

嘉实量化精选股票型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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。

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

基金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 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止，原嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 11 月 25 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	6
2.1 基金基本情况（转型后）	6
2.1 基金基本情况（转型前）	6
2.2 基金产品说明（转型后）	6
2.2 基金产品说明（转型前）	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料(转型后)	7
2.5 其他相关资料(转型前)	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)	8
3.2 基金净值表现（转型后）	9
3.2 基金净值表现（转型前）	11
3.3 其他指标	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型后）	13
3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）	13
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	20
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	20
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.....	20
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.....	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	20
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.....	21
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.....	21
§6 审计报告（转型后）	21

6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§6 审计报告（转型前）	23
6.1 审计报告基本信息	23
6.2 审计报告的基本内容	23
§7 年度财务报表（转型后）	25
7.1 资产负债表	25
7.2 利润表	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	28
§7 年度财务报表（转型前）	56
7.1 资产负债表	56
7.2 利润表	57
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	59
7.4 报表附注	60
§8 投资组合报告（转型后）	90
8.1 期末基金资产组合情况	90
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	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	91
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	96
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	98
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	98
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	98
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	98
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	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	99
8.12 投资组合报告附注	99
§8 投资组合报告（转型前）	100
8.1 期末基金资产组合情况	100
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	100
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	101
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	107
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	112
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	112
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	112
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	112
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	112
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	113
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	113

8.12 投资组合报告附注	113
§9 基金份额持有人信息（转型后）	114
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	114
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	114
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.....	114
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	115
§9 基金份额持有人信息（转型前）	115
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	115
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	115
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.....	115
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	115
§10 开放式基金份额变动（转型后）	115
§10 开放式基金份额变动（转型前）	116
§11 重大事件揭示.....	116
11.1 基金份额持有人大会决议	116
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.....	117
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	117
11.4 基金投资策略的改变	117
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	117
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.....	118
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后).....	118
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前).....	123
11.8 其他重大事件（转型后）	128
11.8 其他重大事件（转型前）	129
§12 影响投资者决策的其他重要信息	130
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	130
§13 备查文件目录.....	130
13.1 备查文件目录	130
13.2 存放地点	131
13.3 查阅方式	131

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况（转型后）

基金名称	嘉实量化精选股票型证券投资基金
基金简称	嘉实量化精选股票
基金主代码	001637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 11 月 26 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	330,951,847.08 份
基金合同存续期	不定期

2.1 基金基本情况（转型前）

基金名称	嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金
基金简称	嘉实腾讯自选股大数据策略股票
基金主代码	001637
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 7 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	364,323,192.22 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明（转型后）

投资目标	本基金以各类大数据为基础构建量化投资策略，力争在严格控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过量化投资方法深入分析和挖掘大数据与股票价格波动之间的关系，以大数据策略研究形成对个股投资价值的综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合。具体投资策略包括：大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、融资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+中证综合债券指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型、债券型和货币市场基金。

2.2 基金产品说明（转型前）

投资目标	本基金以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将腾讯自选股大数据和行为金融模型相结合，构建大数据量化投资策略模型，在此基础上生成基金股票组合，力争获得长期、

	持续的超额收益。具体投资策略包括：大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、风险管理策略。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+中证综合债券指数收益率*5%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	胡勇钦
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
客户服务电话	400-600-8800	95588
传真	(010)65215588	(010)66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100005	100140
法定代表人	经雷	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金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(转型后)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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

2.5 其他相关资料(转型前)

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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(转型后)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,963,590.54
本期利润	10,016,732.83
加权平均基金份额本期利润	0.0279
本期加权平均净值利润率	1.44%
本期基金份额净值增长率	1.58%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末
期末可供分配利润	311,667,513.58
期末可供分配基金份额利润	0.9417
期末基金资产净值	648,173,570.19
期末基金份额净值	1.9585
3.1.3 累计期末指标	2021 年末
基金份额累计净值增长率	1.58%

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

3.1 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年 1 月 1 日-2021 年 11 月 25 日	2020 年	2019 年
本期已实现收益	48,934,057.64	62,137,725.60	64,799,098.48
本期利润	56,479,846.72	52,455,863.86	92,423,046.67
加权平均基金份额本期利润	0.2837	0.3593	0.3634
本期加权	15.35%	26.10%	35.32%

平均净值利润率			
本期基金份额净值增长率	21.87%	36.26%	43.69%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年 11 月 25 日	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	338,064,485.72	78,738,517.37	39,575,617.08
期末可供分配基金份额利润	0.9279	0.5816	0.1609
期末基金资产净值	702,387,677.94	214,118,972.22	285,489,263.15
期末基金份额净值	1.928	1.582	1.161
3.1.3 累计期末指标	2021 年 11 月 25 日	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	106.06%	58.20%	16.10%

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

3.2 基金净值表现（转型后）

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

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

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 95\% \times (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

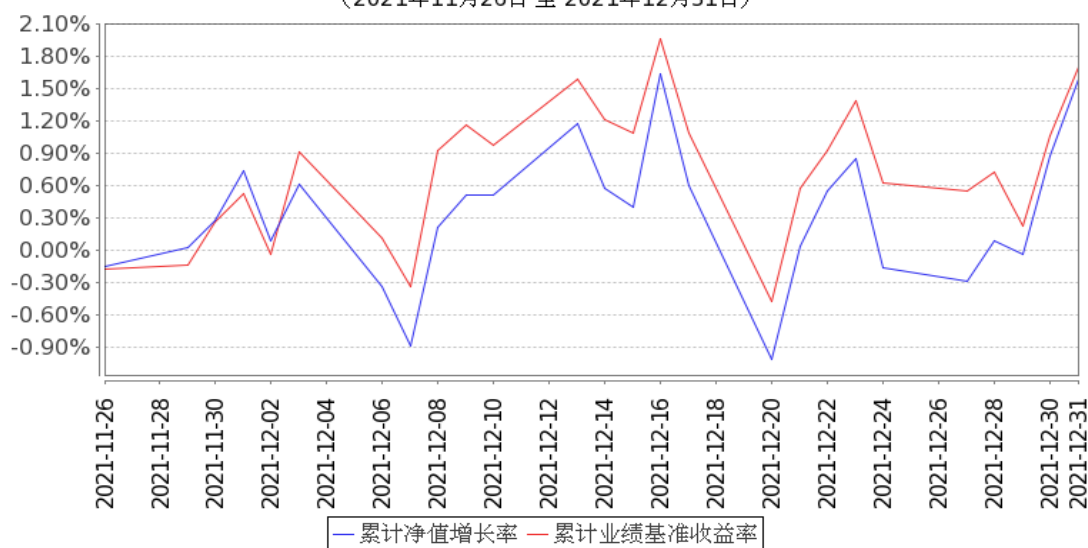
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

其中， $t = 1, 2, 3, \dots, T$ ， T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金转型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

嘉实量化精选股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年11月26日至2021年12月31日)

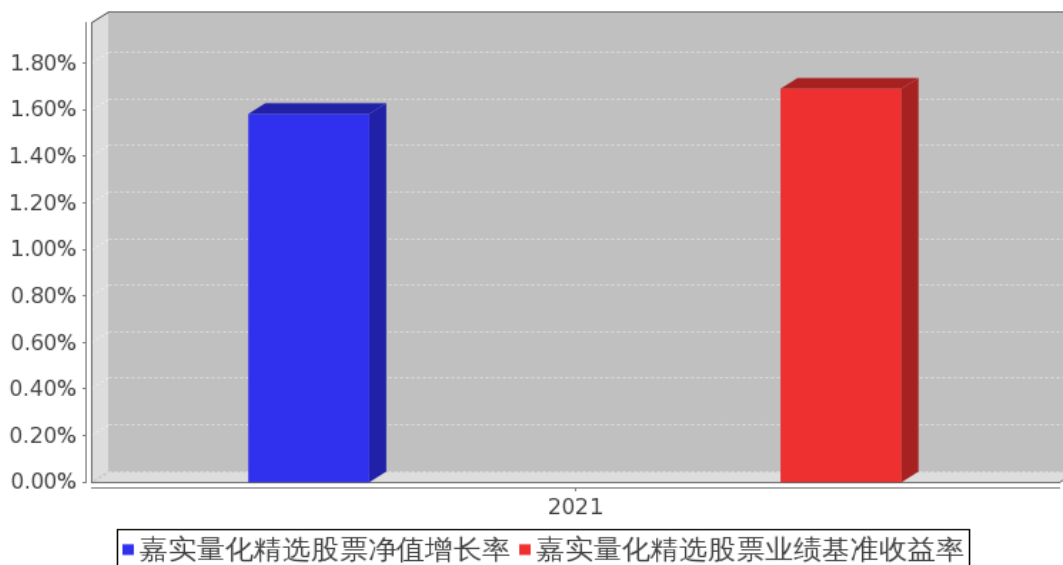


注：（1）本基金合同生效日 2021 年 11 月 26 日至报告期末未满 1 年。

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

3.2.3 自基金转型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

嘉实量化精选股票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。

3.2 基金净值表现（转型前）

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

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

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{Return}(t) = 95\% \times (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 指数}(t-1) - 1) + 5\% \times (\text{中证综合债券指数}(t) / \text{中证综合债券指数}(t-1) - 1)$$

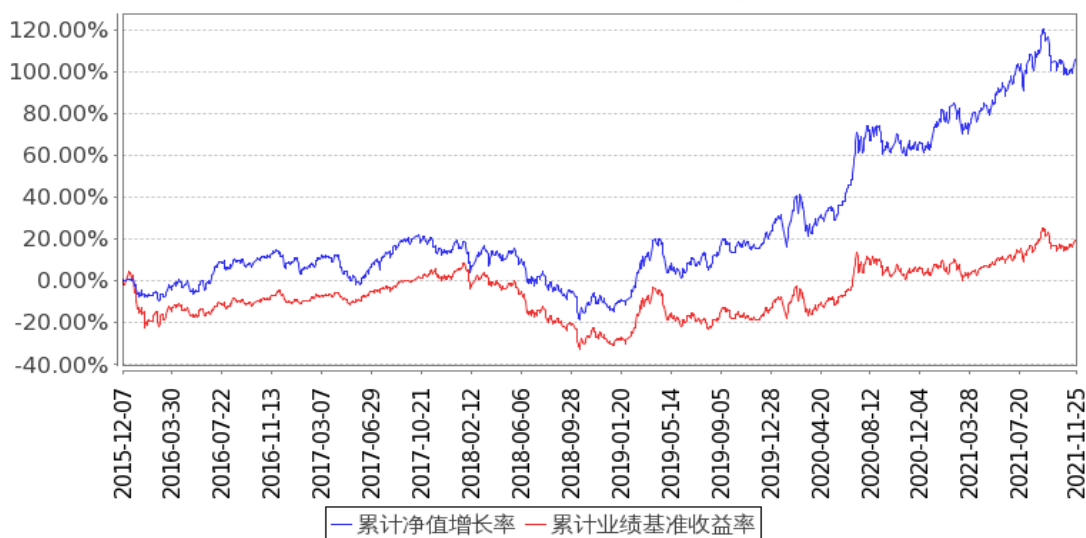
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

嘉实腾讯自选股大数据策略股票累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年12月07日至2021年11月25日)

