

嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券  
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 01 月 01 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                                | 9         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 14        |
| 4.6 管理人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                                 | 19        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 20        |
| 7.4 报表附注                                | 21        |

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 8 投资组合报告</b> .....                     | <b>46</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                        | 46        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                  | 46        |
| 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 .....     | 48        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                   | 51        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                  | 53        |
| 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 .....    | 53        |
| 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 ..... | 53        |
| 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 ..... | 53        |
| 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 .....    | 53        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....             | 53        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 53        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                         | 54        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....                  | <b>56</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 56        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                      | 56        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 57        |
| 9.4 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 .....      | 57        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....                 | <b>57</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b> .....                    | <b>57</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 57        |
| 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 .....      | 57        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 58        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                        | 58        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 58        |
| 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 .....         | 58        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                | 58        |
| 11.8 其他重大事件 .....                           | 66        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....            | <b>67</b> |
| 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 .....    | 67        |
| <b>§ 13 备查文件目录</b> .....                    | <b>67</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                           | 67        |
| 13.2 存放地点 .....                             | 67        |
| 13.3 查阅方式 .....                             | 67        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称         | 嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金   |
| 基金简称         | 嘉实中证金融地产 ETF             |
| 场内简称         | 金融地产（扩位场内简称：金融地产 ETF 基金） |
| 基金主代码        | 512640                   |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                   |
| 基金合同生效日      | 2014 年 6 月 20 日          |
| 基金管理人        | 嘉实基金管理有限公司               |
| 基金托管人        | 中国银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额   | 38,240,886.00 份          |
| 基金合同存续期      | 不定期                      |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                  |
| 上市日期         | 2014 年 7 月 25 日          |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。   |
| 投资策略   | <p>本基金采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过正常范围的，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证金融地产指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型证券投资基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。   |

### 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                            | 中国银行股份有限公司        |                      |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名                                    | 胡勇钦               | 许俊                   |
|             | 联系电话                                  | (010)65215588     | 010-66596688         |
|             | 电子邮箱                                  | service@jsfund.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      | 400-600-8800                          | 95566             |                      |
| 传真          | (010)65215588                         | (010)66594942     |                      |
| 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 | 北京西城区复兴门内大街1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       | 北京西城区复兴门内大街1号     |                      |
| 邮政编码        | 100005                                | 100818            |                      |
| 法定代表人       | 经雷                                    | 刘连舸               |                      |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《上海证券报》   |
| 登载基金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 | 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 | 中国证券登记结算有限责任公司       | 北京市西城区太平桥大街17号                 |

## § 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         | 2020年        | 2019年         |
|---------------|---------------|--------------|---------------|
| 本期已实现收益       | 2,312,747.55  | 5,547,061.51 | 1,825,404.62  |
| 本期利润          | -5,079,552.87 | 3,425,961.89 | 15,202,005.63 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1505       | 0.0836       | 0.5235        |
| 本期加权平均净值利润率   | -7.13%        | 4.09%        | 27.01%        |

|               |               |               |               |
|---------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期基金份额净值增长率   | -7.89%        | 5.91%         | 34.95%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末       | 2020 年末       | 2019 年末       |
| 期末可供分配利润      | 39,810,929.10 | 45,889,613.44 | 29,754,730.91 |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.0411        | 1.2159        | 1.0923        |
| 期末基金资产净值      | 78,051,815.10 | 83,630,499.44 | 56,995,616.91 |
| 期末基金份额净值      | 2.0411        | 2.2159        | 2.0923        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末       | 2020 年末       | 2019 年末       |
| 基金份额累计净值增长率   | 104.11%       | 121.59%       | 109.23%       |

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。

## 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

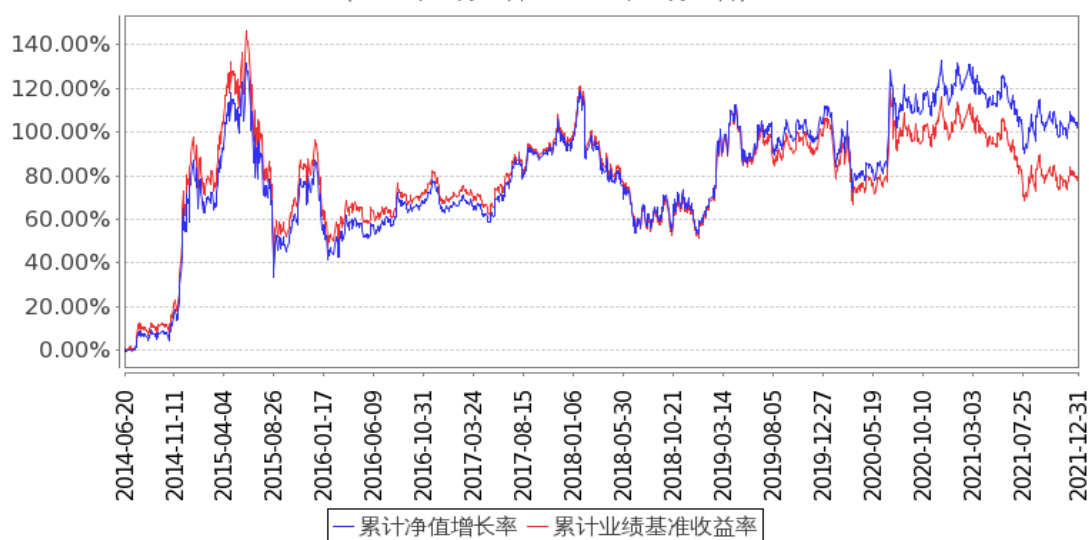
| 阶段    | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③   | ②-④    |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 0.66%    | 0.96%       | 0.50%      | 0.97%         | 0.16% | -0.01% |
| 过去六个月 | -4.20%   | 1.23%       | -6.49%     | 1.25%         | 2.29% | -0.02% |
| 过去一年  | -7.89%   | 1.19%       | -12.14%    | 1.21%         | 4.25% | -0.02% |

|            |         |       |        |       |        |        |
|------------|---------|-------|--------|-------|--------|--------|
| 过去三年       | 31.65%  | 1.38% | 16.92% | 1.40% | 14.73% | -0.02% |
| 过去五年       | 24.49%  | 1.29% | 6.85%  | 1.30% | 17.64% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | 104.11% | 1.55% | 79.53% | 1.58% | 24.58% | -0.03% |

