,我们配置的部分行业甚至具备相当高的赔率。后续变化上,一是这些行业内部个股权重,我们会随着相关公司基本面的变化适时进行调整,二是如果相关行业出现阶段性较大涨幅,我们会及时评估风险收益比的变化,做出动态调整,三是我们也在关注部分和消费复苏相

关的行业。希望我们也能在港股的配置上也做出明显的超额收益。

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

4.4.2 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 1.2124 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.18%；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 1.1961 元，本报告期基金份额净值增长率为-10.63%；业绩比较基准收益率为-12.88%。

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

另一个值得关注的有确定性的板块是工业服务业，在制造业景气仍然具有较大不确定性的情况下，市场主体之间的竞争一定会倒逼各个市场参与者不断提升产业链运营效率，以实现更低的成本或者交付更好的客户体验。如何提升运营效率？分工专业化是屡试不爽的工具，算是解决这个问题一个基本方法论。这一块涉及到的领域众多，在我们比较熟悉的领域中，物流和供应链管理、企业数字孪生应该是两个相对比较确定的方向。其他比较确定的线索包括大安全、国企改革

革、职业教育等，此处不再详细展开。

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

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关监察稽核工作情况如下：

(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。全力支持创新业务，包括新产品新业务，产品生命周期支持也包括从战略规划到具体产品方案、业务模式、制度流程。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) 全流程动态开展投资交易监督。一是事前防范，主要从事前研讨，合规风险识别、评估和分析，IT 事前设置，建立禁限库，合规培训、承诺书等方面开展；二是事中实时监控，如实时回答组合经理、交易员投资交易事项，盘中交易审批，盘中实时监控等；三是事后检查及改进，如检查投资交易合规情况，对异常行为进行提示、处理建议并督促改正。

(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) 基金法务工作。包括合同、协议审查，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，重点防控新增产品、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，按时完成合规报告和各项统计报表以及专题报告。

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。

4.8 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行

了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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	安永华明（2023）审字第 60468756_A12 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	嘉实基础产业优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实基础产业优选股票型证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的嘉实基础产业优选股票型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实基础产业优选股票型证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实基础产业优选股票型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	嘉实基础产业优选股票型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要

	报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估嘉实基础产业优选股票型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督嘉实基础产业优选股票型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（1）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。</p> <p>（2）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。</p> <p>（3）评价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。</p> <p>（4）对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，就可能对嘉实基础产业优选股票型证券投资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基础产业优选股票型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）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。</p> <p>我们与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。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	孙静习 马剑英

会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2023年3月27日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实基础产业优选股票型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	17,230,644.26	8,100,463.41
结算备付金		662,181.53	43,116.45
存出保证金		23,072.76	40,409.24
交易性金融资产	7.4.7.2	262,122,939.58	159,793,656.95
其中：股票投资		261,820,434.62	154,470,592.55
基金投资		-	-
债券投资		302,504.96	5,323,064.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	74,497.36
应收股利		-	-
应收申购款		28,460.83	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	123,350.91
资产总计		280,067,298.96	168,175,494.32
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		2,291,987.32	13.54
应付赎回款		544,379.97	-
应付管理人报酬		355,277.72	211,934.13
应付托管费		59,212.95	35,322.35
应付销售服务费		10,143.77	5,586.24
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	7.4.7.9	307,036.25	225,507.16
负债合计		3,568,037.98	478,363.42
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	228,321,307.57	124,320,241.27
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	48,177,953.41	43,376,889.63
净资产合计		276,499,260.98	167,697,130.90
负债和净资产总计		280,067,298.96	168,175,494.32

