

# 嘉实匠心回报混合型证券投资基金 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。

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 03 月 30 日（基金合同生效日）起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>17</b>
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>49</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	49
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 .....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例 .....	56
8.13 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>57</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	58
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>58</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>59</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
11.4 基金投资策略的改变 .....	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>66</b>
12.1 备查文件目录 .....	66
12.2 存放地点 .....	66
12.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实匠心回报混合型证券投资基金	
基金简称	嘉实匠心回报混合	
基金主代码	011626	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 30 日	
基金管理人	嘉实基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,070,802,283.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉实匠心回报混合 A	嘉实匠心回报混合 C
下属分级基金的交易代码	011626	011627
报告期末下属分级基金的份额总额	1,016,765,430.46 份	54,036,853.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用自下而上的投资方法，以基本面分析为立足点，在科学严格管理风险的前提下，精选具有核心竞争力的优质公司进行投资，力争实现基金资产的中长期稳健增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人研究优势，在经济转型升级、以高质量发展为目标的大背景下，深入研究行业发展趋势及不同子行业景气度变化，积极挖掘国内国际双循环相互促进及发展过程中各类股票的投资机会，力争通过深入的基本面研究精选个股，以谋求超额收益。具体包括：资产配置策略、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	沪深 300 指数收益率×65%+恒生指数收益率×15%+中债综合财富指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，一旦投资将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	嘉实基金管理有限公司	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	<a href="http://www.jsfund.cn">http://www.jsfund.cn</a>
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层嘉实基金管理有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年3月30日(基金合同生效日)-2021年12月31日		
	嘉实匠心回报混合 A	嘉实匠心回报混合 C	
本期已实现收益	554,295.90	-342,772.26	
本期利润	-12,635,269.67	-1,038,836.44	
加权平均基金份额本期利润	-0.0110	-0.0157	
本期加权平均净值利润率	-1.10%	-1.58%	
本期基金份额净值增长率	-1.08%	-1.68%	
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末		
	期末可供分配利润	-10,963,272.24	-905,596.90
	期末可供分配	-0.0108	-0.0168

基金份额利润		
期末基金资产净值	1,005,802,158.22	53,131,256.56
期末基金份额净值	0.9892	0.9832
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-1.08%	-1.68%

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

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

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

（4）本基金合同生效日为 2021 年 03 月 30 日，本报告期自 2021 年 03 月 30 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实匠心回报混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.00%	0.72%	0.55%	0.61%	0.45%	0.11%
过去六个月	-2.43%	0.70%	-5.84%	0.80%	3.41%	-0.10%
自基金合同生效起至今	-1.08%	0.57%	-3.15%	0.78%	2.07%	-0.21%

嘉实匠心回报混合 C

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

过去三个月	0.79%	0.72%	0.55%	0.61%	0.24%	0.11%
过去六个月	-2.83%	0.70%	-5.84%	0.80%	3.01%	-0.10%
自基金合同生效起 至今	-1.68%	0.57%	-3.15%	0.78%	1.47%	-0.21%

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：

$$\text{Return}(t) = 65\% * (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 20\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1) + 15\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1)$$

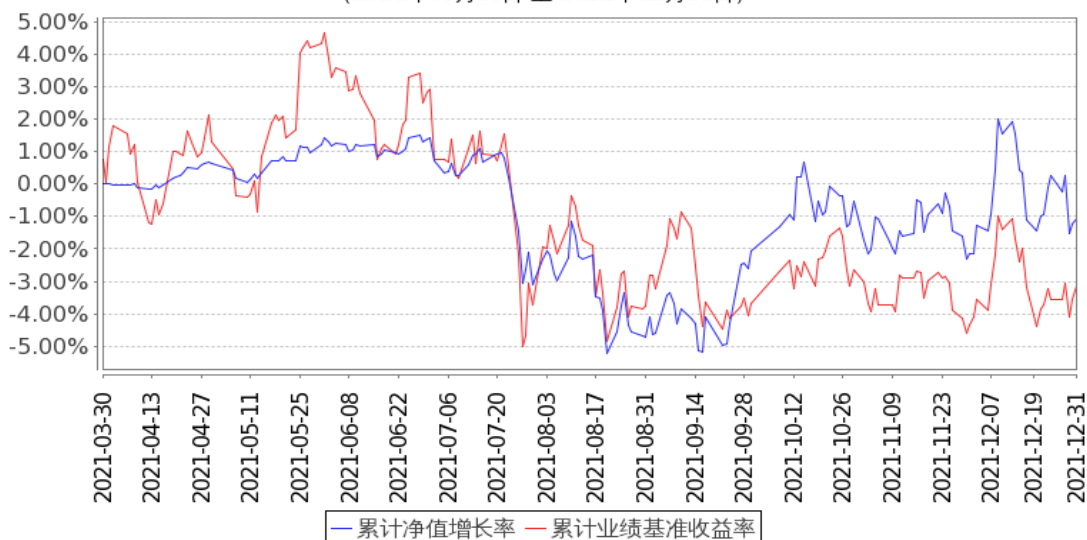
$$\text{Benchmark}(t) = (1 + \text{Return}(t)) \times (1 + \text{Benchmark}(t-1)) - 1$$