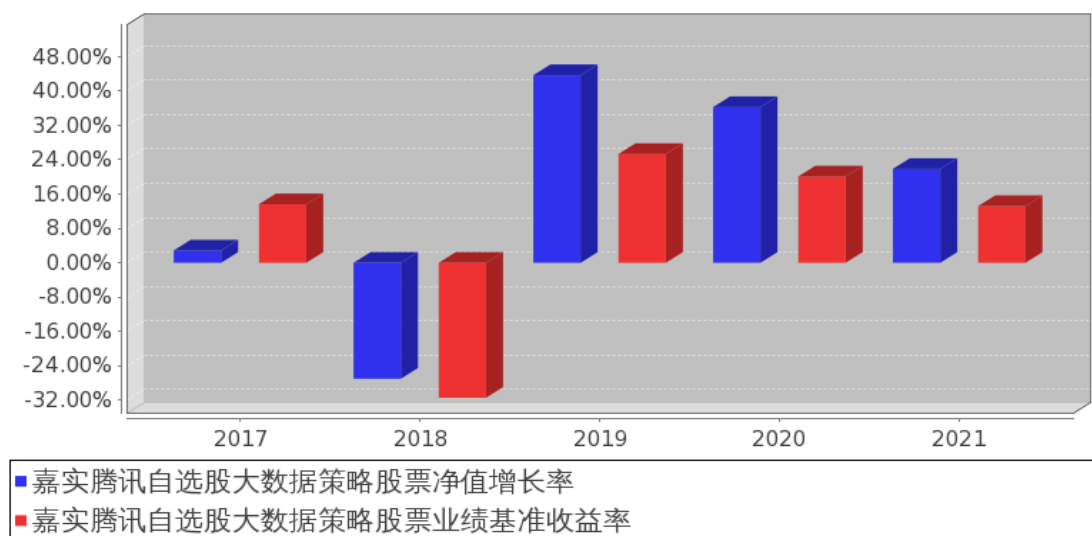


注：(1) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

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

3.2.3 过去五年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

嘉实腾讯自选股大数据策略股票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（转型后）

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况（转型前）

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2021年12月31日，基金管理人共管理258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（转型后）

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

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介（转型前）

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		
刘斌	本基金、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合基金经理	2015年12月7日	2021年11月25日	15年	曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、高级金融工程研究员、基金经理、金融工程与量化投资部总监等职务。2013年12月加入嘉实基金管理有限公司股票投资部，从事投资、研究工作，现任增强风格投资总监。博士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
龙昌	本基金、	2017年6月	2021年	8年	曾任职于建信基金管理有限责任公司投资

伦	嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实中证 500 指数增强基金经理	月 22 日	11 月 25 日		管理部，从事量化研究工作。2015 年 4 月加入嘉实基金管理有限公司，现任职于量化投资部。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。
---	-----------------------------------	--------	-----------	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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（转型后）

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

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.3 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（转型前）

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

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制（转型后）

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。如果基金经理管理的产品业绩低于客户要求的业绩基准，或者三年期业绩低于公募可比竞争组的前 1/2 时，基金

经理将没有奖金激励。

4.1.4 基金经理薪酬机制（转型前）

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。如果基金经理管理的产品业绩低于客户要求的业绩基准，或者三年期业绩低于公募可比竞争组的前 1/2 时，基金经理将没有奖金激励。

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、《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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，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。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、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符合公平交易的监管要求。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；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 2 次，其中 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，另 1 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

2021 年股票市场分化加剧，整体维持震荡格局，风格切换相比 2020 年更加频繁，上证综指

年度涨幅达到 4.80%，前期在公募基金开门红的情况下，持续冲高，同时伴随着成长资产向价值资产的转换，茅指数大幅下挫。而随着货币环境的宽松，核心资产在 3 月后迎来了显著的反弹。市场结构演化至年中，受益于双碳政策以及业绩大幅增长，周期类资产领涨市场，进入 9 月后，市场分化进一步加剧，赛道资产中，新能源表现相对占优，而医药、消费等则持续低迷。

宏观经济上，全球疫情的影响仍在，新冠病毒演变多种变种，奥密克戎带来全球疫情持续反弹，也继续支撑国内出口。国内疫情对经济中的出行、消费影响明显，消费复苏和反弹偏弱，而房地产方面，居民购房需求持续下行，地产销售不振，叠加融资约束使得房企信用风险持续暴露，政策处于微弱放松防范极端风险的状态。价格上，PPI 见顶回落，而 CPI 呈现上行态势，利润从上游向下游迁徙。随着经济增长逐渐走弱，宏观流动性维持在偏宽松态势，但 CPI 的上行对整体宽松流动性形成一定程度制约，特别是这种背景下美联储加息节奏变快。

股票市场方面，在主要宽基指数中，中证 1000、创业板指和中证 500 涨幅居前，而中证 100、上证 50 和沪深 300 则跌幅偏大。从整体看，成长资产和周期资产领涨，消费与金融下跌，同时，中小盘股强于大盘股。行业方面，电力设备、有色金属、煤炭、基础化工和钢铁等涨幅居前，食品饮料、社会服务、房地产、非银金融和家用电器等则表现靠后。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后：

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

转型前：

截至 2021 年 11 月 25 日，嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金份额净值为 1.928 元，自 2021

年 1 月 1 日起至 2021 年 11 月 25 日止，基金份额净值增长率为 21.87%，业绩比较基准收益率为 13.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观角度看，考虑到明年偏弱的增长环境，流动性大概率将维持偏宽松态势。企业盈利方面，2022 年将是 A 股企业盈利向均值回归的一年。在经济增长中性预期下，预计 A 股非金融企业盈利增速在 5%左右，较 2021 年回落幅度较大。节奏上看，本轮盈利周期下行底部在二季度左右见到，随后温和回升。表观名义增速的回落意味着高增长品种在明年将比较稀缺，结构性高景气品种将是市场重点投资对象。与此同时资产荒现象可能较为明显，低估值高分红品种可能也是投资者追求的安全资产。

展望未来，由于宽基指数相比国债的估值比价已经处于历史较高水平，因此当前权益资产的系统性风险有限，一季度大概率是市场情绪的低点。但是考虑到偏弱经济环境下稳增长措施所带来的流动性消耗、以及美国利率持续抬升等风险，预计上半年市场仍将呈现宽幅震荡格局。风格和板块层面，机构持仓集中的高估值成长板块在上半年会持续受估值收缩的负面影响，部分高景气板块可以通过业绩增长来消化估值，高估值但增长低于预期的板块仍将持续回调。

因此，我们在后续的操作中，将继续严密控制风格和行业上的风险暴露，在个股层面会提高估值与未来盈利成长匹配度的要求。

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，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(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，新产品新业务从战略规划到具体产品方案、业务模式，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及调查、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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，本基金的管理人——嘉实基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对嘉实基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告（转型后）

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	普华永道中天审字(2022)第 23858 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	嘉实量化精选股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实量化精选股票型证券投资基金(以下简称“嘉实量化精选股票基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实量化精选股票基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实量化精选股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实量化精选股票基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估嘉实量化精选股票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,除非基金管理人管理层计划清算嘉实量化精选股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实量化精选股票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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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,就可能对嘉实量化精选股票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量化精选股票基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>

	我们与基金管理人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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

§ 6 审计报告（转型前）

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	普华永道中天审字(2022)第 23889 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	嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金(以下简称“嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金”)的财务报表,包括 2021 年 11 月 25 日的资产负债表,2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金 2021 年 11 月 25 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无

其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估嘉实腾讯自选股大数据策略股票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,除非基金管理人管理层计划清算嘉实腾讯自选股大数据策略股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督嘉实腾讯自选股大数据策略股票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。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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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,就可能对嘉实腾讯自选股大数据策略股票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腾讯自选股大数据策略股票基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重</p>

	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。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

§ 7 年度财务报表（转型后）

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实量化精选股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	31,799,841.17
结算备付金		10,429,930.97
存出保证金		960,034.48
交易性金融资产	7.4.7.2	606,862,345.78
其中：股票投资		603,020,121.98
基金投资		-
债券投资		3,842,223.80
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		74,434.45
应收利息	7.4.7.5	42,852.03
应收股利		-
应收申购款		151,218.20
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		650,320,657.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 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		-

应付证券清算款		-
应付赎回款		84,783.23
应付管理人报酬		886,119.08
应付托管费		147,686.52
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	825,978.39
应交税费		27,397.71
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	175,121.96
负债合计		2,147,086.89
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	330,951,847.08
未分配利润	7.4.7.10	317,221,723.11
所有者权益合计		648,173,570.19
负债和所有者权益总计		650,320,657.08

注：本基金合同生效日为 2021 年 11 月 26 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 11 月 26 日起至 2021 年 12 月 31 日止。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9585 元，基金份额总额 330,951,847.08 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 11 月 26 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、收入		11,964,564.79
1. 利息收入		47,714.06
其中：存款利息收入	7.4.7.11	47,206.09
债券利息收入		507.97
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）		5,737,389.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,964,153.02
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	212,181.95

资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	1,524,740.97
股利收益	7.4.7.16	36,313.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,053,142.29
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	126,319.20
减：二、费用		1,947,831.96
1. 管理人报酬	-	1,030,314.17
2. 托管费	-	171,719.03
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	681,436.57
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		2,935.54
7. 其他费用	7.4.7.20	61,426.65
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,016,732.83
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,016,732.83

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实量化精选股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 11 月 26 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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）	364,323,192.22	338,064,485.72	702,387,677.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,016,732.83	10,016,732.83
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）	-33,371,345.14	-30,859,495.44	-64,230,840.58
其中：1. 基金申购款	11,619,347.29	10,806,766.54	22,426,113.83
2. 基金赎回	-44,990,692.43	-41,666,261.98	-86,656,954.41

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）	330,951,847.08	317,221,723.11	648,173,570.19

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：

<u>经雷</u>	<u>梁凯</u>	<u>李袁</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实量化精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)是根据原嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金(以下简称“嘉实腾讯自选股大数据策略股票”)基金份额持有人大会决议通过的《关于嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更基金名称、基金的投资及其他相关事项的议案》，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]3249号《关于准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更注册的批复》，由原嘉实腾讯自选股大数据策略股票变更而来。自 2021 年 11 月 26 日起，原嘉实腾讯自选股大数据策略股票正式变更为嘉实量化精选股票型证券投资基金。原《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》失效，《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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本报告期末的财务状况以及本报告期的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 11 月 26 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费

用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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认列。对于已开放转换业务的基金，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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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未实现损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证券金融公司”)出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，

将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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%。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自动转为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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》

提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税

[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2021 年 12 月 31 日
活期存款	31,799,841.17
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	31,799,841.17

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	588,463,572.48	603,020,121.98	14,556,549.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,842,223.80	134,671.80
	银行间市场	-	-
	合计	3,842,223.80	134,671.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	592,171,124.48	606,862,345.78	14,691,221.30

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 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	5,758,520.00	-	-	
其中：股指期货投资	5,758,520.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,758,520.00	-	-	

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 12 月 31 日，本基金买入 IC2203 持仓量为 4 手，对应合约市值 5,844,640.00 元，公允价值变动 86,120.00 元，公允价值变动总额合计 86,120.00 元，可抵消期货暂收款 86,120.00 元，股指期货投资净额为零。

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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	5,059.09
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	7,032.20
应收债券利息	30,696.94
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
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	63.80
合计	42,852.03

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
交易所市场应付交易费用	825,978.39
银行间市场应付交易费用	-
合计	825,978.39

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	121.96
应付证券出借违约金	-
预提费用	175,000.00
合计	175,121.96

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	364,323,192.22	364,323,192.22
本期申购	11,619,347.29	11,619,347.29
本期赎回（以“-”号填列）	-44,990,692.43	-44,990,692.43
本期末	330,951,847.08	330,951,847.08

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11月26日生效，基金合同生效日的基金份额总额为364,323,192.22份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

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	339,102,095.83	-1,037,610.11	338,064,485.72
本期利润	3,963,590.54	6,053,142.29	10,016,732.83
本期基金份额交易产生的变动数	-31,398,172.79	538,677.35	-30,859,495.44
其中：基金申购款	10,924,023.55	-117,257.01	10,806,766.54
基金赎回款	-42,322,196.34	655,934.36	-41,666,261.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	311,667,513.58	5,554,209.53	317,221,723.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	活期存款利息收入	18,220.93
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	24,134.78	
其他	4,850.38	
合计	47,206.09	

