

嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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 2021 年 02 月 26 日（基金合同生效日）起至 2021 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	6
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	8
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
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	54
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	54
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	57
§ 8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	60
§ 9 开放式基金份额变动	60
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4 基金投资策略的改变	61
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
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	61
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
10.8 其他重大事件	64
§ 11 备查文件目录	64
11.1 备查文件目录	64
11.2 存放地点	64
11.3 查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实浦盈一年持有期混合	
基金主代码	011516	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 2 月 26 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	9,684,679,762.86 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	嘉实浦盈一年持有期混合 A	嘉实浦盈一年持有期混合 C
下属分级基金的交 易代码	011516	011517
报告期末下属分级 基金的份额总额	9,046,271,825.04 份	638,407,937.82 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在努力严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>资产配置策略：本基金将根据对宏观经济周期的分析研究，结合基本面、政策面、资金面等多种因素综合考量，研判所处经济周期的位置及未来发展方向，在控制风险的前提下，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，并根据宏观经济形势和市场时机的变化适时进行动态调整。债券投资策略：本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，力争获取较高的投资收益。</p> <p>股票投资策略：本基金采用“自上而下”和“自下而上”相结合，精选行业和个股的策略。以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种。</p> <p>衍生品投资策略：本基金的衍生品投资将严格遵守中国证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、股票期权、国债期货等衍生工具，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、股票期权、国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。</p> <p>资产支持证券投资策略：本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下，通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所</p>

	在行业景气变化等因素的研究，对个券进行风险分析和价值评估后选择风险调整后收益高的品种进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	中债综合财富指数收益率×85%+中证 800 股票指数收益率×10%+恒生指数收益率×5%（人民币计价）
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于货币市场基金和债券型基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	胡波
	联系电话	(010)65215588	021-61618888
	电子邮箱	service@jsfund.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-600-8800	95528
传真		(010)65215588	021-63602540
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	上海市中山东一路 12 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	上海市北京东路 689 号
邮政编码		100005	200001
法定代表人		经雷	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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(2021年2月26日(基金合同生效日)-2021年6月30日)	
	嘉实浦盈一年持有期混合 A	嘉实浦盈一年持有期混合 C
本期已实现收益	59,997,357.28	3,359,193.29
本期利润	107,708,877.11	6,723,975.27
加权平均基金份额本期利润	0.0119	0.0105
本期加权平均净值利润率	1.18%	1.05%
本期基金份额净值增长率	1.19%	1.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	59,997,357.28	3,359,193.29
期末可供分配基金份额利润	0.0066	0.0053
期末基金资产净值	9,153,980,702.15	645,131,913.09
期末基金份额净值	1.0119	1.0105
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.19%	1.05%

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

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

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

（4）本基金合同生效日为 2021 年 02 月 26 日，本报告期自 2021 年 02 月 26 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

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

嘉实浦盈一年持有期混合 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	0.22%	0.05%	0.06%	0.11%	0.16%	-0.06%
过去三个月	1.04%	0.05%	1.54%	0.12%	-0.50%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.19%	0.06%	1.14%	0.16%	0.05%	-0.10%

嘉实浦盈一年持有期混合 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	0.18%	0.05%	0.06%	0.11%	0.12%	-0.06%
过去三个月	0.93%	0.05%	1.54%	0.12%	-0.61%	-0.07%
自基金合同生效起至今	1.05%	0.06%	1.14%	0.16%	-0.09%	-0.10%

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：

$$\text{Return}(t) = 85\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) + 10\% * (\text{中证 800 指数}(t) / \text{中证 800 指数}(t-1) - 1) + 5\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

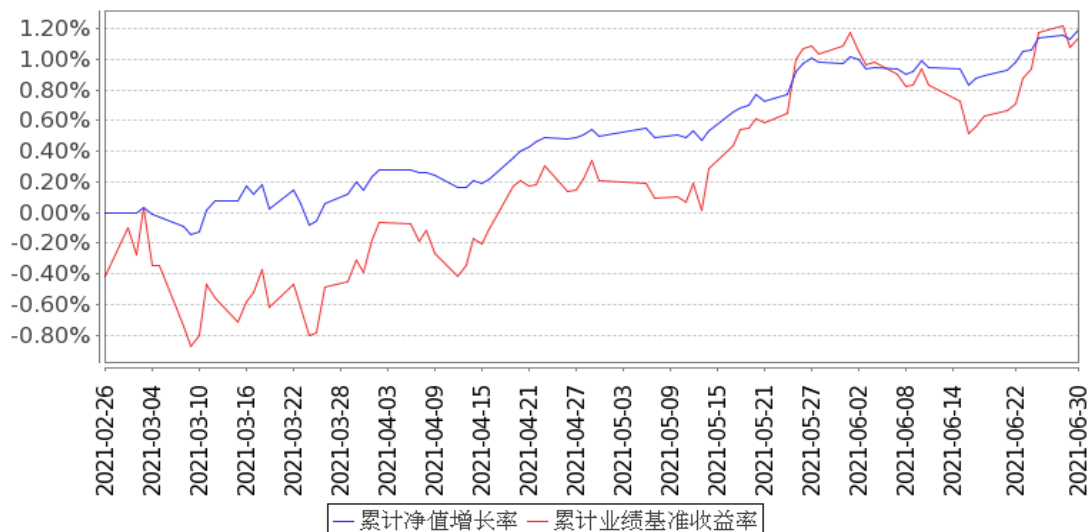
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