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

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

#### 嘉实匠心回报混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

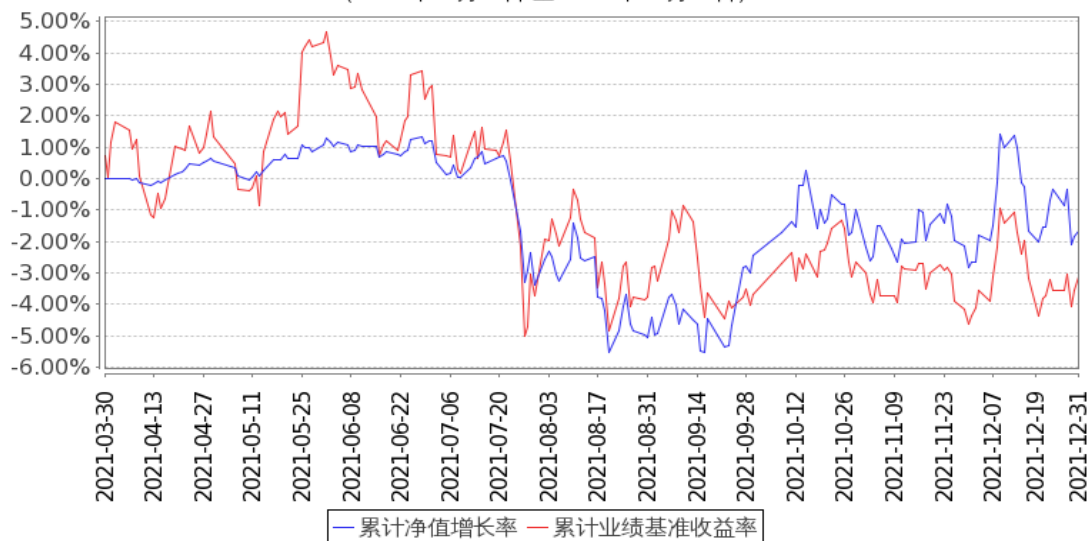
(2021年03月30日至2021年12月31日)