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	3,964,153.02

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	3,964,153.02

7.4.7.12.2 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11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	277,623,078.50
减：卖出股票成本总额	273,658,925.48
买卖股票差价收入	3,964,153.02

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31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	212,181.95
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	212,181.95

7.4.7.13.2 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11月26日（基金合同生效日）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	491,781.90
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	279,000.00
减：应收利息总额	599.95
买卖债券差价收入	212,181.95

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 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11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股指期货投资收益	1,524,740.97

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	36,313.30
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	36,313.30
----	-----------

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	7,069,022.29
股票投资	7,306,608.19
债券投资	-237,585.90
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-1,015,880.00
权证投资	-
期货投资	-1,015,880.00
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	6,053,142.29

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	121,855.23
基金转出费收入	4,463.97
合计	126,319.20

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	681,436.57
银行间市场交易费用	-
合计	681,436.57

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	918.98

信息披露费	11,834.67
证券出借违约金	-
银行划款手续费	673.00
其他	48,000.00
合计	61,426.65

7.4.7.21 分部报告

无。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,030,314.17
其中：支付销售机构的客户维护费	537,843.82

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
	2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	171,719.03

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。

7.4.10.3 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 2021年11月26日（基金合同生效日）至2021年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司_活期	31,799,841.17	18,220.93

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(2021年11月26日(基金合同生效日)至2021年12月31日),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2021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	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
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新发未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-

300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	724	3,844.44	9,774.00	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	359	5,076.26	32,263.33	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定	23.38	29.93	185	4,325.30	5,537.05	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月	2022年1月	新股锁定	6.96	12.51	802	5,581.92	10,033.02	-

		1 日	10 日							
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	60.64	234.74	177	10,733.28	41,548.98	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301063	海锅股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021 年 9 月 13 日	2022 年 3 月 22 日	新股锁定	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷	2021	2022	新股锁	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

	精工	年 9 月 22 日	年 3 月 29 日	定							
301073	君亭酒店	2021 年 9 月 22 日	2022 年 3 月 30 日	新股锁 定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-	
301078	孩子王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股锁 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-	
301081	严牌 股份	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 20 日	新股锁 定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301087	可孚 医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股锁 定	93.09	75.34	189	17,594.01	14,239.26	-	
301089	拓新 药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁 定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301090	华润 材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	新股锁 定	10.45	11.22	1,806	18,872.70	20,263.32	-	
301091	深城 交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股锁 定	36.50	31.31	433	15,804.50	13,557.23	-	
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁 定	36.31	35.52	247	8,968.57	8,773.44	-	
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁 定	58.08	49.85	238	13,823.04	11,864.30	-	
301096	百诚 医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股锁 定	79.60	78.53	211	16,795.60	16,569.83	-	

301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新发未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定	60.66	96.75	510	30,936.60	49,342.50	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	236	20,310.16	22,302.00	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-

301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股锁定	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	372	24,618.96	21,062.64	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股锁定	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年07月05日	新股锁定	57.58	57.58	69,889	4,024,208.62	4,024,208.62	-
600941	中国移动	2021年12月24日	2022年1月5日	新发未上市	57.58	57.58	29,953	1,724,693.74	1,724,693.74	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股锁定	4.53	4.27	363,703	1,647,574.59	1,553,011.81	-

688087	英科再生	2021年6月30日	2022年1月10日	新股锁定	21.96	93.40	1,728	37,946.88	161,395.20	-
688192	迪哲医药	2021年12月3日	2022年6月10日	新股锁定	52.58	34.56	5,857	307,961.06	202,417.92	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新发未上市	41.98	41.98	6,208	260,611.84	260,611.84	-
688670	金迪克	2021年7月23日	2022年2月7日	新股锁定	55.18	74.11	1,069	58,987.42	79,223.59	-
688728	格科微	2021年8月11日	2022年2月18日	新股锁定	14.38	29.31	6,794	97,697.72	199,132.14	-
688739	成大生物	2021年10月21日	2022年4月28日	新股锁定	110.00	70.32	2,100	231,000.00	147,672.00	-
688772	珠海冠宇	2021年9月30日	2022年4月15日	新股锁定	14.43	39.09	8,496	122,597.28	332,108.64	-

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。

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

本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是以各类大数据为基础构建量化投资策略，力争在严格控制风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。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，将风险控制可在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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 2021年12月31日
AAA	-
AAA 以下	442,331.30
未评级	-
合计	442,331.30

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理

的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,799,841.17	-	-	-	31,799,841.17
结算备付金	10,429,930.97	-	-	-	10,429,930.97
存出保证金	141,784.88	-	-	818,249.60	960,034.48
交易性金融资产	3,399,892.50	-	442,331.30	603,020,121.98	606,862,345.78
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	74,434.45	74,434.45
应收利息	-	-	42,852.03	42,852.03
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	151,218.20	151,218.20
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	45,771,449.52	-	442,331.30	604,106,876.26
负债	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	84,783.23	84,783.23
应付管理人报酬	-	-	886,119.08	886,119.08
应付托管费	-	-	147,686.52	147,686.52
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	825,978.39	825,978.39
应付税费	-	-	27,397.71	27,397.71
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	175,121.96	175,121.96
负债总计	-	-	2,147,086.89	2,147,086.89
利率敏感度缺口	45,771,449.52	-	442,331.30	601,959,789.37

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（2021年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-11,020.41
	市场利率下降 25 个基点	11,143.52

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

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（2021年12月31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%	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2021年12月31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	603,020,121.98	93.03
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	603,020,121.98	93.03

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（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	33,642,563.96
	业绩比较基准下降5%	-33,642,563.96

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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中属于第一层次的余额为 593,824,250.43 元，属于第二层次的余额为 13,038,095.35 元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 年度财务报表（转型前）

7.1 资产负债表

会计主体：嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 11 月 25 日（基金合同失效前日）

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 11 月 25 日(基 金合同失效前日)	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	55,359,265.15	21,609,641.08
结算备付金		10,978,908.64	2,297,623.92
存出保证金		3,741,110.48	1,831,916.69
交易性金融资产	7.4.7.2	633,800,072.37	189,715,126.44
其中：股票投资		632,935,814.67	187,931,960.24
基金投资		-	-
债券投资		864,257.70	1,783,166.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	373,206.26

应收利息	7.4.7.5	56,971.91	41,905.00
应收股利		-	-
应收申购款		51,226.88	33,005.62
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		703,987,555.43	215,902,425.01
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年11月25日(基 金合同失效前日)	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		170,700.28	1,058,143.13
应付管理人报酬		668,312.46	268,812.89
应付托管费		111,385.41	44,802.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	487,151.93	231,205.67
应交税费		3.34	0.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	162,324.07	180,488.89
负债合计		1,599,877.49	1,783,452.79
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	364,323,192.22	135,380,454.85
未分配利润	7.4.7.10	338,064,485.72	78,738,517.37
所有者权益合计		702,387,677.94	214,118,972.22
负债和所有者权益总计		703,987,555.43	215,902,425.01

注：本基金合同失效前日为 2021 年 11 月 25 日，本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至基金合同失效前日 2021 年 11 月 25 日止，报告截止日 2021 年 11 月 25 日，基金份额净值 1.928 元，基金份额总额 364,323,192.22 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年	2020 年 1 月 1 日至 2020 年

		11月25日	12月31日
一、收入		64,811,930.93	58,471,730.10
1. 利息收入		180,965.87	156,060.44
其中：存款利息收入	7.4.7.11	179,183.83	139,740.62
债券利息收入		1,782.04	16,319.82
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）		56,714,135.54	67,638,474.01
其中：股票投资收益	7.4.7.12	51,632,137.88	63,573,251.82
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	10,456.95	295,698.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	2,319,666.79	1,763,161.16
股利收益	7.4.7.16	2,751,873.92	2,006,362.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	7,545,789.08	-9,681,861.74
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	371,040.44	359,057.39
减：二、费用		8,332,084.21	6,015,866.24
1. 管理人报酬	-	4,508,082.76	3,034,991.38
2. 托管费	-	751,347.18	505,831.92
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,878,441.09	2,263,611.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		10,907.77	7,301.85
7. 其他费用	7.4.7.20	183,305.41	204,129.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		56,479,846.72	52,455,863.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		56,479,846.72	52,455,863.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 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）	135,380,454.85	78,738,517.37	214,118,972.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	56,479,846.72	56,479,846.72
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）	228,942,737.37	202,846,121.63	431,788,859.00
其中：1. 基金申购款	294,550,338.91	262,168,280.95	556,718,619.86
2. 基金赎回款	-65,607,601.54	-59,322,159.32	-124,929,760.86
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）	364,323,192.22	338,064,485.72	702,387,677.94
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	245,913,646.07	39,575,617.08	285,489,263.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,455,863.86	52,455,863.86
三、本期基金份额交易产生的基	-110,533,191.22	-13,292,963.57	-123,826,154.79

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中：1. 基金申 购款	98,768,674.00	52,214,252.85	150,982,926.85
2. 基金赎 回款	-209,301,865.22	-65,507,216.42	-274,809,081.64
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)	135,380,454.85	78,738,517.37	214,118,972.22

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

嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1388号《关于准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金注册的批复》核准,由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》于2015年12月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,262,565,521.03份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型

证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准，基金管理人嘉实基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为嘉实量化精选股票型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的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 2021 年 11 月 25 日(基金合同失效前日)的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日(基金合同失效前日)止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动

计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件,应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且 2) 交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金,由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。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认列。对于已开放转换业务的基金,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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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未实现损益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认列,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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动

额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证券金融公司”）出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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%。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自动转为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。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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）本基金的基金管理人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）本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市

公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	
	2021 年 11 月 25 日	
	上年度末	
	2020 年 12 月 31 日	
活期存款	55,359,265.15	21,609,641.08
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	55,359,265.15	21,609,641.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 11 月 25 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	625,685,873.36	632,935,814.67	7,249,941.31
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	864,257.70	372,257.70
	银行间市场	-	-
	合计	864,257.70	372,257.70
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	626,177,873.36	633,800,072.37	7,622,199.01
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	186,937,113.11	187,931,960.24	994,847.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,783,166.20	5,162.80
	银行间市场	-	-
	合计	1,783,166.20	5,162.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	188,715,116.51	189,715,126.44	1,000,009.93

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 11 月 25 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	24,859,760.00	-	-	
其中：股指期货投资	24,859,760.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	24,859,760.00	-	-	
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	12,509,200.00	-	-	
其中：股指期货投资	12,509,200.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	12,509,200.00	-	-	

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 11 月 25 日（基金合同失效前日），本基金买入 IC2112 持仓量为 18 手，对应合约市值 25,961,760.00 元，公允价值变动 1,102,000.00 元；公允价值变动总额合计 1,102,000.00 元，可抵消期货暂收款 1,102,000.00 元，股指期货投资净额为零（于 2020 年 12 月 31 日：买入 IC2101 持仓量为 10 手，对应合约市值 12,687,600.00 元，公允价值变动 178,400.00 元，公允价值变动总额合计 178,400.00 元，可抵消期货暂收款 178,400.00 元，股指期货投资净额为零）。

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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年11月25日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	35,376.52	2,147.25
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	20,573.84	1,191.66
应收债券利息	746.53	38,540.99
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
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	275.02	25.10
合计	56,971.91	41,905.00

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年11月25日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	487,151.93	231,205.67
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	487,151.93	231,205.67

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年11月25日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	77.72	488.89
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	162,246.35	180,000.00
合计	162,324.07	180,488.89

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年11月25日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	135,380,454.85	135,380,454.85
本期申购	294,550,338.91	294,550,338.91
本期赎回（以“-”号填列）	-65,607,601.54	-65,607,601.54
- 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	364,323,192.22	364,323,192.22