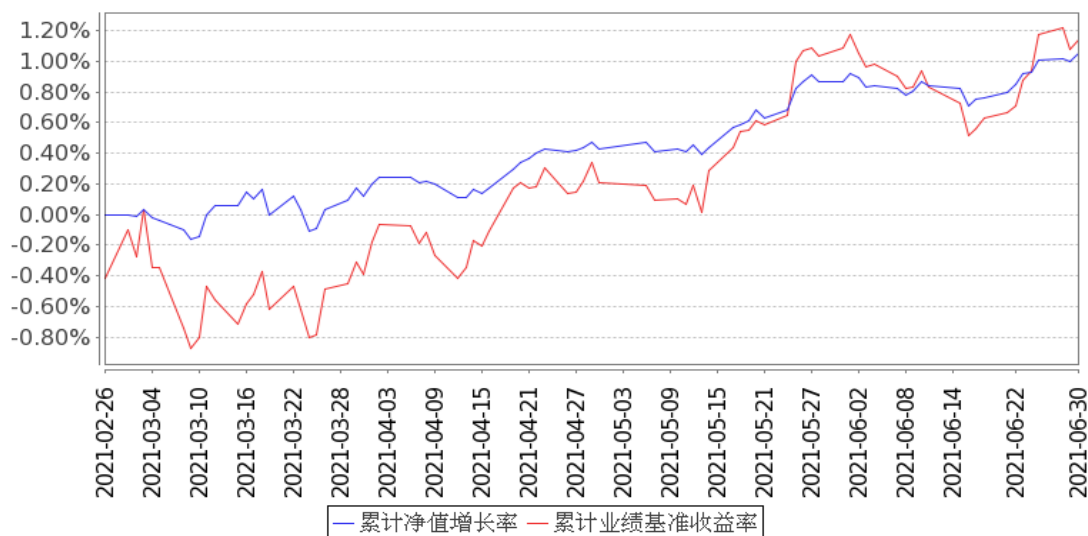
嘉实浦盈一年持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年02月26日至2021年06月30日)



嘉实浦盈一年持有期混合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02月26日至2021年06月30日)



注：(1) 本基金合同生效日 2021 年 02 月 26 日至报告期末未满 1 年。

(2) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日 6 个月为建仓期，本报告期处于建仓期内。

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

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于 1999 年 3 月 25 日，是经中国证监会批准设立的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，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和 QDII、特定资产管理业务资格。

截止 2021 年 6 月 30 日，基金管理人共管理 223 只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深 300ETF 联接 (LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合 (QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、

嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合、嘉实民安添岁稳健养老一年持有期混合 (FOF)、嘉实港股优势混合、嘉实睿享安久双利 18 个月持有期债券、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证软件服务 ETF、嘉实品质回报混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实浦盈一年持有期混合、嘉实中证稀土产业 ETF、嘉实阿尔法优选混合、嘉实中证大农业 ETF、嘉实匠心回报混合、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实价值臻选混合、嘉实品质优

选股票、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实领先优势混合、嘉实中证科创创业 50ETF、嘉实养老目标日期 2045 五年持有期混合 (FOF)、嘉实优势精选混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王茜	本基金、嘉实多元债券、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实安泽一年定期纯债债券基金经理	2021 年 2 月 26 日	-	18 年	曾任武汉市商业银行信贷资金管理部总经理助理, 中信证券固定收益部, 长盛基金管理有限公司基金经理。2008 年 11 月加盟嘉实基金管理有限公司, 曾任固定收益业务体系配置策略组组长, 现任养老金投资联席 CIO。工商管理硕士, 具有基金从业资格, 中国国籍。
黄欣欣	本基金基金经理	2021 年 5 月 13 日	-	15 年	曾任天相投资顾问有限公司研究员, 长盛基金管理有限公司研究发展部研究员、总监助理。2012 年 10 月加入嘉实基金管理有限公司任固收投研体系投资经理, 现任基金经理。硕士研究生, 具有基金从业资格, 中国国籍。

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

(2) 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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、《嘉实浦盈一年持有期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 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年季度经济回顾：

在经历了去年的疫情之后，2021 年我国经济整体的恢复良好，各项主要指标均呈现稳健回升的态势。疫情虽然有小幅的反复，但控制得当，并没有对经济产生明显影响。受到全球流动性依然充裕，整体经济修复的影响，全球大宗商品出现明显上涨，也带动国内通胀水平有所抬升。

2021 年上半年债券市场回顾：

今年债券市场走势波动较大，整体走势比较出乎市场意料，呈现了倒“V”字形走势。一月中上旬因资金利率非常低，利率一路下行；月底资金突然收紧，机构快速降低杠杆，引发利率一路上行；但进入 3 月，资金一直维持宽松，并未如市场预期的因高 PPI 导致收紧，最终带动债券利率一路下行。

2021 年上半年股票市场回顾：

2021 年上半年，股票市场经历了比较剧烈的波动，主要体现在春节前后的市场大幅波动，以及 2 季度以来风格的极度分化，和创业板等成长风格板块的快速上涨。

整体来看，上半年多数主要指数都取得了一定的涨幅，但风格分化较大，涨幅较大的主要集中在成长类板块。

2021 年上半年投资运作回顾：

债券方面：上半年债券的操作思路自建仓期以来始终偏中性的配置思路，组合以优质的 AAA 信用债为主。除此之外，我们在二季度初判断信用市场情绪将得到一定的恢复，也在控制仓位和

集中度的前提下，对部分短久期信用品种做了集中配置，以博取一定的超额收益，成效较好。整体组合在品种、行业、个券方面都做到了较为充分的分散，保持组合兼顾收益性与流动性。