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，嘉实基础产业优选股票 A 基金份额净值 1.2124 元，基金份额总额 208,875,948.73 份，嘉实基础产业优选股票 C 基金份额净值 1.1961 元，基金份额总额 19,445,358.84 份，基金份额总额合计为 228,321,307.57 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实基础产业优选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-7,372,491.44	21,474,720.05
1. 利息收入		66,429.78	217,733.85
其中：存款利息收入	7.4.7.13	66,429.78	51,850.46
债券利息收入		-	165,883.39
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,597,781.81	39,062,370.85
其中：股票投资收益	7.4.7.14	655,664.36	35,453,073.00
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.15	22,484.96	20,954.02
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,883.17	-
股利收益	7.4.7.19	2,917,749.32	3,588,343.83
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）	7.4.7.20	-11,093,689.68	-18,262,056.07
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	56,986.65	456,671.42
减：二、营业总支出		3,967,587.66	4,910,747.19
1. 管理人报酬		3,169,089.87	3,239,162.89
2. 托管费		528,181.70	539,860.49
3. 销售服务费		72,721.42	94,171.16
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		6.82	0.06
8. 其他费用	7.4.7.23	197,587.85	1,037,552.59
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-11,340,079.10	16,563,972.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-11,340,079.10	16,563,972.86
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		-11,340,079.10	16,563,972.86

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：嘉实基础产业优选股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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)	124,320,241.27	-	43,376,889.63	167,697,130.90
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本年期初净资产(基金净值)	124,320,241.27	-	43,376,889.63	167,697,130.90
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	104,001,066.30	-	4,801,063.78	108,802,130.08
(一)、综合收益总额	-	-	-11,340,079.10	-11,340,079.10
(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)	104,001,066.30	-	16,141,142.88	120,142,209.18
其中:1.基金申购款	144,402,176.27	-	24,483,225.20	168,885,401.47
2.基金赎回款	-40,401,109.97	-	-8,342,082.32	-48,743,192.29
(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、本期期末净资产(基金净值)	228,321,307.57	-	48,177,953.41	276,499,260.98
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	193,301,494.85	-	45,969,155.31	239,270,650.16
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)	193,301,494.85	-	45,969,155.31	239,270,650.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-68,981,253.58	-	-2,592,265.68	-71,573,519.26
(一)、综合收益总额	-	-	16,563,972.86	16,563,972.86

(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)	-68,981,253.58	-	-19,156,238.54	-88,137,492.12
其中:1. 基金申购款	140,405,864.28	-	59,818,494.66	200,224,358.94
2. 基金赎回款	-209,387,117.86	-	-78,974,733.20	-288,361,851.06
(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、本期期末净资产(基金净值)	124,320,241.27	-	43,376,889.63	167,697,130.90

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

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实基础产业优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2019]1825号《关于准予嘉实基础产业优选股票型证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于2020年3月25日至2020年4月10日向社会公开募集，基金合同于2020年4月15日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为749,734,857.04份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权

益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变

化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行收益分配，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%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 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按除息日的该类基金份额净值自动转为同一类别的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；

(3) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规规定及基金合同约定，且不损害基金份额持有人实际利益的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金

亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,100,463.41 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 664.91 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 8,101,128.32 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 43,116.45 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 434.64 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 43,551.09 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 40,409.24 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 12.21 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 40,421.45 元。

应收申购款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 0.83 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，应收申购款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.83 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 123,350.91 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 664.91 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 434.64 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 12.21 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 122,238.32 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.83 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 159,793,656.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 122,238.32 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 159,915,895.27 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、

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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	17,230,644.26	8,100,463.41
等于：本金	17,229,059.48	8,100,463.41
加：应计利息	1,584.78	-
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	17,230,644.26	8,100,463.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	267,809,810.55	-	261,820,434.62	-5,989,375.93
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,514.96	302,504.96	-870.93
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,514.96	302,504.96	-870.93
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	268,111,671.48	1,514.96	262,122,939.58	-5,990,246.86
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	149,367,149.73	-	154,470,592.55	5,103,442.82
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	5,323,064.40	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	5,323,064.40	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	154,690,214.13	-	159,793,656.95	5,103,442.82

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有衍生金融资产/负债；于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有新城发展配股权证 69,809 份，公允价值为人民币 0.00 元。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	123,350.91
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	123,350.91

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.47	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	82,032.78	50,507.16
其中：交易所市场	82,032.78	50,507.16
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	225,000.00	175,000.00
合计	307,036.25	225,507.16

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实基础产业优选股票 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,206,054.41	114,206,054.41
本期申购	123,589,157.45	123,589,157.45
本期赎回（以“-”号填列）	-28,919,263.13	-28,919,263.13
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	208,875,948.73	208,875,948.73