### 嘉实匠心回报混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021年03月30日至2021年12月31日)

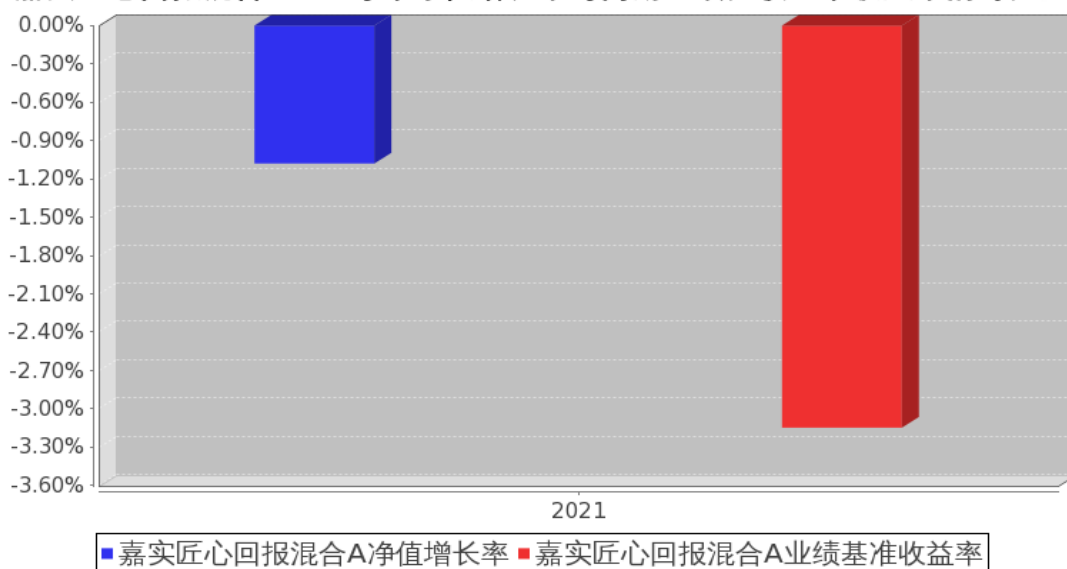


注：(1) 本基金合同生效日 2021 年 03 月 30 日至报告期末未满 1 年。

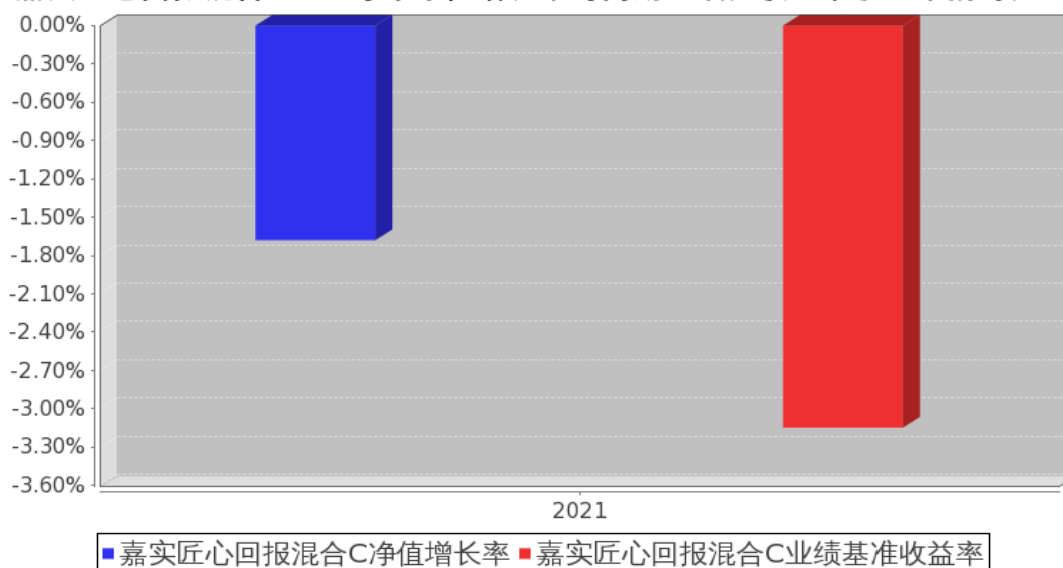
(2) 按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起 6 个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实匠心回报混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



嘉实匠心回报混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务等资格。

截止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

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
常蓁	本基金、	2021年3月	-	15年	曾任建信基金管理公司行业研究员。2010

	嘉实服务增值行业混合、嘉实回报混合、嘉实优化红利混合、嘉实回报精选股票、嘉实品质回报混合基金经理	月 30 日			年加入嘉实基金管理有限公司，先后担任行业研究员及基金经理，现任平衡风格投资总监。硕士研究生。具有基金从业资格。中国国籍。
--	--	--------	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实匠心回报混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。

### 4.3.3 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

回顾 2021 年，一方面，全球新冠疫情屡有反弹，德尔塔、奥密克戎新变种陆续出现，宏观环境处于较高不确定性状态。另一方面，在经历了疫情全球蔓延，低风险资产收益率快速下行的 2020 年后，全球市场优质资产整体估值自年初即处于较高位置。在这样的背景下，2021 年全年市场波动较 2020 年进一步加大，板块轮动迅速。年初市场交易经济复苏下信用收紧预期，核心资产泡沫演绎到极致后终于在春节后趋于瓦解。二季度以来地产、消费双双下行，市场交易衰退背景下的流动性宽松预期，随着全面降准落地、市场风格全面切换至成长股和中小市值风格，碳中和战略下，高端制造持续高景气，新能源主线贯穿全年。三季度以来运动式减碳带来大宗商品价格上涨，市场开始交易滞涨预期，强周期品种一度大幅占优。但四季度以来随着大宗商品政府保供稳价、同时地产端民企剧烈出清，市场又回到衰退主线，风格也重回成长。政策预期的摆动驱动市场风格的摆动，市场每个季度的占优主线都不尽相同。

从市场风格看，周期与成长、小盘股与高估值表现相对占优，与 2020 年以“茅指数”为代表的龙头行情大相径庭。2021 年市场风格分化极致，周期、成长大幅上涨，但消费与金融大幅下跌；同时，中小盘股、高估值风格涨幅也远高于大盘股、低市盈率风格。从行业看，周期行业与新能源领涨市场。在“双碳”政策利好、大宗商品价格上涨与通胀预期影响下，2021 年全年，采掘、

有色、钢铁、化工等行业涨幅居前，“碳中和”背景下景气向上的电新行业涨幅领先，而家用电器、食品饮料、农林牧渔、休闲服务、医药生物等消费行业跌幅较深，房地产调控压力下房地产跌幅较大。

2021 年整体公募基金收益率较 20 年下降较多，是近 3 年来的最低。在经历了 2 年的大涨后，板块间估值的高度分化，疫情的演变与外部宏观的不确定性共振，带来了板块间、同板块季度间迥异的表现。大幅波动的行情对基金投资选股提出了更高的要求，也为权益类基金在年内获得高收益率带来更大的挑战。本基金在一季度发行结束后逐步建仓，发行后赶上市场大幅调整，净值出现了一定的回撤，之后我们更加严格的筛选标的，没有追逐市场热点，去做投机和博弈，仍然选择长期有竞争优势、基本面有支持、业绩能够真正兑现的企业进行投资，在市场波动中逐渐加仓。我们相信，要坚持做长期正确的事情，才能经过时间的考验获得好的结果。我们也希望能够不忘初心，持续努力，为持有人创造长期稳定的复合回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末嘉实匠心回报混合 A 基金份额净值为 0.9892 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.08%；截至本报告期末嘉实匠心回报混合 C 基金份额净值为 0.9832 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.68%；业绩比较基准收益率为-3.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