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,270,074.22	-7,531,556.85	78,738,517.37
本期利润	48,934,057.64	7,545,789.08	56,479,846.72
本期基金份额交易产生的变动数	203,897,963.97	-1,051,842.34	202,846,121.63
其中：基金申购款	257,663,197.10	4,505,083.85	262,168,280.95
基金赎回款	-53,765,233.13	-5,556,926.19	-59,322,159.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	339,102,095.83	-1,037,610.11	338,064,485.72

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年11月25日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
	活期存款利息收入	102,763.03
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	70,930.64	47,864.57
其他	5,490.16	3,114.37
合计	179,183.83	139,740.62

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年11月25日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月

	日	31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	51,632,137.88	63,573,251.82
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	51,632,137.88	63,573,251.82

7.4.7.12.2 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1月1日至2021年11月25 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
卖出股票成交总额	1,029,012,176.13	921,120,276.67
减：卖出股票成本总 额	977,380,038.25	857,547,024.85
买卖股票差价收入	51,632,137.88	63,573,251.82

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年11月25 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31 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	10,456.95	295,698.47
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	10,456.95	295,698.47

7.4.7.13.2 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1月1日至2021年11月25 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,945,022.51	1,737,240.85
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,895,003.40	1,441,200.00
减：应收利息总额	39,562.16	342.38
买卖债券差价收入	10,456.95	295,698.47

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 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1月1日至2021年11月25日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	2,319,666.79	1,763,161.16

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年11月25日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,751,873.92	2,006,362.56
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	2,751,873.92	2,006,362.56

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年11月25日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	6,622,189.08	-9,860,261.74
股票投资	6,255,094.18	-9,865,424.54
债券投资	367,094.90	5,162.80
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	923,600.00	178,400.00
权证投资	-	-
期货投资	923,600.00	178,400.00
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	7,545,789.08	-9,681,861.74

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年11月	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年
----	--------------------------	----------------------------

	25 日	12 月 31 日
基金赎回费收入	295,098.00	299,548.97
基金转出费收入	75,942.44	59,508.42
合计	371,040.44	359,057.39

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,878,441.09	2,263,611.33
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,878,441.09	2,263,611.33

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	54,081.02	60,000.00
信息披露费	108,165.33	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,059.06	6,129.76
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	183,305.41	204,129.76

7.4.7.21 分部报告

无。

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

自 2021 年 11 月 26 日起，本基金正式变更为嘉实量化精选股票型证券投资基金。原《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》失效，《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》生效。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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 2021年1月1日至2021年11 月25日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,508,082.76	3,034,991.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	654,810.15

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	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	751,347.18	505,831.92

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。

7.4.10.3 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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 11 月 25 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 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
中国工商银行股份有限公司_活期	55,359,265.15	102,763.03	21,609,641.08	88,761.68

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(2021年1月1日至2021年11月25日(基金合同失效前日)),本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2021年11月25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	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
001317	三羊马	2021年11月22日	2021年11月30日	新发未上市	16.00	16.00	300	4,800.00	4,800.00	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股锁定	4.57	19.75	444	2,029.08	8,769.00	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	26.28	328	2,755.20	8,619.84	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月30日	新股锁定	12.10	29.45	410	4,961.00	12,074.50	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	53.41	420	4,998.00	22,432.20	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年12月6日	新股锁定	14.72	31.12	191	2,811.52	5,943.92	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	17.61	928	4,584.32	16,342.08	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月15日	新股锁定	6.02	39.09	201	1,210.02	7,857.09	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	65.47	201	3,760.71	13,159.47	-
301007	德迈	2021	2021	新股锁	5.29	24.33	303	1,602.87	7,371.99	-

	仕	年 6 月 4 日	年 12 月 23 日	定						
301009	可靠 股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁 定	12.54	20.58	433	5,429.82	8,911.14	-
301010	晶雪 节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁 定	7.83	23.48	218	1,706.94	5,118.64	-
301011	华立 科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁 定	14.20	59.50	175	2,485.00	10,412.50	-
301012	扬电 科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁 定	8.05	67.37	170	1,368.50	11,452.90	-
301013	利和 兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁 定	8.72	28.49	471	4,107.12	13,418.79	-
301015	百洋 医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	7.64	28.36	462	3,529.68	13,102.32	-
301016	雷尔 伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁 定	13.75	27.54	275	3,781.25	7,573.50	-
301018	申菱 环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁 定	8.29	28.54	782	6,482.78	22,318.28	-
301021	英诺 激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁 定	9.46	44.74	290	2,743.40	12,974.60	-
301025	读客 文化	2021 年 7 月 6 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁 定	1.55	17.67	403	624.65	7,121.01	-
301026	浩通 科技	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股锁 定	18.03	67.60	203	3,660.09	13,722.80	-
301027	华蓝	2021	2022	新股锁	11.45	17.69	286	3,274.70	5,059.34	-

	集团	年 7 月 8 日	年 1 月 19 日	定						
301028	东亚机械	2021 年 7 月 12 日	2022 年 1 月 20 日	新股锁 定	5.31	15.29	724	3,844.44	11,069.96	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁 定	14.14	94.59	359	5,076.26	33,957.81	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁 定	6.10	38.26	242	1,476.20	9,258.92	-
301032	新柴股份	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新股锁 定	4.97	13.03	513	2,549.61	6,684.39	-
301033	迈普医学	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 26 日	新股锁 定	15.14	66.08	108	1,635.12	7,136.64	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新股锁 定	23.38	33.06	185	4,325.30	6,116.10	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁 定	14.82	26.13	193	2,860.26	5,043.09	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁 定	6.68	19.96	266	1,776.88	5,309.36	-
301039	中集车辆	2021 年 7 月 1 日	2022 年 1 月 10 日	新股锁 定	6.96	11.08	802	5,581.92	8,886.16	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁 定	13.57	46.71	241	3,270.37	11,257.11	-
301045	天禄科技	2021 年 8 月 6 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁 定	15.81	32.00	335	5,296.35	10,720.00	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁 定	8.34	55.26	290	2,418.60	16,025.40	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁 定	19.34	33.25	196	3,790.64	6,517.00	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁 定	60.64	261.38	177	10,733.28	46,264.26	-

301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	新股锁定	8.11	22.44	252	2,043.72	5,654.88	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	25.37	155	1,839.85	3,932.35	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定	3.93	8.82	572	2,247.96	5,045.04	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	3.55	9.39	1,386	4,920.30	13,014.54	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	24.78	587	2,447.79	14,545.86	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.85	153	2,662.20	5,638.05	-
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股锁定	5.24	22.23	344	1,802.56	7,647.12	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	13.98	24.38	144	2,013.12	3,510.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	48.66	539	2,786.63	26,227.74	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	38.57	181	1,350.26	6,981.17	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定	12.24	25.99	144	1,762.56	3,742.56	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定	5.77	13.76	756	4,362.12	10,402.56	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	33.27	140	1,668.80	4,657.80	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定	12.95	23.36	403	5,218.85	9,414.08	-

301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定	93.09	85.15	189	17,594.01	16,093.35	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定	19.11	72.25	220	4,204.20	15,895.00	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定	10.45	12.22	1,806	18,872.70	22,069.32	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定	36.50	30.48	433	15,804.50	13,197.84	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	36.31	41.55	247	8,968.57	10,262.85	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	51.47	238	13,823.04	12,249.86	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2021年11月26日	新发未上市	14.33	14.33	2,574	36,885.42	36,885.42	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定	14.33	14.33	286	4,098.38	4,098.38	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股锁定	10.07	21.99	1,214	12,224.98	26,695.86	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定	60.66	126.59	510	30,936.60	64,560.90	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股锁定	12.20	28.40	654	7,978.80	18,573.60	-
600905	三峡能源	2021年6月	2021年12	新股锁定	2.65	6.51	453,881	1,202,784.65	2,954,765.31	-

		2 日	月 10 日							
600935	华塑股份	2021 年 11 月 19 日	2021 年 11 月 26 日	新发未上市	3.94	3.94	4,811	18,955.34	18,955.34	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股锁定	4.53	4.18	363,703	1,647,574.59	1,520,278.54	-
688049	炬芯科技	2021 年 11 月 22 日	2021 年 11 月 29 日	新发未上市	42.98	42.98	3,260	140,114.80	140,114.80	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 10 日	新股锁定	21.96	95.68	1,728	37,946.88	165,335.04	-
688190	云路股份	2021 年 11 月 18 日	2021 年 11 月 26 日	新发未上市	46.63	46.63	3,026	141,102.38	141,102.38	-
688517	金冠电气	2021 年 6 月 10 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁定	7.71	15.17	2,892	22,297.32	43,871.64	-
688670	金迪克	2021 年 7 月 23 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	55.18	78.76	1,069	58,987.42	84,194.44	-
688728	格科微	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 18 日	新股锁定	14.38	33.45	6,794	97,697.72	227,259.30	-
688739	成大生物	2021 年 10 月 21 日	2022 年 4 月 28 日	新股锁定	110.00	73.45	2,100	231,000.00	154,245.00	-
688772	珠海冠宇	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 15 日	新股锁定	14.43	45.68	8,496	122,597.28	388,097.28	-

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。

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

本基金为股票型证券投资基金，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是以腾讯自选股大数据为基础构建量化投资策略，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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 2021年11月25日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	864,257.70	32,341.30
未评级	-	-
合计	864,257.70	32,341.30

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的

其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的

久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年11月25日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,359,265.15	-	-	-	55,359,265.15
结算备付金	10,978,908.64	-	-	-	10,978,908.64
存出保证金	106,464.08	-	-	3,634,646.40	3,741,110.48
交易性金融资产	-	14,810.90	849,446.80	632,935,814.67	633,800,072.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	56,971.91	56,971.91
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	51,226.88	51,226.88
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	66,444,637.87	14,810.90	849,446.80	636,678,659.86	703,987,555.43
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	170,700.28	170,700.28
应付管理人报酬	-	-	-	668,312.46	668,312.46
应付托管费	-	-	-	111,385.41	111,385.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	487,151.93	487,151.93
应付税费	-	-	-	3.34	3.34
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	162,324.07	162,324.07
负债总计	-	-	-	1,599,877.49	1,599,877.49
利率敏感度缺口	66,444,637.87	14,810.90	849,446.80	635,078,782.37	702,387,677.94
上年度末 2020年12月31日					
资产					
银行存款	21,609,641.08	-	-	-	21,609,641.08
结算备付金	2,297,623.92	-	-	-	2,297,623.92

存出保证金	55,652.69	-	-	1,776,264.00	1,831,916.69
交易性金融资产	1,750,824.90	-	32,341.30	187,931,960.24	189,715,126.44
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	373,206.26	373,206.26
应收利息	-	-	-	41,905.00	41,905.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	33,005.62	33,005.62
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	25,713,742.59	-	32,341.30	190,156,341.12	215,902,425.01
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,058,143.13	1,058,143.13
应付管理人报酬	-	-	-	268,812.89	268,812.89
应付托管费	-	-	-	44,802.17	44,802.17
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	231,205.67	231,205.67
应付税费	-	-	-	0.04	0.04
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	180,488.89	180,488.89
负债总计	-	-	-	1,783,452.79	1,783,452.79
利率敏感度缺口	25,713,742.59	-	32,341.30	188,372,888.33	214,118,972.22

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（2021年11月25日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	市场利率上升25个基点	-12,012.09	-610.65

	市场利率下降 25 个基点	12,215.62	619.19
--	---------------	-----------	--------

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

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（2021年11月25日）	上年度末（2020年12月31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%	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2021年11月25日		上年度末 2020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	632,935,814.67	90.11	187,931,960.24	87.77
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	632,935,814.67	90.11	187,931,960.24	87.77

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（2021年11月25日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	37,177,731.92	10,303,329.75
	业绩比较基准下降5%	-37,177,731.92	-10,303,329.75