权益方面：权益配置方面以绝对收益思路为主，组合整体在前期股市底部整体加仓权益类品种，以高分红类资产作为底仓配置品种，以估值与业绩匹配度较高的成长股作为阶段性的弹性品种。进入上半年后期，在部分成长类板块出现过快上涨之后进行了阶段性止盈策略。

整体上保持了比较中性的股票仓位，以结构调整为主应对市场波动，选股标准仍然强调估值约束，以及中期景气度和估值的匹配程度。

但存在不足的是，对于部分阶段性景气度较高的行业，没有获取太充分的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实浦盈一年持有期混合 A 基金份额净值为 1.0119 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.19%；截至本报告期末嘉实浦盈一年持有期混合 C 基金份额净值为 1.0105 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.05%；业绩比较基准收益率为 1.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年宏观经济：

我们认为，国内疫情虽然有小幅反复，但整体控制良好，不会对经济产生明显影响。同时货币政策也保持整体稳健的状态，因此我们认为经济依然是保持稳健运行的格局。但需要关注的是，全球大宗商品的上涨，对于国内通胀水平的传导，最终结果如何？是否会引发货币政策的调整，进而影响宏观经济走势和资本市场波动？对此我们会密切关注。

股票市场展望：

对于近期市场的大幅波动，我们的理解是：总量经济处于相对波澜不惊的状态，因此股市没有大的基于宏观经济的波动。同时流动性相对比较稳定，因此资金主要集中在局部基本面改善明确的部分细分行业当中，并且表现出明显的聚集效应，短期涨幅较大。但总量资金的有限性，也体现在其他行业的表现低迷上。

后续的展望：我们认为中短期内，“疫情超预期恶化，以及货币政策退出”，这些市场担忧的问题可能都不会出现，整体经济可能处于弱稳定的格局，不存在明显的下行风险。因此市场在明显调整之后，整体性价比较高，风险释放比较充分。

在股票仓位上我们依然是保持稳健中性的水平，不去作过多的短期博弈。自上而下角度我们还是采取两端策略：一方面配置安全边际充分的部分高分红类资产。一方面经济稳定，可能会带来部分行业基本面改善的逻辑，在选取行业上更加聚焦，这将是我们的下半年的主要操作策略。

债券市场展望：

从总量上来看，下半年总体情况平稳；K 型复苏下，监管层更担心消费、就业、中小企业的问题，尽管面临 PPI 的压力，货政选择了鸽派策略。但我们非常担心货政过于宽松，房价有失控的风险；同时中国还没有进入流动性陷阱，不排除一致性预期证伪，经济较预期强，货政有恢复正常的动力。短期来看，在降准之后，整体债券利率仍然受制于宽松的货币政策，有一定下行的趋势，但中期维度考虑当前绝对收益率估值水平和分位数，可能都不支持在当前的点位继续大幅下行，因此大概率面临一个胜率高赔率低的格局。我们也将适度调整对于宏观、经济和货币政策框架的观测维度，紧跟市场和央行的政策变化。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由嘉实基金管理有限公司编制本托管人复核的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”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	87,659,246.87
结算备付金		34,825,962.97
存出保证金		9,390,664.84
交易性金融资产	6.4.7.2	9,088,688,545.46
其中：股票投资		525,052,445.46
基金投资		-
债券投资		7,489,066,500.00
资产支持证券投资		1,074,569,600.00
贵金属投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	499,851,389.78
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	103,601,757.67
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		9,824,017,567.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 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		-
应付证券清算款		16,081,070.62
应付赎回款		-
应付管理人报酬		4,822,491.53
应付托管费		1,607,497.19
应付销售服务费		211,695.13
应付交易费用	6.4.7.7	1,519,724.14
应交税费		622,021.24
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	40,452.50
负债合计		24,904,952.35
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	9,684,679,762.86
未分配利润	6.4.7.10	114,432,852.38
所有者权益合计		9,799,112,615.24
负债和所有者权益总计		9,824,017,567.59

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 26 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 02 月 26 日起至 2021 年 06 月 30 日止。报告截止日 2021 年 06 月 30 日，嘉实浦盈一年持有期混合 A 基金份额净值 1.0119 元，基金份额总额 9,046,271,825.04 份，嘉实浦盈一年持有期混合 C 基金份额净值 1.0105 元，基金份额总额 638,407,937.82 份，基金份额总额合计为 9,684,679,762.86 份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期
		2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		147,408,237.56
1. 利息收入		96,735,277.84
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,396,956.09
债券利息收入		70,510,704.38
资产支持证券利息收入		10,919,695.70
买入返售金融资产收入		9,907,921.67
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-403,342.09
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,404,145.64
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	2,088,036.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-50,457.15
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-916,000.00
股利收益	6.4.7.16	1,879,223.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	51,076,301.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-
减：二、费用		32,975,385.18
1. 管理人报酬	-	19,836,139.21
2. 托管费	-	6,612,046.47
3. 销售服务费	-	871,174.08
4. 交易费用	6.4.7.19	3,996,689.97
5. 利息支出		1,381,806.11
其中：卖出回购金融资产支出		1,381,806.11
6. 税金及附加		209,518.40
7. 其他费用	6.4.7.20	68,010.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		114,432,852.38
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		114,432,852.38

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,684,679,762.86	-	9,684,679,762.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	114,432,852.38	114,432,852.38
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	9,684,679,762.86	114,432,852.38	9,799,112,615.24

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

黄志泉

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金（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[2021]243号《关于准予嘉实浦盈一年持有期混合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2021年2月20日至2021年2月24日向社会公开募集，基金合同于2021年2月26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9,684,679,762.86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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