展望 2022 年，国内经济增长压力增大，经济主线将重回稳增长阶段，而货币端利率中枢下移是长期逻辑，“易松难紧”是大的方向。中微观层面，虽然优质标的稀缺且估值仍然偏高，但经历去年下半年的下跌后已经趋向合理，高估值风险下降较多，优质标的投资性价比提升。在这样的情况下，2022 年仍将存在一定的结构性机会，且上下半年风格可能会有所不同。我们将坚持在防范高估值风险情况下，继续努力挖掘战略性投资机会。也希望大家能够把预期收益率放低，调整好心态面对市场的波动。

我们主要从长期角度，把握下面的几类机会：1) 长期发展逻辑较好，竞争壁垒较高的以高端白酒、家电、医疗服务为代表的消费类优质个股；2) 在国际上具有竞争优势的制造业龙头；3) 商业模式稳定、长期空间较大、竞争优势明显、估值有吸引力的，符合经济转型需要的科技创新型企业。并且阶段性关注两类机会：1) 由于疫情、政策等因素造成困境的行业或公司的底部反转；2) 高景气成长行业中估值相对合理的细分行业龙头。我们认为，以合理的价格买入优质公司并长

期持有是持续获得超额回报的有效途径，希望从最本质的规律出发，在不确定的未来中寻找更确定的机会，继续优化组合，力求赢得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人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遵规守信、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

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 60468756_A44 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	嘉实匠心回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了嘉实匠心回报混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

	我们认为，后附的嘉实匠心回报混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了嘉实匠心回报混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实匠心回报混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>嘉实匠心回报混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估嘉实匠心回报混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督嘉实匠心回报混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉</p>



	<p>及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对嘉实匠心回报混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致嘉实匠心回报混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   王海彦
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2022年3月25日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实匠心回报混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	39,155,754.72
结算备付金		5,313,808.49
存出保证金		121,609.77
交易性金融资产	7.4.7.2	867,095,783.37
其中：股票投资		814,993,901.97
基金投资		-
债券投资		52,101,881.40
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		148,459,111.97
应收利息	7.4.7.5	718,861.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		1,060,864,929.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
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		16.18
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,384,973.63
应付托管费		230,828.97
应付销售服务费		36,981.36
应付交易费用	7.4.7.7	79,878.89
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	198,835.62
负债合计		1,931,514.65
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	1,070,802,283.92
未分配利润	7.4.7.10	-11,868,869.14
所有者权益合计		1,058,933,414.78
负债和所有者权益总计		1,060,864,929.43

注：本基金合同生效日为 2021 年 03 月 30 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 03 月 30 日起至 2021 年 12 月 31 日止。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，嘉实匠心回报混合 A 基金份额净值 0.9892 元，基金份额总额 1,016,765,430.46 份，嘉实匠心回报混合 C 基金份额净值 0.9832 元，基金份额总额 54,036,853.46 份，基金份额总额合计为 1,070,802,283.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实匠心回报混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 30 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3月30日（基金合同 生效日）至2021年12月31 日
一、收入		3,858,681.04
1. 利息收入		10,195,212.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,928,887.65
债券利息收入		1,176,302.14
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		3,090,022.99
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		7,255,098.81
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,828,254.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-203,959.93
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	-
股利收益	7.4.7.16	1,630,804.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-13,885,629.75
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	293,999.20
减：二、费用		17,532,787.15
1. 管理人报酬	-	13,728,489.84
2. 托管费	-	2,288,081.69
3. 销售服务费	-	396,919.57
4. 交易费用	7.4.7.19	913,988.05
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.20	205,308.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-13,674,106.11
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-13,674,106.11

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实匠心回报混合型证券投资基金

本报告期：2021年3月30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3月30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）	1,303,838,917.71	-	1,303,838,917.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,674,106.11	-13,674,106.11
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）	-233,036,633.79	1,805,236.97	-231,231,396.82
其中：1. 基金申购款	21,077,249.83	-275,381.03	20,801,868.80
2. 基金赎回款	-254,113,883.62	2,080,618.00	-252,033,265.62
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）	1,070,802,283.92	-11,868,869.14	1,058,933,414.78

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

梁凯

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

嘉实匠心回报混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]323号《关于准予嘉实匠心回报混合型证券投资基金注册的批复》注册，由嘉实基金管理有限公司于2021年3月15日至2021年3月26日向社会公开募集，基金合同于2021年3月30日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金首次设立募集规模为1,303,838,917.71份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为嘉实基金管

理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

## (2) 金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

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

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

#### (2) 债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直

线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### (3) 权证投资

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

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

### (4) 分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (5) 回购协议

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

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应

采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按



协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额，扣除适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额入账；

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

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现

金分红；

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

(4) 由于基金费用的不同，不同类别的基金份额在收益分配数额方面可能有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则和支付方式进行调整，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前按照《信息披露办法》的要求在规定媒介公告。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

于估值日，外币货币性项目采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接进入当期损益。以公允价值计量的外币非货币性项目，采用公允价值确定日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额，作为公允价值变动的一部分直接计入当期损益。