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，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中属于第一层次的余额为 627,190,128.84 元，属于第二层次的余额为 6,609,943.53，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 186,827,983.19 元，第二层次 2,887,143.25 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告（转型后）

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	603,020,121.98	92.73
	其中：股票	603,020,121.98	92.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,842,223.80	0.59
	其中：债券	3,842,223.80	0.59
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	42,229,772.14	6.49
8	其他各项资产	1,228,539.16	0.19
9	合计	650,320,657.08	100.00

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

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	000039	中集集团	737,700	12,658,932.00	1.95
2	600728	佳都科技	1,455,800	12,126,814.00	1.87
3	000830	鲁西化工	787,400	12,015,724.00	1.85
4	600803	新奥股份	635,000	11,658,600.00	1.80
5	002396	星网锐捷	494,500	11,655,365.00	1.80
6	002092	中泰化学	1,212,400	11,566,296.00	1.78

7	002517	恺英网络	1,950,100	11,349,582.00	1.75
8	600116	三峡水利	973,100	11,346,346.00	1.75
9	300639	凯普生物	382,900	11,299,379.00	1.74
10	600884	杉杉股份	325,800	10,676,466.00	1.65
11	002839	张家港行	1,853,400	10,675,584.00	1.65
12	600248	陕西建工	2,205,500	10,586,400.00	1.63
13	600019	宝钢股份	1,474,600	10,558,136.00	1.63
14	002458	益生股份	857,900	9,702,849.00	1.50
15	000630	铜陵有色	2,720,200	9,466,296.00	1.46
16	600426	华鲁恒升	292,400	9,152,120.00	1.41
17	603225	新凤鸣	603,900	8,967,915.00	1.38
18	603456	九洲药业	156,900	8,827,194.00	1.36
19	300196	长海股份	495,000	8,677,350.00	1.34
20	300037	新宙邦	76,400	8,633,200.00	1.33
21	300618	寒锐钴业	102,700	8,234,486.00	1.27
22	601375	中原证券	1,675,100	8,224,741.00	1.27
23	300633	开立医疗	251,300	8,024,009.00	1.24
24	603486	科沃斯	52,000	7,849,400.00	1.21
25	300761	立华股份	206,400	7,803,984.00	1.20
26	603986	兆易创新	43,400	7,631,890.00	1.18
27	002183	怡亚通	1,111,100	7,355,482.00	1.13
28	600516	方大炭素	675,200	7,305,664.00	1.13
29	601689	拓普集团	133,109	7,054,777.00	1.09
30	002345	潮宏基	1,277,800	7,040,678.00	1.09
31	002961	瑞达期货	279,200	6,879,488.00	1.06
32	300122	智飞生物	54,615	6,805,029.00	1.05
33	600089	特变电工	320,000	6,774,400.00	1.05
34	000988	华工科技	237,300	6,611,178.00	1.02
35	601339	百隆东方	1,116,400	6,575,596.00	1.01
36	000519	中兵红箭	241,800	6,448,806.00	0.99
37	688368	晶丰明源	20,089	6,430,488.90	0.99
38	300708	聚灿光电	346,240	6,374,278.40	0.98
39	600438	通威股份	140,300	6,307,888.00	0.97
40	002129	中环股份	150,700	6,291,725.00	0.97
41	600399	抚顺特钢	253,700	6,284,149.00	0.97
42	300782	卓胜微	19,200	6,274,560.00	0.97
43	002013	中航机电	340,200	6,184,836.00	0.95
44	002461	珠江啤酒	679,000	6,178,900.00	0.95
45	603039	泛微网络	88,500	6,174,645.00	0.95
46	000733	振华科技	49,000	6,089,720.00	0.94
47	688508	芯朋微	50,400	5,839,344.00	0.90
48	601958	金钼股份	840,600	5,758,110.00	0.89

49	600941	中国移动	99,842	5,748,902.36	0.89
50	000063	中兴通讯	170,600	5,715,100.00	0.88
51	002410	广联达	89,100	5,700,618.00	0.88
52	603008	喜临门	141,100	5,507,133.00	0.85
53	601101	昊华能源	722,500	5,346,500.00	0.82
54	300223	北京君正	36,700	4,917,800.00	0.76
55	601615	明阳智能	184,800	4,823,280.00	0.74
56	000567	海德股份	263,200	4,698,120.00	0.72
57	600642	申能股份	635,100	4,680,687.00	0.72
58	600546	山煤国际	556,400	4,568,044.00	0.70
59	601928	凤凰传媒	559,500	4,526,355.00	0.70
60	600702	舍得酒业	19,600	4,455,080.00	0.69
61	300101	振芯科技	195,000	4,325,100.00	0.67
62	300059	东方财富	115,100	4,271,361.00	0.66
63	601155	新城控股	144,900	4,220,937.00	0.65
64	300750	宁德时代	7,100	4,174,800.00	0.64
65	002615	哈尔斯	709,100	3,956,778.00	0.61
66	688050	爱博医疗	18,200	3,826,186.00	0.59
67	688099	晶晨股份	29,092	3,787,778.40	0.58
68	601965	中国汽研	199,100	3,705,251.00	0.57
69	000011	深物业 A	310,900	3,625,094.00	0.56
70	000429	粤高速 A	472,300	3,495,020.00	0.54
71	000960	锡业股份	175,500	3,427,515.00	0.53
72	600905	三峡能源	453,881	3,408,646.31	0.53
73	600817	宇通重工	236,200	3,214,682.00	0.50
74	600782	新钢股份	601,700	3,176,976.00	0.49
75	002867	周大生	178,500	3,173,730.00	0.49
76	002765	蓝黛科技	363,200	3,050,880.00	0.47
77	002116	中国海诚	413,600	2,953,104.00	0.46
78	000933	神火股份	310,700	2,824,263.00	0.44
79	601555	东吴证券	309,200	2,739,512.00	0.42
80	600487	亨通光电	178,700	2,701,944.00	0.42
81	688033	天宜上佳	81,300	2,686,965.00	0.41
82	600010	宝钢股份	961,400	2,682,306.00	0.41
83	603290	斯达半导	7,000	2,667,000.00	0.41
84	600958	东方证券	180,000	2,653,200.00	0.41
85	000938	紫光股份	112,700	2,575,195.00	0.40
86	300775	三角防务	51,100	2,498,279.00	0.39
87	605006	山东玻纤	177,600	2,468,640.00	0.38
88	688617	惠泰医疗	8,800	2,464,000.00	0.38
89	300260	新莱应材	50,400	2,377,368.00	0.37
90	002539	云图控股	172,500	2,289,075.00	0.35

91	600662	外服控股	295,000	2,112,200.00	0.33
92	000998	隆平高科	85,000	1,977,100.00	0.31
93	600919	江苏银行	319,900	1,865,017.00	0.29
94	000608	阳光股份	600,100	1,830,305.00	0.28
95	600435	北方导航	170,700	1,823,076.00	0.28
96	600018	上港集团	323,600	1,773,328.00	0.27
97	688558	国盛智科	38,500	1,740,200.00	0.27
98	300781	因赛集团	67,900	1,614,662.00	0.25
99	603392	万泰生物	7,200	1,594,800.00	0.25
100	601728	中国电信	363,703	1,553,011.81	0.24
101	600141	兴发集团	40,000	1,515,200.00	0.23
102	603889	新澳股份	229,500	1,420,605.00	0.22
103	603222	济民医疗	74,800	1,376,320.00	0.21
104	600150	中国船舶	53,600	1,328,744.00	0.20
105	600765	中航重机	25,800	1,302,642.00	0.20
106	688131	皓元医药	4,900	1,218,532.00	0.19
107	688029	南微医学	5,500	1,169,685.00	0.18
108	000848	承德露露	106,200	1,152,270.00	0.18
109	688235	百济神州	7,927	1,145,530.77	0.18
110	002010	传化智联	128,500	1,117,950.00	0.17
111	300661	圣邦股份	3,500	1,081,500.00	0.17
112	603156	养元饮品	37,100	1,054,011.00	0.16
113	300725	药石科技	7,400	1,052,058.00	0.16
114	603659	璞泰来	6,300	1,011,843.00	0.16
115	002245	蔚蓝锂芯	36,000	990,360.00	0.15
116	000917	电广传媒	136,000	919,360.00	0.14
117	603113	金能科技	50,300	819,890.00	0.13
118	002674	兴业科技	70,800	795,084.00	0.12
119	600123	兰花科创	82,500	773,025.00	0.12
120	600584	长电科技	23,500	728,970.00	0.11
121	600428	中远海特	119,200	600,768.00	0.09
122	688032	禾迈股份	603	424,505.97	0.07
123	002156	通富微电	19,300	374,999.00	0.06
124	688772	珠海冠宇	8,496	332,108.64	0.05
125	000026	飞亚达	28,000	331,800.00	0.05
126	688037	芯源微	1,646	277,844.80	0.04
127	688262	国芯科技	6,208	260,611.84	0.04
128	688192	迪哲医药	5,857	202,417.92	0.03
129	688728	格科微	6,794	199,132.14	0.03
130	688087	英科再生	1,728	161,395.20	0.02
131	688739	成大生物	2,100	147,672.00	0.02
132	301081	严牌股份	4,024	80,824.30	0.01

133	688670	金迪克	1,069	79,223.59	0.01
134	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
135	301056	森赫股份	5,716	65,653.80	0.01
136	301155	海力风电	591	59,321.70	0.01
137	301063	海锅股份	1,524	59,268.03	0.01
138	301050	雷电微力	177	41,548.98	0.01
139	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.01
140	301029	怡合达	359	32,263.33	0.00
141	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
142	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
143	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
144	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
145	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
146	301166	优宁维	236	22,302.00	0.00
147	301189	奥尼电子	372	21,062.64	0.00
148	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
149	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
150	301090	华润材料	1,806	20,263.32	0.00
151	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
152	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
153	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
154	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
155	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
156	301096	百诚医药	211	16,569.83	0.00
157	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
158	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
159	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
160	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
161	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
162	301087	可孚医疗	189	14,239.26	0.00
163	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
164	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
165	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
166	301091	深城交	433	13,557.23	0.00
167	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
168	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
169	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
170	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
171	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
172	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
173	301093	华兰股份	238	11,864.30	0.00
174	301039	中集车辆	802	10,033.02	0.00

175	301028	东亚机械	724	9,774.00	0.00
176	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
177	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
178	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
179	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
180	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
181	301092	争光股份	247	8,773.44	0.00
182	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
183	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
184	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
185	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
186	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
187	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
188	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
189	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
190	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
191	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
192	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
193	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
194	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
195	301036	双乐股份	185	5,537.05	0.00
196	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
197	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
198	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
199	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
200	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
201	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
202	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
203	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
204	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
205	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
206	300212	易华录	29	1,025.15	0.00
207	300891	惠云钛业	43	688.43	0.00
208	300940	南极光	7	248.71	0.00
209	300033	同花顺	1	144.58	0.00
210	300300	海峡创新	4	19.00	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	600019	宝钢股份	11,596,287.40	1.79
2	601555	东吴证券	10,227,601.20	1.58
3	300633	开立医疗	10,011,231.00	1.54
4	000630	铜陵有色	9,868,135.00	1.52
5	600642	申能股份	9,542,856.30	1.47
6	002092	中泰化学	8,466,411.00	1.31
7	002461	珠江啤酒	6,268,571.00	0.97
8	688508	芯朋微	5,930,765.91	0.91
9	601101	昊华能源	5,875,904.92	0.91
10	600941	中国移动	5,748,902.36	0.89
11	000519	中兵红箭	5,685,045.00	0.88
12	603456	九洲药业	5,491,752.12	0.85
13	000733	振华科技	5,418,472.24	0.84
14	688029	南微医学	5,106,137.41	0.79
15	600435	北方导航	4,851,326.00	0.75
16	000567	海德股份	4,596,837.00	0.71
17	601155	新城控股	4,553,638.32	0.70
18	300101	振芯科技	4,303,047.00	0.66
19	603039	泛微网络	4,263,737.00	0.66
20	688050	爱博医疗	4,119,308.85	0.64