6.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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〉》及其他中国证监会

及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

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于 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

6.4.4.4 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的股票、债券等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债

的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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份额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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）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；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 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，由基金管理人根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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为现金分红；

(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) 由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，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，但应于变更实施日前按照《信息披露办法》的要求在规定媒介公告。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 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。

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

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 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。

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 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。

6.4.6.5 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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	87,659,246.87
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	87,659,246.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	494,406,265.60	525,052,445.46	30,646,179.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	913,979,284.38	-988,784.38
	银行间市场	6,557,302,361.10	18,773,638.90
	合计	7,471,281,645.48	17,784,854.52
资产支持证券	1,072,488,752.57	1,074,569,600.00	2,080,847.43
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	9,038,176,663.65	9,088,688,545.46	50,511,881.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-564,420.00	-	-	

其中：股指期货投资	-564,420.00	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	-564,420.00	-	-

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金买入 IF2109 持仓量为 40 手，对应合约市值 61,996,800.00 元，公允价值变动 1,176,660.00 元；卖出 IF2109 持仓量为 40 手，对应合约市值 -61,996,800.00 元，公允价值变动 -612,240.00 元。公允价值变动总额合计 564,420.00 元，可抵消期货暂收款 564,420.00 元，股指期货投资净额为零。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	499,851,389.78	-
合计	499,851,389.78	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	66,103.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	49,633.91
应收债券利息	98,395,651.50
应收资产支持证券利息	4,967,613.10
应收买入返售证券利息	122,467.89
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	288.00
合计	103,601,757.67

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,431,695.73
银行间市场应付交易费用	88,028.41
合计	1,519,724.14

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	40,452.50
合计	40,452.50

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

嘉实浦盈一年持有期混合 A

项目	本期 2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	9,046,271,825.04	9,046,271,825.04
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
-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	9,046,271,825.04	9,046,271,825.04

嘉实浦盈一年持有期混合 C

项目	本期 2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	638,407,937.82	638,407,937.82
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

-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	638,407,937.82	638,407,937.82

注：(1) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金合同于 2021 年 02 月 26 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 9,684,679,762.86 份基金份额，其中认购资金利息折合 713,694.80 份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实浦盈一年持有期混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	59,997,357.28	47,711,519.83	107,708,877.11
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,997,357.28	47,711,519.83	107,708,877.11

嘉实浦盈一年持有期混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,359,193.29	3,364,781.98	6,723,975.27
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,359,193.29	3,364,781.98	6,723,975.27

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
活期存款利息收入	5,042,368.38
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	352,530.97
其他	2,056.74
合计	5,396,956.09

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,404,145.64
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	-3,404,145.64

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出股票成交总额	1,363,834,410.36
减：卖出股票成本总额	1,367,238,556.00
买卖股票差价收入	-3,404,145.64

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	2,088,036.90
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	2,088,036.90

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,611,322,922.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,580,276,016.95
减：应收利息总额	28,958,868.85
买卖债券差价收入	2,088,036.90

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	157,708,110.46
减：卖出资产支持证券成本总额	157,754,957.15
减：应收利息总额	3,610.46
资产支持证券投资收益	-50,457.15

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
国债期货投资收益	-916,000.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,879,223.80
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	1,879,223.80

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	50,511,881.81
股票投资	30,646,179.86
债券投资	17,784,854.52
资产支持证券投资	2,080,847.43
基金投资	-

贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	564,420.00
权证投资	-
期货投资	564,420.00
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	51,076,301.81

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
交易所市场交易费用	3,938,164.97
银行间市场交易费用	58,525.00
合计	3,996,689.97

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年2月26日（基金合同生效日）至2021年6月30日
审计费用	40,452.50
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	27,158.44
其他	400.00
合计	68,010.94

6.4.7.21 分部报告

无。

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
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	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

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
	2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	19,836,139.21
其中：支付销售机构的客户维护费	197,294.19

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 0.6% 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×0.6%/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
	2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,612,046.47

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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×0.2%/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		
	2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉实浦盈一年持有期混 合 A	嘉实浦盈一年持有期混 合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	9,991.91	9,991.91
浦发银行	-	725,976.30	725,976.30
嘉实财富	-	122.84	122.84
合计	-	736,091.05	736,091.05

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 2021 年 2 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司_活期	87,659,246.87	5,042,368.38

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(2021年2月26日(基金合同生效日)至2021年6月30日),本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末(2021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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月	2021年10月	新股锁定	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

		15日	月26日							
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股锁定	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月	2021年12	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-

		4日	月16日							
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新发未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新发未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021年6月	2021年12	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-

		2 日	月 10 日							
688076	诺泰生物	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定	15.57	48.55	4,984	77,600.88	241,973.20	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新发未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688131	皓元医药	2021 年 6 月 1 日	2021 年 12 月 8 日	新股锁定	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新发未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688425	铁建重工	2021 年 6 月 11 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁定	2.87	4.75	135,282	388,259.34	642,589.50	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新发未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113049	长汽转债	2021 年 6 月 11 日	2021 年 07 月 08 日	新债未上市	100.00	100.00	2,050	205,000.00	205,000.00	-

注：1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

2. 基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

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。

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同责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日
A-1	501,766,000.00
A-1 以下	-
未评级	810,849,000.00
合计	1,312,615,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	4,315,235,000.00
AAA 以下	1,032,985,500.00
未评级	-
合计	5,348,220,500.00

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日
AAA	1,074,569,600.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	1,074,569,600.00