#### 7.4.4.13 分部报告

无。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

#### 7.4.6.1 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按

证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

#### 7.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

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

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

#### 7.4.6.3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 7.4.6.5 境外投资

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

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	39,155,754.72
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	39,155,754.72

## 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	828,912,116.62	814,993,901.97	-13,918,214.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	52,069,296.50	52,101,881.40
	银行间市场	-	-
	合计	52,069,296.50	52,101,881.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	880,981,413.12	867,095,783.37	-13,885,629.75

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

## 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 7.4.7.5 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	13,023.91
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	2,391.00
应收债券利息	766,897.54
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-63,506.14
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	54.80
合计	718,861.11

## 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	79,878.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	79,878.89

## 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	198,835.62
合计	198,835.62

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 嘉实匠心回报混合 A

项目	本期 2021年3月30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	1,226,807,047.30	1,226,807,047.30
本期申购	14,124,816.86	14,124,816.86
本期赎回（以“-”号填列）	-224,166,433.70	-224,166,433.70
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,016,765,430.46	1,016,765,430.46

## 嘉实匠心回报混合 C

项目	本期 2021年3月30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	77,031,870.41	77,031,870.41
本期申购	6,952,432.97	6,952,432.97
本期赎回（以“-”号填列）	-29,947,449.92	-29,947,449.92
-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	54,036,853.46	54,036,853.46

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 03 月 30 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,303,838,917.71 份基金份额，其中认购资金利息折合 407,116.26 份基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

嘉实匠心回报混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	554,295.90	-13,189,565.57	-12,635,269.67
本期基金份额交易产生的变动数	-215,851.79	1,887,849.22	1,671,997.43
其中：基金申购款	24,614.19	-199,209.55	-174,595.36
基金赎回款	-240,465.98	2,087,058.77	1,846,592.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	338,444.11	-11,301,716.35	-10,963,272.24

嘉实匠心回报混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-342,772.26	-696,064.18	-1,038,836.44
本期基金份额交易产生的变动数	37,328.49	95,911.05	133,239.54
其中：基金申购款	-13,562.90	-87,222.77	-100,785.67
基金赎回款	50,891.39	183,133.82	234,025.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-305,443.77	-600,153.13	-905,596.90

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	531,872.64
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	5,395,734.66
其他	1,280.35
合计	5,928,887.65

#### 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3月30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	5,828,254.37
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	5,828,254.37

##### 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3月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	60,764,991.98
减：卖出股票成本总额	54,936,737.61
买卖股票差价收入	5,828,254.37

##### 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3月30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	-203,959.93
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	-203,959.93
----	-------------

#### 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3月30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	40,019,943.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	39,105,959.93
减：应收利息总额	1,117,943.40
买卖债券差价收入	-203,959.93

#### 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

无。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30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	1,630,804.37
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,630,804.37

## 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3月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-13,885,629.75
股票投资	-13,918,214.65
债券投资	32,584.90
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-13,885,629.75

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	250,475.75
基金转出费收入	43,523.45
合计	293,999.20

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年3月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	913,988.05
银行间市场交易费用	-

合计	913,988.05
----	------------

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 3 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	85,000.00
信息披露费	113,835.62
证券出借违约金	-
银行划款手续费	6,072.38
其他	400.00
合计	205,308.00

#### 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3月30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	13,728,489.84
其中：支付销售机构的客户维护费	5,862,712.90

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3月30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	2,288,081.69

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年3月30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销售服务费		
	嘉实匠心回报混合 A	嘉实匠心回报混合 C	合计
嘉实基金管理有限公司	-	119,844.18	119,844.18
中国工商银行	-	88,038.89	88,038.89

嘉实财富	-	468.55	468.55
合计	-	208,351.62	208,351.62

注：(1) 本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付给嘉实基金管理有限公司，再由嘉实基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：C 类基金份额日销售服务费=C 类基金份额前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。(2) 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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3月30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	39,155,754.72

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本期(2021年3月30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	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

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	-
301035	润丰股份	2021年 7月21 日	2022年 1月28 日	新股锁 定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
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	205	4,792.90	6,135.65	-
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1 日	2022年 1月10 日	新股锁 定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
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	233	14,129.12	54,694.42	-
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	-

		日	日								
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 精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股锁 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-	
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	476	44,310.84	35,861.84	-	
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	2021年	2022年	新股锁	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-	



	材料	10月19日	4月26日	定							
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44		-
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	323	11,728.13	11,472.96		-
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	409	23,754.72	20,388.65		-
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	272	21,651.20	21,360.16		-
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	925	56,110.50	89,493.75		-

301166	优宁维	2021年 12月21 日	2022年 6月28 日	新股锁 定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
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	435	28,788.30	24,629.70	-
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	-
688032	禾迈股份	2021年 12月13 日	2022年 6月20 日	新股锁 定	557.80	650.66	965	538,277.00	627,886.90	-
688162	巨一科技	2021年 11月3 日	2022年 5月10 日	新股锁 定	46.00	82.55	5,671	260,866.00	468,141.05	-
688236	春立医疗	2021年 12月23 日	2022年 6月30 日	新股锁 定	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
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	7,129	299,275.42	299,275.42	-