嘉实基础产业优选股票 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,114,186.86	10,114,186.86
本期申购	20,813,018.82	20,813,018.82
本期赎回（以“-”号填列）	-11,481,846.84	-11,481,846.84
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	19,445,358.84	19,445,358.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

嘉实基础产业优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	54,610,192.59	-14,655,995.12	39,954,197.47
本期利润	-79,848.86	-10,289,775.85	-10,369,624.71
本期基金份额交易产生的变动数	46,392,609.89	-31,613,281.37	14,779,328.52
其中：基金申购款	60,506,226.76	-39,655,465.92	20,850,760.84
基金赎回款	-14,113,616.87	8,042,184.55	-6,071,432.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	100,922,953.62	-56,559,052.34	44,363,901.28

嘉实基础产业优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	4,710,659.03	-1,287,966.87	3,422,692.16
本期利润	-166,540.56	-803,913.83	-970,454.39
本期基金份额交易产生的变动数	4,495,113.45	-3,133,299.09	1,361,814.36
其中：基金申购款	9,914,651.80	-6,282,187.44	3,632,464.36
基金赎回款	-5,419,538.35	3,148,888.35	-2,270,650.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,039,231.92	-5,225,179.79	3,814,052.13

7.4.7.13 存款利息收入

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	54,182.59	38,605.72
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	7,847.43	9,881.55
其他	4,399.76	3,363.19
合计	66,429.78	51,850.46

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖	655,664.36	35,453,073.00
股票差价收入	-	-
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	655,664.36	35,453,073.00

7.4.7.14.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12 月31日
卖出股票成交总额	153,639,301.64	306,880,838.94
减：卖出股票成本 总额	152,310,254.69	271,427,765.94
减：交易费用	673,382.59	-
买卖股票差价收 入	655,664.36	35,453,073.00

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息 收入	44,399.43	-
债券投资收益——买卖 债券（债转股及债券到 期兑付）差价收入	-21,914.47	20,954.02
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	22,484.96	20,954.02

7.4.7.15.2 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	17,462,246.28	15,583,319.11
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,287,881.47	15,230,693.40
减：应计利息总额	196,279.23	331,671.69
减：交易费用	0.05	-
买卖债券差价收入	-21,914.47	20,954.02

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出权证成交总额	1,945.29	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：交易费用	5.46	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	56.66	-
买卖权证差价收入	1,883.17	-

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

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12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,917,749.32	3,588,343.83
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	2,917,749.32	3,588,343.83

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-11,093,689.68	-18,262,056.07
股票投资	-11,092,818.75	-18,262,676.07
债券投资	-870.93	620.00
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	-11,093,689.68	-18,262,056.07

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	52,427.89	280,750.76
基金转出费收入	4,558.76	175,920.66
合计	56,986.65	456,671.42

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	50,000.00	55,000.00
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	2,758.81	8,522.81
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
深港通证券组合费	6,829.04	-
交易费用	-	836,029.78
合计	197,587.85	1,037,552.59

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,169,089.87	3,239,162.89
其中：支付销售机构的客户维护费	534,878.10	936,647.43

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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	528,181.70	539,860.49

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。

7.4.10.2.3 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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实基础产业优选股票 A	嘉实基础产业优选股票 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	24,210.14	24,210.14
中国建设银行	-	4,800.50	4,800.50
嘉实财富	-	121.57	121.57
合计	-	29,132.21	29,132.21
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 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实基础产业优选股票 A	嘉实基础产业优选股票 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	10,280.10	10,280.10
中国建设银行	-	6,392.57	6,392.57
嘉实财富	-	143.10	143.10
合计	-	16,815.77	16,815.77

注：（1）本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%，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×0.50%/当年天数。（2）本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

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

无。

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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国建设银行股份有限公司_活期	17,230,644.26	54,182.59	8,100,463.41	38,605.72

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(2022年1月1日至2022年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2022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	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
002928	华夏航空	2022年11月14日	6个月	非公开发行锁定	9.20	13.03	217,391	1,999,997.20	2,832,604.73	-
601021	春秋航空	2022年11月28日	6个月	非公开发行锁定	48.32	60.46	53,808	2,600,002.56	3,253,231.68	-
603885	吉祥航空	2022年8月	6个月	非公开发行锁	13.32	15.68	187,688	2,500,004.16	2,942,947.84	-