注：评级取自第三方评级机构。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日
AAA	165,087,000.00
AAA 以下	-
未评级	-
合计	165,087,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

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。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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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 6.4.12.3 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。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	87,659,246.87	-	-	-	87,659,246.87
结算备付金	34,825,962.97	-	-	-	34,825,962.97
存出保证金	711,112.84	-	-	8,679,552.00	9,390,664.84
交易性金融资产	3,653,443,400.00	3,948,598,700.00	961,594,000.00	525,052,445.46	9,088,688,545.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	499,851,389.78	-	-	-	499,851,389.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	103,601,757.67	103,601,757.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,276,491,112.46	3,948,598,700.00	961,594,000.00	637,333,755.13	9,824,017,567.59
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	-	-	-	16,081,070.62	16,081,070.62
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,822,491.53	4,822,491.53
应付托管费	-	-	-	1,607,497.19	1,607,497.19
应付销售服务费	-	-	-	211,695.13	211,695.13

应付交易费用	-	-	-	1,519,724.14	1,519,724.14
应付税费	-	-	-	622,021.24	622,021.24
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	40,452.50	40,452.50
负债总计	-	-	-	24,904,952.35	24,904,952.35
利率敏感度缺口	4,276,491,112.46	3,948,598,700.00	961,594,000.00	612,428,802.78	9,799,112,615.24

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（2021年6月30日）
分析	市场利率上升25个基点	-23,482,932.87
	市场利率下降25个基点	23,635,824.01

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，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。

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

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（2021年6月30日）
分析	所有外币相对人民币升值5%	-
	所有外币相对人民币贬值5%	-

6.4.13.4.3 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。

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 2021年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	525,052,445.46	5.36
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	525,052,445.46	5.36

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 (2021年6月30日)
分析	业绩比较基准上升 5%	139,853,328.00
	业绩比较基准下降 5%	-139,853,328.00

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 517,901,331.10 元，属于第二层次的余额为人民币 8,570,787,214.36 元，无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关证券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，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生转换。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	525,052,445.46	5.34
	其中：股票	525,052,445.46	5.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,563,636,100.00	87.17
	其中：债券	7,489,066,500.00	76.23
	资产支持证券	1,074,569,600.00	10.94
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	499,851,389.78	5.09
	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	122,485,209.84	1.25
8	其他各项资产	112,992,422.51	1.15
9	合计	9,824,017,567.59	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	5,966,027.38	0.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	306,164,088.47	3.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,351,106.21	0.35
E	建筑业	14,356.93	0.00
F	批发和零售业	17,939.46	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	36,152,657.01	0.37
H	住宿和餐饮业	2,995,570.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,110,770.40	0.16
J	金融业	111,587,353.10	1.14
K	房地产业	6,803,680.00	0.07
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,888,896.50	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	525,052,445.46	5.36

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	601398	工商银行	5,595,400	28,928,218.00	0.30
2	600036	招商银行	503,500	27,284,665.00	0.28
3	002444	巨星科技	472,800	16,113,024.00	0.16
4	601939	建设银行	2,261,200	15,036,980.00	0.15
5	002142	宁波银行	367,100	14,305,887.00	0.15
6	000001	平安银行	547,700	12,388,974.00	0.13
7	600426	华鲁恒升	393,300	12,172,635.00	0.12

8	601633	长城汽车	266,100	11,599,299.00	0.12
9	603008	喜临门	346,238	11,429,316.38	0.12
10	600886	国投电力	1,104,000	10,609,440.00	0.11
11	002179	中航光电	133,500	10,549,170.00	0.11
12	601799	星宇股份	45,900	10,360,548.00	0.11
13	002475	立讯精密	219,600	10,101,600.00	0.10
14	002791	坚朗五金	51,700	10,032,385.00	0.10
15	002541	鸿路钢构	169,000	9,861,150.00	0.10
16	601009	南京银行	934,600	9,831,992.00	0.10
17	002648	卫星石化	249,380	9,773,202.20	0.10
18	603885	吉祥航空	610,720	9,319,587.20	0.10
19	002311	海大集团	108,700	8,869,920.00	0.09
20	600309	万华化学	79,815	8,685,468.30	0.09
21	002025	航天电器	170,300	8,543,951.00	0.09
22	600519	贵州茅台	4,000	8,226,800.00	0.08
23	600377	宁沪高速	831,389	8,114,356.64	0.08
24	002415	海康威视	117,100	7,552,950.00	0.08
25	600674	川投能源	607,500	7,490,475.00	0.08
26	600483	福能股份	657,700	6,899,273.00	0.07
27	601006	大秦铁路	1,047,400	6,891,892.00	0.07
28	601155	新城控股	163,550	6,803,680.00	0.07
29	300454	深信服	25,900	6,720,532.00	0.07
30	600486	扬农化工	58,600	6,549,722.00	0.07
31	601021	春秋航空	114,424	6,510,725.60	0.07
32	000858	五粮液	21,802	6,494,597.78	0.07
33	600600	青岛啤酒	56,001	6,476,515.65	0.07
34	300628	亿联网络	74,000	6,201,200.00	0.06
35	300083	创世纪	550,100	6,023,595.00	0.06
36	002714	牧原股份	97,400	5,923,868.00	0.06
37	002430	杭氧股份	166,000	5,741,940.00	0.06
38	300395	菲利华	116,300	5,607,986.00	0.06
39	300122	智飞生物	29,047	5,423,946.31	0.06
40	601816	京沪高铁	1,004,933	5,316,095.57	0.05
41	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.05
42	002390	信邦制药	485,600	5,089,088.00	0.05
43	600399	抚顺特钢	278,900	5,059,246.00	0.05
44	300866	安克创新	29,600	4,957,112.00	0.05
45	000301	东方盛虹	229,900	4,804,910.00	0.05
46	600862	中航高科	150,400	4,629,312.00	0.05
47	600031	三一重工	158,000	4,593,060.00	0.05
48	300124	汇川技术	59,350	4,407,331.00	0.04
49	300012	华测检测	138,200	4,405,816.00	0.04