		日	日							
688711	宏微科技	2021年 8月25 日	2022年 3月1 日	新股锁 定	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-

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

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

本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融

工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

##### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

##### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产

的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的公允价值和未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	39,155,754.72	-	-	-	39,155,754.72
结算备付金	5,313,808.49	-	-	-	5,313,808.49
存出保证金	121,609.77	-	-	-	121,609.77
交易性金融资产	52,101,881.40	-	-	-814,993,901.97	867,095,783.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-148,459,111.97	148,459,111.97
应收利息	-	-	718,861.11	718,861.11
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	96,693,054.38	-	-964,171,875.05	1,060,864,929.43
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	-	-	16.18	16.18
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	1,384,973.63	1,384,973.63
应付托管费	-	-	230,828.97	230,828.97
应付销售服务费	-	-	36,981.36	36,981.36
应付交易费用	-	-	79,878.89	79,878.89
应付税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	198,835.62	198,835.62
负债总计	-	-	-1,931,514.65	1,931,514.65
利率敏感度缺口	96,693,054.38	-	-962,240,360.40	1,058,933,414.78

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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	-47,882.47
	市场利率下降25个基点	48,039.37

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

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

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
交易性金融资产	-	75,604,780.16	-	75,604,780.16
资产合计	-	75,604,780.16	-	75,604,780.16
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净 额	-	75,604,780.16	-	75,604,780.16

#### 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%	3,780,239.01
	所有外币相对人民币贬值 5%	-3,780,239.01

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	814,993,901.97	76.96
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	814,993,901.97	76.96

## 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%	28,034,518.24
	业绩比较基准下降 5%	-28,034,518.24

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## 7.4.14.1 公允价值

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

## (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 812,148,753.44 元，属于第二层次的余额为人民币 54,947,029.93 元，无属于第三层次的余额。

## (2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政



策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生转换。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

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。

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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	814,993,901.97	76.82
	其中:股票	814,993,901.97	76.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	52,101,881.40	4.91
	其中:债券	52,101,881.40	4.91
	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	44,469,563.21	4.19
8	其他各项资产	149,299,582.85	14.07
9	合计	1,060,864,929.43	100.00

注:通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 75,604,780.16 元,占基金资产净值的比例为 7.14%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	535,042,799.13	50.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	45,816.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	29,200,472.17	2.76
J	金融业	48,486,421.10	4.58
K	房地产业	52,307,358.00	4.94
L	租赁和商务服务业	28,194,185.00	2.66
M	科学研究和技术服务业	18,064,279.76	1.71
N	水利、环境和公共设施管理业	44,659.04	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,947,399.62	2.64
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	739,389,121.81	69.82

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
通信服务	25,209,878.40	2.38
非必需消费品	26,933,951.52	2.54
必需消费品	2,610,188.00	0.25
能源	-	-
金融	20,850,762.24	1.97
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
原材料	-	-
房地产	-	-
公用事业	-	-
合计	75,604,780.16	7.14

### 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	600519	贵州茅台	36,700	75,235,000.00	7.10
2	600048	保利发展	3,346,600	52,307,358.00	4.94
3	000858	五粮液	227,813	50,724,842.58	4.79
4	600036	招商银行	995,410	48,486,421.10	4.58
5	002415	海康威视	897,600	46,962,432.00	4.43
6	002311	海大集团	552,000	40,461,600.00	3.82
7	300760	迈瑞医疗	101,500	38,651,200.00	3.65
8	601799	星宇股份	173,664	35,470,872.00	3.35
9	603369	今世缘	548,020	29,812,288.00	2.82
10	300628	亿联网络	355,779	28,978,199.55	2.74
11	002410	广联达	451,100	28,861,378.00	2.73
12	300750	宁德时代	48,200	28,341,600.00	2.68
13	601888	中国中免	128,500	28,194,185.00	2.66
14	600809	山西汾酒	88,820	28,047,579.60	2.65
15	300015	爱尔眼科	660,578	27,929,237.84	2.64
16	000661	长春高新	101,600	27,574,240.00	2.60
17	300122	智飞生物	209,887	26,151,920.20	2.47
18	700 HK	腾讯控股	67,500	25,209,878.40	2.38
19	603179	新泉股份	567,000	24,539,760.00	2.32
20	3690 HK	美团-W	128,000	23,588,741.12	2.23
21	388 HK	香港交易所	56,000	20,850,762.24	1.97
22	603833	欧派家居	113,300	16,711,750.00	1.58
23	603259	药明康德	130,100	15,427,258.00	1.46
24	002847	盐津铺子	154,300	13,208,080.00	1.25
25	001215	千味央厨	181,736	10,578,852.56	1.00
26	000651	格力电器	246,900	9,142,707.00	0.86
27	2020 HK	安踏体育	35,000	3,345,210.40	0.32
28	291 HK	华润啤酒	50,000	2,610,188.00	0.25
29	688105	诺唯赞	23,330	2,472,980.00	0.23
30	688798	艾为电子	3,135	677,160.00	0.06
31	688032	禾迈股份	965	627,886.90	0.06
32	688162	巨一科技	5,671	468,141.05	0.04
33	688167	炬光科技	2,014	441,066.00	0.04
34	301029	怡合达	4,617	424,278.54	0.04
35	688182	灿勤科技	16,056	387,431.28	0.04
36	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.03
37	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.02
38	688257	新锐股份	2,899	191,913.80	0.02
39	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.01
40	301155	海力风电	925	89,493.75	0.01
41	688511	天微电子	1,490	82,531.10	0.01
42	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01