8.4.2 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	002266	浙富控股	8,692,122.00	1.34
2	601555	东吴证券	7,637,923.00	1.18
3	002023	海特高新	7,496,916.00	1.16
4	600642	申能股份	7,399,929.00	1.14
5	600808	马钢股份	7,143,957.00	1.10
6	000863	三湘印象	6,607,058.47	1.02
7	002064	华峰化学	6,601,261.00	1.02
8	600641	万业企业	6,595,880.00	1.02
9	600782	新钢股份	6,054,218.00	0.93
10	688029	南微医学	5,919,556.53	0.91
11	601678	滨化股份	5,546,311.78	0.86
12	603517	绝味食品	5,401,244.00	0.83
13	600388	龙净环保	5,250,566.00	0.81
14	603113	金能科技	5,228,273.00	0.81
15	002495	佳隆股份	5,220,932.00	0.81
16	600546	山煤国际	5,167,900.00	0.80
17	603222	济民医疗	4,949,405.00	0.76
18	603444	吉比特	4,861,726.00	0.75

19	601233	桐昆股份	4,841,328.00	0.75
20	002179	中航光电	4,282,498.00	0.66

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	236,436,624.60
卖出股票收入（成交）总额	277,623,078.50

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	3,399,892.50	0.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	442,331.30	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,842,223.80	0.59

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

注：报告期末，本基金仅持有上述 3 支债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2203	IC2203	4	5,844,640.00	86,120.00	-
公允价值变动总额合计(元)					86,120.00
股指期货投资本期收益(元)					1,524,740.97
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1,015,880.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 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

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

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	960,034.48

2	应收证券清算款	74,434.45
3	应收股利	-
4	应收利息	42,852.03
5	应收申购款	151,218.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,228,539.16

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。

§ 8 投资组合报告（转型前）

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	632,935,814.67	89.91
	其中：股票	632,935,814.67	89.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	864,257.70	0.12
	其中：债券	864,257.70	0.12
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	66,338,173.79	9.42
8	其他各项资产	3,849,309.27	0.55
9	合计	703,987,555.43	100.00

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	17,698,193.00	2.52
B	采矿业	9,302,103.00	1.32
C	制造业	425,533,108.14	60.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	24,095,461.31	3.43
E	建筑业	14,843,913.00	2.11
F	批发和零售业	11,910,658.88	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	4,219,100.00	0.60
H	住宿和餐饮业	3,742.56	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,795,602.91	7.23
J	金融业	24,771,028.64	3.53
K	房地产业	17,749,331.00	2.53
L	租赁和商务服务业	10,663,314.00	1.52
M	科学研究和技术服务业	4,601,230.48	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	8,355,051.00	1.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,451,175.86	0.21
R	文化、体育和娱乐业	3,901,300.89	0.56
S	综合	3,041,500.00	0.43
	合计	632,935,814.67	90.11

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	300618	寒锐钴业	139,400	13,452,100.00	1.92
2	000039	中集集团	761,900	12,761,825.00	1.82
3	300639	凯普生物	390,600	11,311,776.00	1.61
4	600884	杉杉股份	325,800	11,207,520.00	1.60
5	000830	鲁西化工	730,000	11,103,300.00	1.58
6	600728	佳都科技	1,405,100	11,044,086.00	1.57
7	002129	中环股份	233,500	10,488,820.00	1.49
8	600116	三峡水利	1,014,200	10,152,142.00	1.45
9	600803	新奥股份	502,000	10,034,980.00	1.43
10	601689	拓普集团	169,609	10,001,842.73	1.42
11	002396	星网锐捷	394,600	9,853,162.00	1.40
12	002517	恺英网络	1,864,800	9,529,128.00	1.36

13	300196	长海股份	495,000	9,296,100.00	1.32
14	600782	新钢股份	1,716,700	9,253,013.00	1.32
15	600248	陕西建工	2,045,600	9,021,096.00	1.28
16	002458	益生股份	828,500	9,005,795.00	1.28
17	600089	特变电工	387,400	8,987,680.00	1.28
18	600426	华鲁恒升	292,400	8,742,760.00	1.24
19	002839	张家港行	1,503,900	8,662,464.00	1.23
20	603486	科沃斯	52,000	8,598,720.00	1.22
21	603225	新风鸣	603,900	8,454,600.00	1.20
22	600516	方大炭素	675,200	8,446,752.00	1.20
23	002266	浙富控股	1,254,100	8,339,765.00	1.19
24	300037	新宙邦	63,800	7,707,040.00	1.10
25	300223	北京君正	52,100	7,700,901.00	1.10
26	300708	聚灿光电	346,240	7,520,332.80	1.07
27	600702	舍得酒业	33,800	7,467,096.00	1.06
28	000063	中兴通讯	230,400	7,409,664.00	1.05
29	300782	卓胜微	19,200	7,352,256.00	1.05
30	600546	山煤国际	890,300	7,238,139.00	1.03
31	002023	海特高新	556,800	7,232,832.00	1.03
32	000988	华工科技	237,300	7,211,547.00	1.03
33	300122	智飞生物	54,615	7,099,403.85	1.01
34	002183	怡亚通	1,165,200	7,096,068.00	1.01
35	688368	晶丰明源	20,089	7,039,788.27	1.00
36	600808	马钢股份	1,864,300	6,897,910.00	0.98
37	002961	瑞达期货	279,200	6,737,096.00	0.96
38	002345	潮宏基	1,277,800	6,427,334.00	0.92
39	002064	华峰化学	594,500	6,373,040.00	0.91
40	600438	通威股份	140,300	6,313,500.00	0.90
41	688099	晶晨股份	51,292	6,225,310.04	0.89
42	601958	金钼股份	840,600	6,203,628.00	0.88
43	603008	喜临门	210,000	6,123,600.00	0.87
44	002765	蓝黛科技	564,800	5,969,936.00	0.85
45	603222	济民医疗	423,400	5,885,260.00	0.84
46	002116	中国海诚	914,100	5,822,817.00	0.83
47	603986	兆易创新	36,800	5,752,944.00	0.82
48	002410	广联达	89,100	5,626,665.00	0.80
49	600388	龙净环保	630,800	5,532,116.00	0.79
50	300761	立华股份	182,300	5,394,257.00	0.77
51	603113	金能科技	352,200	5,374,572.00	0.77
52	601678	滨化股份	636,600	5,347,440.00	0.76
53	002013	中航机电	340,200	5,290,110.00	0.75
54	601375	中原证券	1,114,900	5,217,732.00	0.74

55	000933	神火股份	569,600	5,109,312.00	0.73
56	000863	三湘印象	1,797,200	5,104,048.00	0.73
57	002495	佳隆股份	2,064,600	5,058,270.00	0.72
58	603444	吉比特	13,000	4,940,000.00	0.70
59	603517	绝味食品	74,300	4,856,248.00	0.69
60	300750	宁德时代	7,100	4,643,400.00	0.66
61	601965	中国汽研	231,600	4,548,624.00	0.65
62	600399	抚顺特钢	189,100	4,421,158.00	0.63
63	601233	桐昆股份	218,000	4,401,420.00	0.63
64	600641	万业企业	110,200	4,164,458.00	0.59
65	002179	中航光电	43,100	4,137,600.00	0.59
66	601339	百隆东方	785,300	4,130,678.00	0.59
67	000960	锡业股份	208,700	4,019,562.00	0.57
68	601928	凤凰传媒	559,500	3,888,525.00	0.55
69	688033	天宜上佳	132,600	3,866,616.00	0.55
70	002532	天山铝业	456,000	3,803,040.00	0.54
71	603456	九洲药业	65,200	3,740,524.00	0.53
72	002092	中泰化学	371,000	3,698,870.00	0.53
73	000011	深物业 A	338,300	3,640,108.00	0.52
74	300496	中科创达	24,100	3,637,172.00	0.52
75	002674	兴业科技	313,700	3,497,755.00	0.50
76	000998	隆平高科	142,100	3,298,141.00	0.47
77	603290	斯达半导	7,000	3,275,370.00	0.47
78	000026	飞亚达	256,900	3,085,369.00	0.44
79	688029	南微医学	12,000	3,071,160.00	0.44
80	300463	迈克生物	100,800	3,066,336.00	0.44
81	000009	中国宝安	175,000	3,041,500.00	0.43
82	002709	天赐材料	23,100	3,037,419.00	0.43
83	000893	亚钾国际	166,300	3,003,378.00	0.43
84	600905	三峡能源	453,881	2,954,765.31	0.42
85	002390	信邦制药	398,000	2,885,500.00	0.41
86	300358	楚天科技	121,100	2,764,713.00	0.39
87	600010	包钢股份	961,400	2,730,376.00	0.39
88	600958	东方证券	180,000	2,642,400.00	0.38
89	000785	居然之家	531,000	2,639,070.00	0.38
90	601168	西部矿业	172,500	2,309,775.00	0.33
91	002254	泰和新材	102,200	2,206,498.00	0.31
92	002833	弘亚数控	66,500	2,128,000.00	0.30
93	603260	合盛硅业	13,800	2,109,744.00	0.30
94	000797	中国武夷	826,800	2,017,392.00	0.29
95	603129	春风动力	11,100	1,998,000.00	0.28
96	600779	水井坊	14,500	1,871,805.00	0.27

97	000959	首钢股份	321,000	1,848,960.00	0.26
98	603392	万泰生物	7,200	1,802,880.00	0.26
99	000608	阳光股份	600,100	1,752,292.00	0.25
100	600099	林海股份	232,800	1,734,360.00	0.25
101	300458	全志科技	23,200	1,731,184.00	0.25
102	000807	云铝股份	146,500	1,646,660.00	0.23
103	601615	明阳智能	53,200	1,634,836.00	0.23
104	600271	航天信息	132,500	1,616,500.00	0.23
105	002043	兔宝宝	175,400	1,604,910.00	0.23
106	300316	晶盛机电	23,700	1,583,634.00	0.23
107	300283	温州宏丰	195,100	1,572,506.00	0.22
108	000062	深圳华强	93,800	1,563,646.00	0.22
109	601636	旗滨集团	94,600	1,539,142.00	0.22
110	600141	兴发集团	40,000	1,525,200.00	0.22
111	601728	中国电信	363,703	1,520,278.54	0.22
112	300059	东方财富	43,200	1,507,680.00	0.21
113	300077	国民技术	51,800	1,490,804.00	0.21
114	000516	国际医学	128,500	1,436,630.00	0.20
115	603889	新澳股份	229,500	1,432,080.00	0.20
116	002497	雅化集团	48,200	1,407,440.00	0.20
117	300661	圣邦股份	3,500	1,256,500.00	0.18
118	600018	上港集团	248,700	1,218,630.00	0.17
119	603039	泛微网络	19,900	1,213,502.00	0.17
120	000429	粤高速 A	172,000	1,207,440.00	0.17
121	600765	中航重机	25,800	1,175,964.00	0.17
122	600869	远东股份	171,500	1,159,340.00	0.17
123	002648	卫星化学	28,600	1,119,690.00	0.16
124	000848	承德露露	106,200	1,084,302.00	0.15
125	000510	新金路	191,000	1,077,240.00	0.15
126	600885	宏发股份	14,600	1,073,246.00	0.15
127	600185	格力地产	155,900	1,071,033.00	0.15
128	002245	蔚蓝锂芯	36,000	1,064,880.00	0.15
129	000060	中金岭南	212,400	1,051,380.00	0.15
130	603659	璞泰来	6,300	1,045,863.00	0.15
131	600642	申能股份	154,300	953,574.00	0.14
132	600662	外服控股	128,400	945,024.00	0.13
133	603217	元利科技	22,800	938,904.00	0.13
134	002818	富森美	73,200	928,176.00	0.13
135	000885	城发环境	79,100	843,206.00	0.12
136	002156	通富微电	38,500	820,820.00	0.12
137	600584	长电科技	23,500	791,010.00	0.11
138	600123	兰花科创	82,500	788,700.00	0.11