		11 日		定						
688130	晶华微	2022 年 7 月 22 日	6 个月	新股锁定	62.98	41.42	1,618	101,901.64	67,017.56	-
688147	微导纳米	2022 年 12 月 16 日	6 个月	新股锁定	24.21	23.91	3,692	89,383.32	88,275.72	-
688172	燕东微	2022 年 12 月 9 日	6 个月	新股锁定	21.98	17.96	8,598	188,984.04	154,420.08	-
688380	中微半导体	2022 年 7 月 29 日	6 个月	新股锁定	30.86	26.44	3,227	99,585.22	85,321.88	-

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。

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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	302,504.96	-
合计	302,504.96	-

注：评级取自第三方评级机构。

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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因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 2022 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	17,230,644.26	-	-	-	17,230,644.26
结算备付金	662,181.53	-	-	-	662,181.53
存出保证金	23,072.76	-	-	-	23,072.76
交易性金融资产	302,504.96	-	-	-261,820,434.62	262,122,939.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	28,460.83	28,460.83
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,218,403.51	-	-	-261,848,895.45	280,067,298.96
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	-	-	-	2,291,987.32	2,291,987.32
应付赎回款	-	-	-	544,379.97	544,379.97
应付管理人报酬	-	-	-	355,277.72	355,277.72
应付托管费	-	-	-	59,212.95	59,212.95
应付销售服务费	-	-	-	10,143.77	10,143.77
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	-	-	-	307,036.25	307,036.25
负债总计	-	-	-	3,568,037.98	3,568,037.98
利率敏感度缺口	18,218,403.51	-	-	-258,280,857.47	276,499,260.98
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	8,100,463.41	-	-	-	8,100,463.41
结算备付金	43,116.45	-	-	-	43,116.45

存出保证金	40,409.24	-	-	40,409.24
交易性金融资产	5,323,064.40	-	-154,470,592.55	159,793,656.95
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收清算款	-	-	74,497.36	74,497.36
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	123,350.91	123,350.91
资产总计	13,507,053.50	-	-154,668,440.82	168,175,494.32
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	-	-	13.54	13.54
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	211,934.13	211,934.13
应付托管费	-	-	35,322.35	35,322.35
应付销售服务费	-	-	5,586.24	5,586.24
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	-	-	225,507.16	225,507.16
负债总计	-	-	478,363.42	478,363.42
利率敏感度缺口	13,507,053.50	-	-154,190,077.40	167,697,130.90

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

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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-603.72	-765.08
	市场利率下降25个基点	606.14	765.30

	基点		
--	----	--	--

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	124,185,169.01	-	124,185,169.01
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	124,185,169.01	-	124,185,169.01
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	124,185,169.01	-	124,185,169.01
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	63,349,994.51	-	63,349,994.51
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	63,349,994.51	-	63,349,994.51
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报 酬	-	-	-	-

应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	63,349,994.51	-	63,349,994.51

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值 5%	6,209,258.45	3,167,499.73
	所有外币相对人民币贬值 5%	-6,209,258.45	-3,167,499.73

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。并且，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，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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 2022年12月31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	261,820,434.62	94.69	154,470,592.55	92.11
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	261,820,434.62	94.69	154,470,592.55	92.11

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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	15,444,843.10	7,151,868.04
	业绩比较基准下降5%	-15,444,843.10	-7,151,868.04

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	252,396,615.13	151,846,793.72

第二层次	302,504.96	7,946,863.23
第三层次	9,423,819.49	-
合计	262,122,939.58	159,793,656.95

7.4.14.2.2 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。对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、新发未上市、涨跌停等导致的交易不活跃）或非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	7,579,858.14	7,579,858.14
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	1,843,961.35	1,843,961.35
其中：计入损益的利得或损失	-	1,843,961.35	1,843,961.35
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	9,423,819.49	9,423,819.49
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	1,843,961.35	1,843,961.35
项目	上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：1. 于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