50	600900	长江电力	203,500	4,200,240.00	0.04
51	002078	太阳纸业	308,700	4,121,145.00	0.04
52	600030	中信证券	151,400	3,775,916.00	0.04
53	300750	宁德时代	6,700	3,583,160.00	0.04
54	300496	中科创达	21,900	3,439,614.00	0.04
55	688016	心脉医疗	7,418	3,372,296.98	0.03
56	603039	泛微网络	49,880	3,319,514.00	0.03
57	600660	福耀玻璃	58,500	3,267,225.00	0.03
58	300782	卓胜微	6,060	3,257,250.00	0.03
59	600563	法拉电子	20,200	3,198,872.00	0.03
60	603345	安井食品	12,400	3,149,848.00	0.03
61	601100	恒立液压	36,500	3,136,080.00	0.03
62	603195	公牛集团	15,500	3,131,000.00	0.03
63	600754	锦江酒店	52,600	2,995,570.00	0.03
64	002409	雅克科技	36,700	2,972,700.00	0.03
65	002139	拓邦股份	163,150	2,935,068.50	0.03
66	002511	中顺洁柔	105,300	2,901,015.00	0.03
67	603113	金能科技	157,000	2,835,420.00	0.03
68	002925	盈趣科技	71,837	2,795,177.67	0.03
69	688026	洁特生物	32,330	2,783,613.00	0.03
70	300661	圣邦股份	10,650	2,691,574.50	0.03
71	601012	隆基股份	29,820	2,649,208.80	0.03
72	002410	广联达	38,400	2,618,880.00	0.03
73	002690	美亚光电	45,600	2,542,656.00	0.03
74	002372	伟星新材	119,200	2,463,864.00	0.03
75	000333	美的集团	34,500	2,462,265.00	0.03
76	603486	科沃斯	10,760	2,454,140.80	0.03
77	600690	海尔智家	89,934	2,330,189.94	0.02
78	002271	东方雨虹	34,400	1,903,008.00	0.02
79	300285	国瓷材料	36,500	1,779,375.00	0.02
80	688425	铁建重工	135,282	642,589.50	0.01
81	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.00
82	688076	诺泰生物	4,984	241,973.20	0.00
83	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
84	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
85	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
86	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
87	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
88	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
89	300967	晓鸣股份	2,361	36,719.88	0.00
90	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
91	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00

92	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
93	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
94	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
95	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
96	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
97	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
98	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
99	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
100	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
101	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
102	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
103	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
104	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
105	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
106	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
107	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
108	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
109	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
110	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
111	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
112	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
113	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
114	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
115	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
116	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
117	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
118	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
119	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
120	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
121	688383	新益昌	24	3,384.24	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	65,602,542.11	0.67
2	601398	工商银行	63,824,223.47	0.65
3	600036	招商银行	62,184,883.00	0.63
4	600886	国投电力	44,466,123.51	0.45
5	600309	万华化学	43,649,821.39	0.45
6	601155	新城控股	41,193,266.75	0.42
7	600019	宝钢股份	38,634,393.20	0.39

8	000001	平安银行	37,934,696.86	0.39
9	601021	春秋航空	37,212,155.75	0.38
10	600426	华鲁恒升	36,922,163.20	0.38
11	600674	川投能源	34,922,111.97	0.36
12	600377	宁沪高速	32,650,798.44	0.33
13	603885	吉祥航空	31,863,579.52	0.33
14	002142	宁波银行	31,083,343.72	0.32
15	600519	贵州茅台	29,557,484.44	0.30
16	600690	海尔智家	26,719,352.60	0.27
17	002078	太阳纸业	26,340,436.28	0.27
18	300083	创世纪	26,142,613.00	0.27
19	002791	坚朗五金	25,387,029.00	0.26
20	601816	京沪高铁	25,113,150.68	0.26

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601939	建设银行	47,423,689.88	0.48
2	600019	宝钢股份	38,385,374.37	0.39
3	600036	招商银行	35,972,463.32	0.37
4	600886	国投电力	34,358,822.00	0.35
5	601398	工商银行	34,128,420.00	0.35
6	600309	万华化学	32,542,963.50	0.33
7	601155	新城控股	32,163,746.25	0.33
8	601021	春秋航空	30,129,364.00	0.31
9	600674	川投能源	27,603,832.69	0.28
10	600377	宁沪高速	24,955,956.66	0.25
11	000001	平安银行	24,291,376.75	0.25
12	600926	杭州银行	24,153,302.06	0.25
13	600426	华鲁恒升	23,830,781.50	0.24
14	603885	吉祥航空	23,720,424.90	0.24
15	600690	海尔智家	23,296,992.28	0.24
16	000002	万科 A	22,826,286.00	0.23
17	600519	贵州茅台	20,418,539.60	0.21
18	002430	杭氧股份	20,342,686.92	0.21
19	600801	华新水泥	20,303,426.05	0.21
20	002078	太阳纸业	19,385,852.99	0.20

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	1,861,644,821.60
卖出股票收入（成交）总额	1,363,834,410.36