43	301063	海锅股份	1,524	59,268.03	0.01
44	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
45	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
46	301087	可孚医疗	476	35,861.84	0.00
47	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
48	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
49	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
50	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
51	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
52	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
53	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
54	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
55	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
56	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
57	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
58	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
59	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
60	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
61	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
62	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
63	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
64	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
65	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
66	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
67	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
68	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
69	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
70	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
71	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
72	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
73	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
74	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
75	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
76	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
77	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
78	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
79	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
80	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
81	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
82	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
83	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
84	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00

85	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
86	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
87	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
88	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
89	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
90	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
91	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
92	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
93	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
94	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
95	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
96	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
97	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
98	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
99	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
100	301027	华蓝集团	356	5,956.80	0.00
101	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
102	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
103	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
104	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
105	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
106	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
107	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
108	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
109	301013	利和兴	71	1,824.70	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	600519	贵州茅台	69,768,419.93	6.59
2	000858	五粮液	57,495,432.61	5.43
3	002415	海康威视	49,474,133.39	4.67
4	600036	招商银行	48,877,872.11	4.62
5	600048	保利发展	47,129,731.00	4.45
6	300122	智飞生物	45,588,816.53	4.31
7	300760	迈瑞医疗	39,468,161.72	3.73
8	000661	长春高新	38,811,683.00	3.67
9	002311	海大集团	38,230,574.91	3.61
10	601799	星宇股份	35,253,857.57	3.33
11	601888	中国中免	33,892,012.00	3.20
12	700 HK	腾讯控股	33,660,344.79	3.18

13	300015	爱尔眼科	29,990,270.07	2.83
14	002410	广联达	29,633,375.95	2.80
15	300628	亿联网络	27,889,856.90	2.63
16	3690 HK	美团-W	27,585,552.16	2.61
17	600809	山西汾酒	27,045,375.05	2.55
18	603369	今世缘	25,532,807.42	2.41
19	300750	宁德时代	21,942,446.75	2.07
20	388 HK	香港交易所	21,729,576.17	2.05

#### 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	300122	智飞生物	13,331,073.00	1.26
2	688169	石头科技	7,497,669.56	0.71
3	002304	洋河股份	5,335,375.00	0.50
4	002607	中公教育	5,333,588.00	0.50
5	601799	星宇股份	2,893,169.00	0.27
6	688235	百济神州	2,031,100.75	0.19
7	301155	海力风电	1,296,266.00	0.12
8	688187	时代电气	919,253.15	0.09
9	688779	长远锂科	899,085.41	0.08
10	688232	新点软件	870,790.88	0.08
11	688728	格科微	778,948.70	0.07
12	688107	安路科技	623,203.25	0.06
13	688110	东芯股份	603,682.52	0.06
14	301050	雷电微力	568,208.00	0.05
15	688151	华强科技	502,481.10	0.05
16	688385	复旦微电	494,358.18	0.05
17	688772	珠海冠宇	459,800.95	0.04
18	688739	成大生物	434,171.65	0.04
19	688707	振华新材	386,175.00	0.04
20	301087	可孚医疗	374,358.88	0.04

#### 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	883,848,854.23
卖出股票收入（成交）总额	60,764,991.98

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	52,101,881.40	4.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	52,101,881.40	4.92

### 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	019649	21 国债 01	260,870	26,092,217.40	2.46
2	019664	21 国债 16	130,000	13,005,200.00	1.23
3	019658	21 国债 10	130,240	13,004,464.00	1.23

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

无。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 8.11.2 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 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

### 8.13 投资组合报告附注

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

(1) 2021 年 5 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2021）16 号），对招商银行股份有限公司为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违法违规事实，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，于 2021 年 5 月 17 日作出行政处罚决定，罚款 7170 万元。

本基金投资于“招商银行（600036）”的决策程序说明：基于对招商银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“招商银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

(2) 报告期内本基金投资的前十名证券中，其他九名证券发行主体无被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

#### 8.13.2 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。

#### 8.13.3 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	121,609.77
2	应收证券清算款	148,459,111.97
3	应收股利	-
4	应收利息	718,861.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	149,299,582.85

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。



## 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
嘉实匠心回报混合 A	10,277	98,936.02	10,499,213.65	1.03	1,006,266,216.81	98.97
嘉实匠心回报混合 C	3,234	16,708.98	1,000,585.00	1.85	53,036,268.46	98.15
合计	13,336	80,294.11	11,499,798.65	1.07	1,059,302,485.27	98.93