2. 计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	9,423,819.49	平均价格亚式期权模型	预期波动率	29.47%-41.41%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 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。

§ 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	261,820,434.62	93.48
	其中：股票	261,820,434.62	93.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	302,504.96	0.11
	其中：债券	302,504.96	0.11
	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	17,892,825.79	6.39
8	其他各项资产	51,533.59	0.02
9	合计	280,067,298.96	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 124,185,169.01 元，占基金资产净值的比例为 44.91%。

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	6,243,164.00	2.26
C	制造业	18,194,536.26	6.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	33,034,700.63	11.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,115,350.00	1.13

G	交通运输、仓储和邮政业	58,616,909.66	21.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,017.56	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	10,485,750.00	3.79
L	租赁和商务服务业	7,865,793.00	2.84
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	12,044.50	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	137,635,265.61	49.78

8.2.2 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	35,763,583.01	12.93
非必需消费品	28,615,944.65	10.35
必需消费品	-	-
能源	567,226.45	0.21
金融	-	-
医疗保健	19,151,708.80	6.93
工业	17,846,641.33	6.45
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	18,323,969.09	6.63
公用事业	3,916,095.68	1.42
合计	124,185,169.01	44.91

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	700 HK	腾讯控股	90,000	26,851,696.20	9.71
2	667 HK	中国东方教育	3,491,500	19,430,449.24	7.03
3	002352	顺丰控股	299,900	17,322,224.00	6.26
4	1030 HK	新城发展	5,624,000	14,518,638.89	5.25
5	600233	圆通速递	700,250	14,068,022.50	5.09
6	1055 HK	中国南方航空股份	2,500,000	11,344,529.00	4.10
7	600803	新奥股份	699,200	11,257,120.00	4.07
8	002120	韵达股份	753,607	10,836,868.66	3.92

9	600886	国投电力	980,161	10,615,143.63	3.84
10	601155	新城控股	511,500	10,485,750.00	3.79
11	600057	厦门象屿	765,900	7,865,793.00	2.84
12	002812	恩捷股份	54,000	7,089,660.00	2.56
13	6855 HK	亚盛医药-B	300,000	6,887,111.70	2.49
14	1024 HK	快手-W	104,000	6,600,550.68	2.39
15	1765 HK	希望教育	10,000,000	6,252,890.00	2.26
16	603885	吉祥航空	385,688	6,146,587.84	2.22
17	1801 HK	信达生物	200,000	5,984,909.00	2.16
18	1093 HK	石药集团	700,000	5,127,369.80	1.85
19	300750	宁德时代	10,800	4,248,936.00	1.54
20	2688 HK	新奥能源	40,000	3,916,095.68	1.42
21	000883	湖北能源	903,800	3,795,960.00	1.37
22	601021	春秋航空	60,893	3,708,442.93	1.34
23	000543	皖能电力	801,400	3,590,272.00	1.30
24	601898	中煤能源	332,400	2,865,288.00	1.04
24	1898 HK	中煤能源	100,000	567,226.45	0.21
25	670 HK	中国东方航空股份	1,200,000	3,397,999.08	1.23
26	600546	山煤国际	215,000	3,115,350.00	1.13
27	753 HK	中国国航	500,000	3,104,113.25	1.12
28	002928	华夏航空	217,391	2,832,604.73	1.02
29	601225	陕西煤业	152,200	2,827,876.00	1.02
30	941 HK	中国移动	50,000	2,311,336.13	0.84
31	603659	璞泰来	38,200	1,982,198.00	0.72
32	884 HK	旭辉控股集团	2,000,000	1,965,194.00	0.71
33	600023	浙能电力	544,500	1,900,305.00	0.69
34	000539	粤电力 A	338,000	1,875,900.00	0.68
35	688 HK	中国海外发展	100,000	1,840,136.20	0.67
36	600026	中远海能	138,100	1,664,105.00	0.60
37	002468	申通快递	151,300	1,562,929.00	0.57
38	3690 HK	美团-W	10,000	1,560,542.69	0.56
39	300035	中科电气	69,320	1,426,605.60	0.52
40	2015 HK	理想汽车-W	20,000	1,372,062.72	0.50
41	9926 HK	康方生物-B	30,000	1,152,318.30	0.42
42	000630	铜陵有色	359,600	1,121,952.00	0.41
43	002920	德赛西威	7,000	737,380.00	0.27
44	601899	紫金矿业	55,000	550,000.00	0.20
45	300873	海晨股份	17,500	475,125.00	0.17
46	002444	巨星科技	21,800	413,764.00	0.15
47	688141	杰华特	3,282	155,895.00	0.06
48	688172	燕东微	8,598	154,420.08	0.06
49	688119	中钢洛耐	19,308	121,640.40	0.04
50	688503	聚和材料	737	109,894.07	0.04