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,624,533,000.00	16.58
	其中：政策性金融债	663,144,000.00	6.77
4	企业债券	1,065,790,500.00	10.88
5	企业短期融资券	1,312,615,000.00	13.40
6	中期票据	3,320,836,000.00	33.89
7	可转债（可交换债）	205,000.00	0.00
8	同业存单	165,087,000.00	1.68
9	其他	-	-
10	合计	7,489,066,500.00	76.43

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	190207	19 国开 07	1,800,000	181,080,000.00	1.85
2	112103030	21 农业银行 CD030	1,700,000	165,087,000.00	1.68
3	150412	15 农发 12	1,600,000	162,224,000.00	1.66
4	210201	21 国开 01	1,600,000	160,096,000.00	1.63
5	210404	21 农发 04	1,600,000	159,744,000.00	1.63

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	179988	致远 07A2	1,500,000	150,210,000.00	1.53
2	179913	21 信易 1A	500,000	50,065,000.00	0.51
3	137723	绿金 16A1	450,000	45,234,000.00	0.46
4	137835	东裕 02A	450,000	45,144,000.00	0.46
5	179033	橙安 5A2	400,000	40,288,000.00	0.41
6	179751	广益 5A2	400,000	40,164,000.00	0.41
7	179840	荣茂 11 优	390,000	39,058,500.00	0.40
8	179560	广益 2A2	380,000	38,110,200.00	0.39
9	179860	广益 7A2	300,000	30,087,000.00	0.31
10	179903	惠洋 6A1	550,000	29,837,500.00	0.30
11	137748	21 元顺 1A	270,000	27,132,300.00	0.28
12	137895	瑞新 26A1	270,000	27,067,500.00	0.28

13	137891	链融 43A1	250,000	25,062,500.00	0.26
14	137910	惠安 18A2	200,000	20,076,000.00	0.20
15	179312	橙安 7A2	200,000	20,072,000.00	0.20
16	137853	天铭优 02	200,000	20,070,000.00	0.20
17	179919	和熙 1A2	200,000	20,054,000.00	0.20
18	179931	浩诚 8A2	200,000	20,052,000.00	0.20
19	168115	睿安 1A3	200,000	19,920,000.00	0.20
20	189107	安慧 12A1	250,000	19,635,000.00	0.20
21	137386	惠安 11A2	300,000	19,191,000.00	0.20
22	165194	PR3A3	200,000	19,182,000.00	0.20
23	179976	招融 2 优	190,000	19,013,300.00	0.19
24	179650	广益 4A2	180,000	18,102,600.00	0.18
25	165129	万安 2A3	200,000	17,636,000.00	0.18
26	179750	广益 5A1	300,000	17,577,000.00	0.18
27	179899	辰悦 5A1	300,000	16,380,000.00	0.17
28	137821	惠安 17A1	250,000	15,840,000.00	0.16
29	137909	惠安 18A1	200,000	15,444,000.00	0.16
30	189036	广益 8A2	150,000	15,021,000.00	0.15
31	2189139	21 建鑫 1 优 先	200,000	13,270,000.00	0.14
32	179904	惠沅 6A2	120,000	12,043,200.00	0.12
33	137638	惠安 14A1	300,000	10,938,000.00	0.11
34	137822	惠安 17A2	100,000	10,052,000.00	0.10
35	137662	21 合信 08	100,000	10,050,000.00	0.10
36	179845	广益 6A2	100,000	10,038,000.00	0.10
37	137894	万科 18 优	100,000	10,025,000.00	0.10
38	189059	浩诚 9A2	100,000	10,024,000.00	0.10
39	165940	PR9A2	300,000	9,846,000.00	0.10
40	179918	和熙 1A1	120,000	9,312,000.00	0.10
41	189208	浩诚 10A1	100,000	8,773,000.00	0.09
42	189035	广益 8A1	100,000	8,326,000.00	0.08
43	179859	广益 7A1	100,000	7,486,000.00	0.08
44	189190	永安 2A1	80,000	6,880,800.00	0.07
45	179930	浩诚 8A1	100,000	6,819,000.00	0.07
46	137782	惠安 16A2	50,000	5,022,500.00	0.05
47	189108	安慧 12A2	50,000	5,015,000.00	0.05
48	189209	浩诚 10A2	50,000	5,005,000.00	0.05
49	189062	和熙 2A1	50,000	3,997,500.00	0.04
50	189063	和熙 2A2	30,000	3,005,700.00	0.03
51	179774	浩诚 7A1	50,000	2,968,000.00	0.03
52	137781	惠安 16A1	50,000	2,694,500.00	0.03
53	168114	PR1A2	200,000	2,252,000.00	0.02

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IF2109	IF2109	40	61,996,800.00	1,176,660.00	-
IF2109	IF2109	-40	-61,996,800.00	-612,240.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					564,420.00
股指期货投资本期收益 (元)					-
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					564,420.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货等衍生工具,投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。

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

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

本基金投资国债期货主要以控制风险和增厚收益为主,基于对短期货币政策和利率市场的判断,结合持仓进行套期保值,通过国债期货的套保把握波段操作机会。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代 码	名 称	持仓量 (买/ 卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险指标说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
国债期货投资本期收益 (元)					-916,000.00
国债期货投资本期公允价值变动 (元)					-

7.11.3 本期国债期货投资评价

本期期货投资操作上偏短期交易行为,通过对短端的阶段性套期保值操作降低组合的波动性,将回撤保持在可控范围以内。

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

(1) 2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字【2020】67 号），对国家开发银行为违规的政府购买服务项目提供融资等违法违规事实，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 4880 万元。