注：(1) 嘉实匠心回报混合 A: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实匠心回报混合 A 份额占嘉实匠心回报混合 A 总份额比例、个人投资者持有嘉实匠心回报混合 A 份额占嘉实匠心回报混合 A 总份额比例；

(2) 嘉实匠心回报混合 C: 机构投资者持有份额占总份额比例、个人投资者持有份额占总份额比例，分别为机构投资者持有嘉实匠心回报混合 C 份额占嘉实匠心回报混合 C 总份额比例、个人投资者持有嘉实匠心回报混合 C 份额占嘉实匠心回报混合 C 总份额比例。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
----	------	-----------	-------------

基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉实匠心回报混合 A	198,626.68	0.02
	嘉实匠心回报混合 C	31,529.00	0.06
	合计	230,155.68	0.02

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	嘉实匠心回报混合 A	10~50
	嘉实匠心回报混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	嘉实匠心回报混合 A	0
	嘉实匠心回报混合 C	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	嘉实匠心回报混合 A	嘉实匠心回报混合 C
基金合同生效日 (2021年3月30日) 基金份额总额	1,226,807,047.30	77,031,870.41
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	14,124,816.86	6,952,432.97
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	224,166,433.70	29,947,449.92
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	1,016,765,430.46	54,036,853.46

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### (1) 基金管理人的重大人事变动情况

2021 年 5 月 29 日, 本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》, 杨竞霜先生任公司副总经理、首席信息官。

2021 年 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

本基金基金合同生效日为 2021 年 3 月 30 日。报告年度应支付安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 85,000.00 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

#### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	
国盛证券有限责任公司	2	387,871,642.49	41.89%	247,124.86	40.07%	-
国信证券股份有限公司	2	145,201,048.79	15.68%	101,641.03	16.48%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	114,791,407.61	12.40%	80,353.99	13.03%	-
长江证券股份有限公司	3	113,243,577.40	12.23%	79,271.04	12.85%	-
东方财富证券股份有限公司	2	89,323,961.96	9.65%	56,389.72	9.14%	-
中国国际金融股份有限公司	2	38,630,133.26	4.17%	27,041.08	4.38%	-
申万宏源证券有限公司	1	16,745,401.44	1.81%	11,721.78	1.90%	-
开源证券股份有限公司	2	13,132,761.55	1.42%	8,290.35	1.34%	-
光大证券股份有限公司	1	4,053,425.99	0.44%	2,837.40	0.46%	-
中信建投证券股份有限公司	3	2,995,026.02	0.32%	2,096.52	0.34%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证	2	-	-	-	-	-

券有限责任公司						
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	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股	2	-	-	-	-	-

份有限公司						
浙商证券股 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	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
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。

## 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

国盛证券 有限责任 公司	12,999,254.40	14.26%	2,644,600,000.00	9.05%	-	-
国信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	13,000,000.00	14.26%	8,236,500,000.00	28.19%	-	-
长江证券 股份有限 公司	13,032,096.23	14.29%	-	-	-	-
东方财富 证券股份 有限公司	-	-	6,525,100,000.00	22.34%	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	52,143,905.80	57.19%	6,319,200,000.00	21.63%	-	-
申万宏源 证券有限 公司	-	-	480,200,000.00	1.64%	-	-
开源证券 股份有限 公司	-	-	3,599,600,000.00	12.32%	-	-
光大证券 股份有限 公司	-	-	1,174,600,000.00	4.02%	-	-
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	232,900,000.00	0.80%	-	-
安信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
北京高华 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
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						
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国都证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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						
中信证券 股份有限 公司						
中银国际 证券股份 有限公司						

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实基金管理有限公司关于直销平台调整部分基金费率的公告	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3月11日
2	关于嘉实匠心回报混合型证券投资基金延长募集期的公告	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3月18日
3	嘉实匠心回报混合型证券投资基金基金合同生效公告	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3月31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5月29日
5	关于嘉实匠心回报混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定投业务的公告	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6月25日
6	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 7 月 1 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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6月29日
7	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
8	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
9	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 9 月 16 日、17 日、22 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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9月14日
10	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
11	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 9 月 29 日、30 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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9月27日
12	嘉实基金管理有限公司关于继续在网	中国证券报、基金管理人	2021年9月28日

	上直销开展基金认购、申购、转换费率优惠活动的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
13	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 10 月 14 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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 10 月 12 日
14	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 10 月 13 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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 10 月 14 日
15	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
16	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
17	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
18	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 12 月 24 日、12 月 27 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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 22 日
19	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
20	关于嘉实匠心回报混合 2021 年 12 月 29 日至 2022 年 1 月 3 日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	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 27 日

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予嘉实匠心回报混合型证券投资基金注册的批复文件。
- (2) 《嘉实匠心回报混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实匠心回报混合型证券投资基金托管协议》；
- (4) 《嘉实匠心回报混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实匠心回报混合型证券投资基金公告的各项原稿。

### 12.2 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

### 12.3 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**