51	688084	晶品特装	1,125	93,015.00	0.03
52	688147	微导纳米	3,692	88,275.72	0.03
53	688380	中微半导	3,227	85,321.88	0.03
54	688143	长盈通	1,634	76,177.08	0.03
55	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.03
56	688410	山外山	2,911	73,560.97	0.03
57	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.02
58	688130	晶华微	1,618	67,017.56	0.02
59	688420	美腾科技	1,513	61,760.66	0.02
60	603568	伟明环保	650	12,044.50	0.00
61	603151	邦基科技	535	11,256.40	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	002352	顺丰控股	15,312,260.52	9.13
2	700 HK	腾讯控股	11,725,868.49	6.99
3	1030 HK	新城发展	11,550,588.31	6.89
4	002812	恩捷股份	10,332,452.00	6.16
5	1055 HK	中国南方航空 股份	9,247,311.26	5.51
6	3690 HK	美团-W	7,626,334.56	4.55
7	601668	中国建筑	7,568,755.00	4.51
8	1801 HK	信达生物	7,318,953.11	4.36
9	600057	厦门象屿	7,014,557.09	4.18
10	002120	韵达股份	6,929,671.00	4.13
11	300750	宁德时代	6,856,536.46	4.09
12	884 HK	旭辉控股集团	6,637,022.47	3.96
13	603885	吉祥航空	6,193,113.58	3.69
14	1765 HK	希望教育	6,169,078.69	3.68
15	667 HK	中国东方教育	6,099,390.63	3.64
16	1093 HK	石药集团	5,846,325.65	3.49
17	601155	新城控股	4,865,038.00	2.90
18	600233	圆通速递	4,830,612.00	2.88
19	6855 HK	亚盛医药-B	4,761,283.20	2.84
20	1024 HK	快手-W	4,701,869.63	2.80
21	000883	湖北能源	4,268,257.00	2.55
22	601006	大秦铁路	4,008,498.00	2.39
23	600546	山煤国际	3,951,208.96	2.36
24	000543	皖能电力	3,937,314.00	2.35
25	603369	今世缘	3,930,955.00	2.34
26	2688 HK	新奥能源	3,733,461.47	2.23

27	600886	国投电力	3,609,165.00	2.15
28	601898	中煤能源	3,048,214.00	1.82
28	1898 HK	中煤能源	542,745.00	0.32
29	601225	陕西煤业	3,503,437.00	2.09
30	600803	新奥股份	3,392,851.50	2.02
31	603659	璞泰来	3,360,852.00	2.00

8.4.2 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	3690 HK	美团-W	17,371,615.52	10.36
2	603885	吉祥航空	13,618,899.06	8.12
3	581 HK	中国东方集团	8,476,718.29	5.05
4	601668	中国建筑	7,559,355.00	4.51
5	670 HK	中国东方航空股份	5,951,387.94	3.55
6	002120	韵达股份	5,938,674.32	3.54
7	601021	春秋航空	5,236,593.00	3.12
8	000935	四川双马	4,571,134.76	2.73
9	941 HK	中国移动	4,020,743.37	2.40
10	601006	大秦铁路	3,887,910.00	2.32
11	603369	今世缘	3,796,996.99	2.26
12	000858	五粮液	3,373,683.00	2.01
13	688223	晶科能源	3,058,694.99	1.82
14	601952	苏垦农发	3,002,378.72	1.79
15	1801 HK	信达生物	2,919,531.31	1.74
16	600507	方大特钢	2,820,298.00	1.68
17	1186 HK	中国铁建	2,648,382.16	1.58
18	600905	三峡能源	2,606,046.00	1.55
19	600230	沧州大化	2,558,981.00	1.53
20	300750	宁德时代	2,519,807.00	1.50