2021 年 1 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会发布中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）71 号），对中国工商银行股份有限公司未按规定将案件风险事件确认为案件并报送案件信息确认报告、关键岗位未进行实质性轮岗、法人账户日间透支业务存在资金用途管理的风险漏洞、为同业投资业务提供隐性担保等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第三十三条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2020 年 12 月 25 日作出行政处罚决定，罚款 5470 万元。

2020 年 12 月 5 日，中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）60 号），对中国银行股份有限公司对中国银行“原油宝”产品风险事件相关违法违规行为主要包括产品管理不规范、风险管理不审慎、内控管理不健全、销售管理不合规等，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2020 年 12 月 1 日作出行政处罚决定，罚款合计 5050 万元。2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）11 号），对中国银行股份有限公司关于向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款、存款月末冲时点、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足、与名单外交易对手开展同业业务等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第七十四条和相关审慎经营规则，于 2021 年 5 月 17 日做出行政处罚决定，罚款共计 8761.355 万元。

2020 年 7 月 13 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）36 号），对向关系人发放信用贷款、批量处置不良资产未公告、批量处置不良资产未向监管部门报告等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第（五）项，《中华人民共和国商业银行法》第四十条、第五十五条、第七十四条和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元。2021 年 1 月 19 日，根据中国银行保险监督管理委员会行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）1 号），对发生重要信息系统突发事件未报告等违法违规行为，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第五项和相关审慎经营规则，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司处以罚款 420

万元的行政处罚。

本基金投资于“19 国开 07(190207)”、“21 国开 01(210201)”、“17 工商银行二级 01(1728021)”、“17 工商银行二级 02 (1728022)”、“17 中国银行二级 02 (1728020)”、“21 农业银行 CD030 (112103030)”、“17 农业银行二级 (1728018)”的决策程序说明：基于对 19 国开 07、21 国开 01、17 工商银行二级 01、17 工商银行二级 02、17 中国银行二级 02、21 农业银行 CD030、17 农业银行二级的信用分析以及二级市场的判断，本基金投资于“19 国开 07”、“21 国开 01”、“17 工商银行二级 01”、“17 工商银行二级 02”、“17 中国银行二级 02”、“21 农业银行 CD030”、“17 农业银行二级”债券的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他三名证券发行主体无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。

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	9,390,664.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	103,601,757.67
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,992,422.51

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（%）
嘉实浦盈一年持有期混合 A	60,559	149,379.48	-	-	9,046,271,825.04	100.00
嘉实浦盈一年持有期混合 C	20,770	30,737.02	-	-	638,407,937.82	100.00
合计	81,110	119,401.80	-	-	9,684,679,762.86	100.00

注：(1) 嘉实浦盈一年持有期混合 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浦盈一年持有期混合 A 份额占嘉实浦盈一年持有期混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实浦盈一年持有期混合 A 份额占嘉实浦盈一年持有期混合 A 总份额比例；

(2) 嘉实浦盈一年持有期混合 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浦盈一年持有期混合 C 份额占嘉实浦盈一年持有期混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实浦盈一年持有期混合 C 份额占嘉实浦盈一年持有期混合 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	嘉实浦盈一年持有期混合 A	1,171,082.44	0.01
	嘉实浦盈一年持有期混合 C	2,144,717.61	0.34
	合计	3,315,800.05	0.03

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实浦盈一年持有期混合 A	50~100
	嘉实浦盈一年持有期混合 C	>=100
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实浦盈一年持有期混合 A	50~100
	嘉实浦盈一年持有期混合 C	0
	合计	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实浦盈一年持有期混合 A	嘉实浦盈一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021年2月26日) 基金份额总额	9,046,271,825.04	638,407,937.82
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	-	-
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额（份额减少 以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份 额总额	9,046,271,825.04	638,407,937.82

§ 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

2021 年 5 月 29 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》，杨竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

2021 年 5 月 13 日本基金管理人发布《关于新增嘉实浦盈一年持有期混合基金经理的公告》，增聘黄欣欣先生担任本基金基金经理，与王茜女士共同管理本基金。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

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

报告期内本基金聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的审计机构。

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、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。

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	
招商证券股份有限公司	2	1,101,654,764.59	34.25%	771,161.88	34.25%	-

公司						
华泰证券 股份有限 公司	1	606,087,051.06	18.85%	424,264.76	18.85%	-
申万宏源 证券有限 公司	1	601,025,416.51	18.69%	420,717.79	18.69%	-
长江证券 股份有限 公司	1	467,105,242.88	14.52%	326,973.67	14.52%	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	271,472,081.06	8.44%	190,030.48	8.44%	-
中国银河 证券股份 有限公司	2	168,768,696.80	5.25%	118,139.43	5.25%	-
渤海证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
江海证券 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 华南股份 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。

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
招商证券股份有限公司	1,291,190,600.00	88.32%	34,610,000,000.00	82.27%	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	8,029,928.70	0.55%	2,900,000,000.00	6.89%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	7,400,581.80	0.51%	860,000,000.00	2.04%	-	-
中国银河证券股份有限公司	155,280,185.88	10.62%	3,700,000,000.00	8.79%	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券华南股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	关于嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金调整募集期限的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 10 日
2	嘉实基金管理有限公司关于直销平台调整部分基金费率的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 19 日
3	关于嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 24 日
4	嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 02 月 27 日
5	关于新增嘉实浦盈一年持有期混合基金经理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 13 日
6	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实浦盈一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实浦盈一年持有期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) 报告期内嘉实浦盈一年持有期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

2021 年 8 月 27 日