139	000519	中兵红箭	24,100	710,709.00	0.10
140	600201	生物股份	41,100	661,710.00	0.09
141	688772	珠海冠宇	8,496	388,097.28	0.06
142	688107	安路科技	4,140	384,067.80	0.05
143	688728	格科微	6,794	227,259.30	0.03
144	688087	英科再生	1,728	165,335.04	0.02
145	688739	成大生物	2,100	154,245.00	0.02
146	688190	云路股份	3,026	141,102.38	0.02
147	688049	炬芯科技	3,260	140,114.80	0.02
148	688211	中科微至	1,350	109,417.50	0.02
149	301081	严牌股份	4,024	108,050.12	0.02
150	688670	金迪克	1,069	84,194.44	0.01
151	301155	海力风电	591	77,587.32	0.01
152	301063	海锅股份	1,524	71,555.73	0.01
153	301056	森赫股份	5,716	66,258.64	0.01
154	301050	雷电微力	177	46,264.26	0.01
155	688517	金冠电气	2,892	43,871.64	0.01
156	301133	金钟股份	2,860	40,983.80	0.01
157	301029	怡合达	359	33,957.81	0.00
158	603893	瑞芯微	200	30,588.00	0.00
159	301149	隆华新材	1,214	26,695.86	0.00
160	301069	凯盛新材	539	26,227.74	0.00
161	300994	久祺股份	420	22,432.20	0.00
162	301018	申菱环境	782	22,318.28	0.00
163	301090	华润材料	1,806	22,069.32	0.00
164	600935	华塑股份	4,811	18,955.34	0.00
165	300671	富满微	200	18,720.00	0.00
166	301180	万祥科技	654	18,573.60	0.00
167	603213	镇洋发展	799	17,873.63	0.00
168	300997	欢乐家	928	16,342.08	0.00
169	301087	可孚医疗	189	16,093.35	0.00
170	301046	能辉科技	290	16,025.40	0.00
171	301089	拓新药业	220	15,895.00	0.00
172	301060	兰卫医学	587	14,545.86	0.00
173	301026	浩通科技	203	13,722.80	0.00
174	301013	利和兴	471	13,418.79	0.00
175	301091	深城交	433	13,197.84	0.00
176	301002	崧盛股份	201	13,159.47	0.00
177	301015	百洋医药	462	13,102.32	0.00
178	301058	中粮工科	1,386	13,014.54	0.00
179	301021	英诺激光	290	12,974.60	0.00
180	301093	华兰股份	238	12,249.86	0.00

181	300993	玉马遮阳	410	12,074.50	0.00
182	300986	志特新材	200	11,840.00	0.00
183	301012	扬电科技	170	11,452.90	0.00
184	301040	中环海陆	241	11,257.11	0.00
185	301028	东亚机械	724	11,069.96	0.00
186	301045	天禄科技	335	10,720.00	0.00
187	301011	华立科技	175	10,412.50	0.00
188	301078	孩子王	756	10,402.56	0.00
189	301092	争光股份	247	10,262.85	0.00
190	603219	富佳股份	528	9,683.52	0.00
191	300991	创益通	254	9,367.52	0.00
192	301030	仕净科技	242	9,258.92	0.00
193	301009	可靠股份	433	8,911.14	0.00
194	301039	中集车辆	802	8,886.16	0.00
195	300774	倍杰特	444	8,769.00	0.00
196	300814	中富电路	328	8,619.84	0.00
197	300998	宁波方正	201	7,857.09	0.00
198	301066	万事利	344	7,647.12	0.00
199	301016	雷尔伟	275	7,573.50	0.00
200	301007	德迈仕	303	7,371.99	0.00
201	301033	迈普医学	108	7,136.64	0.00
202	301025	读客文化	403	7,121.01	0.00
203	301072	中捷精工	181	6,981.17	0.00
204	301032	新柴股份	513	6,684.39	0.00
205	300985	致远新能	168	6,518.40	0.00
206	301049	超越科技	196	6,517.00	0.00
207	301036	双乐股份	185	6,116.10	0.00
208	300995	奇德新材	191	5,943.92	0.00
209	301052	果麦文化	252	5,654.88	0.00
210	300992	泰福泵业	200	5,336.00	0.00
211	301038	深水规院	266	5,309.36	0.00
212	301010	晶雪节能	218	5,118.64	0.00
213	301027	华蓝集团	286	5,059.34	0.00
214	301037	保立佳	193	5,043.09	0.00
215	001317	三羊马	300	4,800.00	0.00
216	301079	邵阳液压	140	4,657.80	0.00
217	301053	远信工业	155	3,932.35	0.00
218	301073	君亭酒店	144	3,742.56	0.00
219	000001	平安银行	200	3,536.00	0.00
220	301068	大地海洋	144	3,510.72	0.00
221	300926	博俊科技	59	1,817.79	0.00
222	000801	四川九洲	200	1,594.00	0.00

223	000100	TCL 科技	200	1,262.00	0.00
224	300212	易华录	29	934.38	0.00
225	300891	惠云钛业	43	733.15	0.00
226	300940	南极光	7	291.20	0.00
227	300033	同花顺	1	120.64	0.00
228	300300	海峡创新	4	18.68	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	600782	新钢股份	16,084,306.00	7.51
2	000830	鲁西化工	14,030,328.99	6.55
3	002129	中环股份	13,475,780.06	6.29
4	603517	绝味食品	12,893,438.00	6.02
5	300223	北京君正	12,890,176.00	6.02
6	000039	中集集团	12,736,407.80	5.95
7	002179	中航光电	11,914,568.75	5.56
8	300639	凯普生物	11,355,861.92	5.30
9	600728	佳都科技	11,234,231.00	5.25
10	300618	寒锐钴业	11,125,169.65	5.20
11	600089	特变电工	10,963,055.26	5.12
12	600116	三峡水利	10,962,407.00	5.12
13	300037	新宙邦	10,725,458.74	5.01
14	600808	马钢股份	10,643,310.00	4.97
15	000998	隆平高科	10,599,969.07	4.95
16	300740	水羊股份	10,544,941.12	4.92
17	000100	TCL 科技	10,499,901.45	4.90
18	600426	华鲁恒升	10,294,732.40	4.81
19	603225	新凤鸣	10,149,863.00	4.74
20	300196	长海股份	9,788,981.33	4.57
21	002266	浙富控股	9,687,239.00	4.52
22	600884	杉杉股份	9,643,791.00	4.50
23	000933	神火股份	9,559,701.94	4.46
24	002390	信邦制药	9,488,070.00	4.43
25	002517	恺英网络	9,461,465.00	4.42
26	002396	星网锐捷	9,362,362.99	4.37
27	600684	珠江股份	9,361,055.15	4.37
28	002013	中航机电	9,158,884.58	4.28
29	002648	卫星化学	9,127,686.08	4.26
30	300408	三环集团	9,095,618.12	4.25

31	600483	福能股份	9,052,584.29	4.23
32	300122	智飞生物	8,954,469.00	4.18
33	000063	中兴通讯	8,834,087.00	4.13
34	002116	中国海诚	8,726,966.72	4.08
35	002839	张家港行	8,693,266.45	4.06
36	002375	亚厦股份	8,684,843.91	4.06
37	600248	陕西建工	8,592,104.00	4.01
38	000885	城发环境	8,568,883.24	4.00
39	002458	益生股份	8,521,655.00	3.98
40	002078	太阳纸业	8,514,226.74	3.98
41	002495	佳隆股份	8,040,730.00	3.76
42	601689	拓普集团	8,004,860.94	3.74
43	600702	舍得酒业	7,938,767.00	3.71
44	300685	艾德生物	7,895,739.43	3.69
45	300761	立华股份	7,852,938.54	3.67
46	600546	山煤国际	7,825,188.00	3.65
47	300224	正海磁材	7,716,602.00	3.60
48	002064	华峰化学	7,643,991.00	3.57
49	603520	司太立	7,611,894.52	3.55
50	002183	怡亚通	7,372,942.00	3.44
51	688016	心脉医疗	7,306,931.88	3.41
52	601319	中国人保	7,150,247.00	3.34
53	603103	横店影视	7,132,561.00	3.33
54	002023	海特高新	7,129,931.00	3.33
55	603486	科沃斯	7,113,467.00	3.32
56	600438	通威股份	7,100,890.00	3.32
57	300358	楚天科技	7,062,959.60	3.30
58	601678	滨化股份	7,056,627.59	3.30
59	002345	潮宏基	7,038,494.36	3.29
60	000988	华工科技	6,968,186.52	3.25
61	688368	晶丰明源	6,948,365.88	3.25
62	600516	方大炭素	6,919,850.00	3.23
63	002645	华宏科技	6,867,513.70	3.21
64	600435	北方导航	6,675,399.44	3.12
65	002961	瑞达期货	6,655,221.00	3.11
66	600039	四川路桥	6,597,725.00	3.08
67	002025	航天电器	6,565,188.00	3.07
68	603290	斯达半导	6,546,922.00	3.06
69	603869	新智认知	6,535,403.90	3.05
70	600373	中文传媒	6,527,706.00	3.05
71	603113	金能科技	6,450,643.62	3.01
72	600783	鲁信创投	6,442,283.00	3.01

73	300708	聚灿光电	6,374,116.60	2.98
74	600388	龙净环保	6,357,786.86	2.97
75	300458	全志科技	6,326,062.00	2.95
76	603222	济民医疗	6,293,278.00	2.94
77	002410	广联达	6,253,420.00	2.92
78	603008	喜临门	6,201,886.50	2.90
79	601958	金钼股份	6,076,282.00	2.84
80	600803	新奥股份	6,062,593.00	2.83
81	603986	兆易创新	6,051,851.44	2.83
82	002824	和胜股份	6,013,953.00	2.81
83	300280	紫天科技	5,992,100.00	2.80
84	600885	宏发股份	5,967,963.00	2.79
85	601318	中国平安	5,918,827.00	2.76
86	300496	中科创达	5,841,770.00	2.73
87	300782	卓胜微	5,836,116.08	2.73
88	600010	包钢股份	5,826,994.00	2.72
89	688099	晶晨股份	5,774,094.31	2.70
90	000863	三湘印象	5,750,843.75	2.69
91	600875	东方电气	5,736,671.00	2.68
92	688029	南微医学	5,682,480.29	2.65
93	300661	圣邦股份	5,551,808.00	2.59
94	000799	酒鬼酒	5,550,829.26	2.59
95	300671	富满微	5,517,986.18	2.58
96	600729	重庆百货	5,445,779.42	2.54
97	600350	山东高速	5,412,825.00	2.53
98	601375	中原证券	5,176,178.00	2.42
99	601339	百隆东方	5,166,694.00	2.41
100	600105	永鼎股份	5,163,744.00	2.41
101	000975	银泰黄金	5,109,977.40	2.39
102	603444	吉比特	5,089,538.00	2.38
103	601928	凤凰传媒	5,035,025.00	2.35
104	002092	中泰化学	4,991,839.36	2.33
105	601233	桐昆股份	4,943,327.18	2.31
106	002557	洽洽食品	4,927,394.84	2.30
107	002674	兴业科技	4,776,691.00	2.23
108	300521	爱司凯	4,687,077.00	2.19
109	601099	太平洋	4,614,087.00	2.15
110	600418	江淮汽车	4,541,567.00	2.12
111	300463	迈克生物	4,493,187.38	2.10
112	002541	鸿路钢构	4,451,941.94	2.08
113	600512	腾达建设	4,442,846.00	2.07
114	002709	天赐材料	4,417,176.00	2.06