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	270,752,915.51
卖出股票收入（成交）总额	153,639,301.64

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	302,504.96	0.11

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	302,504.96	0.11

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	019663	21 国债 15	3,000	302,504.96	0.11

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

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 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 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

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。

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	23,072.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	28,460.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,533.59

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

无。

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

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 (%)
嘉实基础 产业优选 股票 A	4,396	47,515.00	138,832,897.33	66.47	70,043,051.40	33.53
嘉实基础 产业优选 股票 C	2,563	7,586.95	10,044,599.02	51.66	9,400,759.82	48.34
合计	6,759	33,780.34	148,877,496.35	65.21	79,443,811.22	34.79

注：(1) 嘉实基础产业优选股票 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基础产业优选股票 A 份额占嘉实基础产业优选股票 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实基础产业优选股票 A 份额占嘉实基础产业优选股票 A 总份额比例；

(2) 嘉实基础产业优选股票 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基础产业优选股票 C 份额占嘉实基础产业优选股票 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实基础产业优选股票 C 份额占嘉实基础产业优选股票 C 总份额比例。

9.2 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	嘉实基础产业优选股票 A	275,583.77	0.13
	嘉实基础产业优选股票 C	-	-
	合计	275,583.77	0.12

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	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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实基础产业优选股票 A	0
	嘉实基础产业优选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实基础产业优选股票 A	0
	嘉实基础产业优选股票 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
肖觅	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

§ 10 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
基金合同生效日 (2020 年 4 月 15 日) 基金份额总额	734,915,190.34	14,819,666.70
本报告期期初基金份额总额	114,206,054.41	10,114,186.86

本报告期基金总申购份额	123,589,157.45	20,813,018.82
减：本报告期基金总赎回份额	28,919,263.13	11,481,846.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	208,875,948.73	19,445,358.84

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

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。

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。报告年度应支付安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 50,000.00 元，该审计机构已连续 3 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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022年6月2日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正

受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 6 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	对子公司管控不严格
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 3	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 12 月 26 日
采取稽查或处罚等措施的机构	北京证监局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已完成整改并通过北京证监局验收
其他	-

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信建投证券股份有限公司	6	224,017,227.95	54.72	155,362.43	55.36	-
兴业证券股份有限公司	2	83,338,068.96	20.36	57,839.24	20.61	-
开源证券股份有限公司	2	45,607,762.65	11.14	31,439.24	11.20	-
广发证券	3	33,095,340.6	8.08	20,894.35	7.45	-

股份有限 公司		3					
西部证券 股份有限 公司	2	17,772,108.5 8	4.34	11,220.55	4.00	-	
申万宏源 证券有限 公司	2	5,555,158.12	1.36	3,888.63	1.39	-	
安信证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	
财信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	
长江证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	
高盛高华 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-	
光大证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	
国盛证券 有限责任 公司	2	-	-	-	-	-	
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	
海通证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-	
华西证券 股份有限 公司	2	-	-	-	-	-	
招商证券 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. 北京高华证券有限责任公司更名为高盛高华证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：国盛证券有限责任公司新增交易单元 2 个，安信证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信建投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(%)
中信建投证券股份有限公司	3,835,679.20	15.86	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	8,104,880.00	33.51	-	-	1,945.29	100.00
开源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	12,243,091.00	50.63	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
财信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高盛高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金 2022 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 21 日
2	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、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
3	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资吉祥航空非公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 8 月 13 日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2022 年 11 月 2 日因恶劣天气暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 2 日
5	嘉实基金管理有限公司住所变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 10 日
6	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资华夏航空非公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 16 日
7	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资春秋航空非公开发行股票的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 11 月 29 日
8	嘉实基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 21 日
9	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务安排的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2022-01-26 至 2022-12-31	20,283,299.53	50,685,540.42	-	70,968,839.95	31.08
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>							

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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

13.3 查阅方式

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

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，

或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日