115	002384	东山精密	4,392,441.00	2.05
116	002768	国恩股份	4,353,294.00	2.03
117	688388	嘉元科技	4,344,236.41	2.03
118	300750	宁德时代	4,330,076.00	2.02
119	603260	合盛硅业	4,314,367.00	2.01

8.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600483	福能股份	12,469,649.68	5.82
2	300740	水羊股份	11,687,884.81	5.46
3	002648	卫星化学	11,434,976.14	5.34
4	002390	信邦制药	11,063,173.90	5.17
5	000100	TCL 科技	10,490,013.00	4.90
6	002375	亚厦股份	10,314,083.59	4.82
7	002179	中航光电	10,165,144.00	4.75
8	600039	四川路桥	9,802,403.71	4.58
9	600684	珠江股份	9,460,703.91	4.42
10	002013	中航机电	9,311,591.27	4.35
11	000998	隆平高科	9,191,066.85	4.29
12	000885	城发环境	9,136,314.15	4.27
13	300224	正海磁材	9,085,048.00	4.24
14	002078	太阳纸业	9,018,907.82	4.21
15	600782	新钢股份	9,009,491.00	4.21
16	300408	三环集团	8,920,173.05	4.17
17	300661	圣邦股份	8,817,214.00	4.12
18	300685	艾德生物	8,601,192.00	4.02
19	002025	航天电器	8,252,599.00	3.85
20	000932	华菱钢铁	7,372,482.98	3.44
21	600435	北方导航	7,031,687.00	3.28
22	002645	华宏科技	7,027,278.23	3.28
23	603869	新智认知	6,998,676.10	3.27
24	600875	东方电气	6,971,488.00	3.26
25	601319	中国人保	6,735,432.00	3.15
26	600373	中文传媒	6,631,307.00	3.10
27	002541	鸿路钢构	6,589,552.50	3.08
28	603103	横店影视	6,521,670.31	3.05
29	002824	和胜股份	6,412,109.00	2.99
30	600563	法拉电子	6,358,191.00	2.97
31	600783	鲁信创投	6,322,016.00	2.95
32	002675	东诚药业	6,284,282.65	2.93
33	600886	国投电力	6,031,607.66	2.82

34	600409	三友化工	5,999,626.58	2.80
35	603517	绝味食品	5,905,009.00	2.76
36	600729	重庆百货	5,823,059.80	2.72
37	603520	司太立	5,750,275.14	2.69
38	600350	山东高速	5,743,472.00	2.68
39	000975	银泰黄金	5,743,121.13	2.68
40	300369	绿盟科技	5,643,274.00	2.64
41	000799	酒鬼酒	5,630,381.77	2.63
42	002768	国恩股份	5,617,854.00	2.62
43	688016	心脉医疗	5,605,224.42	2.62
44	600010	包钢股份	5,549,880.00	2.59
45	002557	洽洽食品	5,524,435.00	2.58
46	600105	永鼎股份	5,448,739.00	2.54
47	603882	金城医学	5,424,193.05	2.53
48	000725	京东方A	5,413,750.00	2.53
49	300223	北京君正	5,345,924.17	2.50
50	300496	中科创达	5,294,831.63	2.47
51	600512	腾达建设	5,239,316.00	2.45
52	300124	汇川技术	5,002,606.00	2.34
53	300280	紫天科技	4,872,920.00	2.28
54	603738	泰晶科技	4,814,022.00	2.25
55	601099	太平洋	4,813,578.00	2.25
56	600089	特变电工	4,669,825.37	2.18
57	601318	中国平安	4,644,447.00	2.17
58	688388	嘉元科技	4,642,104.49	2.17
59	600973	宝胜股份	4,639,754.20	2.17
60	000933	神火股份	4,620,751.00	2.16
61	300458	全志科技	4,588,475.70	2.14
62	300521	爱司凯	4,512,619.40	2.11
63	600885	宏发股份	4,510,932.00	2.11
64	000951	中国重汽	4,457,725.20	2.08
65	002049	紫光国微	4,450,246.50	2.08
66	600418	江淮汽车	4,405,320.00	2.06
67	600480	凌云股份	4,380,502.08	2.05
68	600536	中国软件	4,366,586.68	2.04
69	300358	楚天科技	4,365,060.00	2.04
70	600984	建设机械	4,335,992.34	2.03
71	002266	浙富控股	4,303,668.00	2.01

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	1,416,128,798.50
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,029,012,176.13
--------------	------------------

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	864,257.70	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	864,257.70	0.12

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

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 支债券。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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
IC2112	IC2112	18	25,961,760.00	1,102,000.00	-
公允价值变动总额合计(元)					1,102,000.00
股指期货投资本期收益(元)					2,319,666.79
股指期货投资本期公允价值变动(元)					923,600.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 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

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

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	3,741,110.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	56,971.91
5	应收申购款	51,226.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,849,309.27

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

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（转型后）

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
10,977	30,149.57	251,846,300.68	76.1	79,105,546.40	23.9

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	630,401.16	0.19

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	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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 品的情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的基金份额总量的数量区间(万份)
刘斌	公募基金	10~50
	私募资产管理计划	-
	合计	10~50

§ 9 基金份额持有人信息 (转型前)

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
11, 122	32, 756. 98	285, 222, 869. 01	78. 29	79, 100, 323. 21	21. 71

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	566, 567. 06	0. 16

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

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	持有本人管理的基金份额总量的数量区间(万份)
刘斌	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	-
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动 (转型后)

单位：份

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

注：本基金期初份额为转型日（2021 年 11 月 26 日）的基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动（转型前）

单位：份

基金合同生效日（2015 年 12 月 7 日） 基金份额总额	1,262,565,521.03
本报告期期初基金份额总额	135,380,454.85
本报告期基金总申购份额	294,550,338.91
减：本报告期基金总赎回份额	65,607,601.54
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	364,323,192.22

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本次基金份额持有人大会以通讯方式召开，权益登记日为 2021 年 10 月 26 日，基金份额持有人大会表决投票时间自 2021 年 10 月 26 日起，至 2021 年 11 月 24 日 17:00 止。本次基金份额持有人大会中，同意本次会议议案的基金份额占本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额的 92.94%，达到参加大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《基金合同》的有关规定，《关于嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更基金名称、基金的投资及其他相关事项的议案》有效通过，自 2021 年 11 月 25 日起生效。

2021 年 11 月 26 日，本基金管理人发布《关于嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。自 2021 年 11 月 26 日起，原《嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金合同》失效，《嘉实量化精选股票型证券投资基金基

金合同》生效，“嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金”正式变更为“嘉实量化精选股票型证券投资基金”，并相应调整投资目标、投资范围、投资策略等，基金当事人将按照《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。根据修订后的基金合同及托管协议，本基金管理人编制《嘉实量化精选股票型证券投资基金招募说明书》，修订后的法律文件已经中国证监会《关于准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2021]3249号）准予变更注册。

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

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》，杨亮霜先生任公司副总经理、首席信息官。

2021年7月23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》，龚康先生任公司副总经理。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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

转型前(2015年12月7日至2021年11月25日(基金合同终止日))：报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费54,081.02元，该审计机构已连续5年为本基金提供审计服务。

转型后(2021年11月26日(基金合同生效日)至2021年12月31日)：报告期内本基金聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金的审计机构。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费918.98元，该审计机构第1年提供审计服务。

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

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型后)

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	
中信证券股份有限公司	4	189,573,122.33	37.92%	132,701.17	39.16%	-
东方财富证券股份有限公司	2	161,521,549.67	32.31%	101,969.53	30.09%	-
广发证券股份有限公司	2	148,335,403.16	29.67%	103,837.88	30.65%	-
招商证券股份有限公司	2	454,081.84	0.09%	317.88	0.09%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 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	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
华宝证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-

天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	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. 报告期内，本基金新增以下交易单元：广发证券股份有限公司新增交易单元 1 个，海通证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中信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
中信证券股份有限公司	491,781.90	12.64%	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	3,399,552.00	87.36%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
国都证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国金证券 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	-	-	-	-	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华福证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
开源证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
民生证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
中国国际 金融股份 有限公司						
中国银河 证券股份 有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中泰证券 股份有限 公司						
中信建投 证券股份 有限公司						
中银国际 证券股份 有限公司						

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况(转型前)

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	
东方财富证 券股份有限 公司	2	821,392,694.72	33.81%	518,554.69	32.47%	-
东吴证券股 份有限公司	1	287,347,791.84	11.83%	181,404.71	11.36%	-
中信证券股 份有限公司	4	240,216,480.27	9.89%	168,151.59	10.53%	-
广发证券股 份有限公司	2	233,186,244.46	9.60%	163,231.93	10.22%	-

天风证券股 份有限公司	2	192,463,358.07	7.92%	121,497.31	7.61%	-
国盛证券有 限责任公司	2	179,316,197.63	7.38%	113,211.61	7.09%	-
华泰证券股 份有限公司	1	118,012,051.78	4.86%	82,608.45	5.17%	-
东方证券股 份有限公司	2	92,002,222.54	3.79%	62,295.29	3.90%	-
中泰证券股 份有限公司	1	89,876,003.12	3.70%	62,914.87	3.94%	-
海通证券股 份有限公司	3	87,757,134.84	3.61%	61,432.13	3.85%	-
中信建投证 券股份有限 公司	3	65,124,842.12	2.68%	45,587.39	2.85%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	22,879,346.50	0.94%	16,015.54	1.00%	-
安信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证 券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

国都证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
华福证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
开源证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
民生证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
浙商证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中国中金财	2	-	-	-	-	-

富证券有限 公司						
中银国际证 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. 报告期内，本基金退租以下交易单元：长城证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：华宝证券股份有限公司新增交易单元 2 个，开源证券股份有限公司新增交易单元 2 个，浙商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 1 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
东方财富证券股份有限公司	154,625.01	100.00%	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
国信证券 股份有限 公司						
华宝证券 股份有限 公司						
华福证券 有限责任 公司						
开源证券 股份有限 公司						
民生证券 股份有限 公司						
申万宏源 证券有限 公司						
兴业证券 股份有限 公司						
招商证券 股份有限 公司						
浙商证券 股份有限 公司						
中国国际 金融股份 有限公司						
中国银河 证券股份 有限公司						
中国中金 财富证券 有限公司						
中银国际 证券股份 有限公司						

11.8 其他重大事件（转型后）

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	关于嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 26 日
2	嘉实基金管理有限公司关于对中信银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 3 日
3	嘉实基金管理有限公司关于对中国邮政储蓄银行借记卡持卡人开通网上直销电子支付业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 3 日
4	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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 12 月 24 日

11.8 其他重大事件（转型前）

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闭跨 TA 转换业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 21 日
2	嘉实基金管理有限公司关于终止凤凰金信（银川）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 7 日
3	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 5 月 29 日
4	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 23 日
5	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 1 日
6	嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 18 日
7	嘉实基金管理有限公司关于继续在网 上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 28 日
8	关于以通讯方式召开嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 26 日
9	关于以通讯方式召开嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 27 日
10	关于以通讯方式召开嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金基金	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基	2021 年 10 月 28 日

	份额持有人大会的第二次提示性公告	金电子披露网站	
11	嘉实基金管理有限公司关于旗下部分公募基金参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 16 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	2021-07-15 至 2021-10-27, 2021-11-02 至 2021-12-31	-	111,034,439.73	4,210,100.00	106,824,339.73	32.28
	2	2021-01-01 至 2021-11-01	62,227,131.30	-	32,227,131.30	30,000,000.00	9.06
产品特有风险							

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。

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。

§ 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腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金注册的批复文件；
中国证监会准予嘉实腾讯自选股大数据策略股票型证券投资基金变更注册的批复；
- (2) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实量化精选股票型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；

(6) 报告期内嘉实量化精选股票型证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 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

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

2022 年 3 月 30 日