### 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

#### 嘉实中证金融地产ETF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

(2014年06月20日至2021年12月31日)

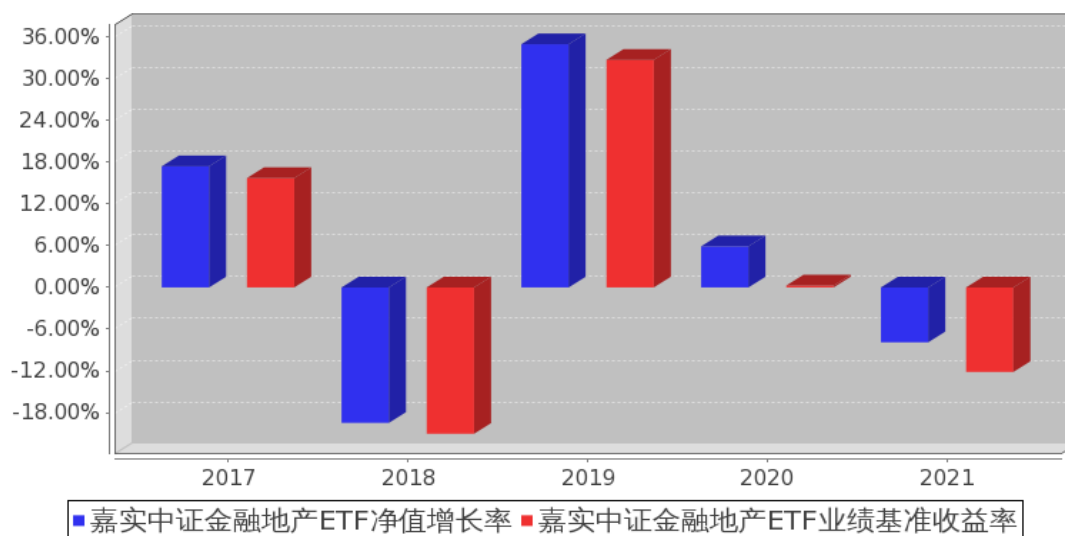


注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起6个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



### 3.2.3 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

嘉实中证金融地产ETF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 |        |    |
|    |    |                 |      |        |    |

|          |  |                 |   |      |  |
|----------|--|-----------------|---|------|--|
| 刘 珈<br>吟 | 本基金、嘉实沪深300ETF联接 (LOF)、嘉实 H 股指数 (QDII-LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实沪深300ETF、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实中证主要消费 ETF 联接、 | 2016 年 3 月 24 日 | - | 12 年 | 2009 年加入嘉实基金管理有限公司，曾任指数投资部指数研究员。现任指数投资部基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |
|----------|--|-----------------|---|------|--|

|    |  |                 |                 |     |   |
|----|--|-----------------|-----------------|-----|---|
|    | 嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实中证海外中国互联网 30ETF (QDII) 基金经理  |                 |                 |     |   |
| 李直 | 本基金、嘉实基本面 50 指数 (LOF)、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实中证 500ETF、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实创业板 ETF、嘉实基本面 50ETF、嘉实中证沪港深互联网 ETF、嘉实中证大农业 ETF、嘉实医药健康 100ETF 联接、嘉实恒生科技 ETF (QDII)、嘉实中证 | 2019 年 9 月 28 日 | 2021 年 9 月 24 日 | 7 年 | 2014 年 7 月加入嘉实基金管理有限公司，从事指数基金投资研究工作，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。中国国籍。 |

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
| 科创创业<br>50ETF、嘉<br>实中证新<br>能源汽车<br>指数、嘉<br>实中证科<br>创 创 业<br>50ETF 发<br>起联接基<br>金经理 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

（3）2022年1月27日，本基金管理人发布《关于嘉实中证金融地产ETF基金经理变更的公告》，聘请张钟玉女士担任本基金基金经理，刘珈吟女士不再管理本基金。

#### 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、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数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

报告期内，基金日均跟踪误差为 0.05%，年度化拟合偏离度为 0.87%。

本基金的跟踪误差主要来源于基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红以及样本股调整的冲击。

本基金跟踪的标的指数为中证金融地产行业指数，是中证行业指数系列的组成部分。中证行业指数将中证 800 指数 800 只样本股按行业进行分类，再以各行业全部股票作为样本编制行业指数，能够反映沪深两个市场 A 股中不同行业公司股票的整体表现，为投资者提供行业投资及分析工具。中证行业系列指数的全市场覆盖度及个股集中度较优，具备较强的行业代表性及投资性。

本基金主要采取完全复制法及其它指数投资技术构建基金的股票投资组合，以达到有效跟踪标的指数的目的；并根据标的指数成份股及权重的变动对股票投资组合进行适时地调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.0411 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.89%，业绩比较基准收益率为-12.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金作为一只投资于中证地产金融指数的被动投资管理产品，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对指数成份股调整、基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证地产金融行业指数的投资工具。

#### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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     | 普华永道中天审字(2022)第 23874 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         | 嘉实中证金融地产交易型开放式指数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>我们审计了嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证金融地产 ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度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,公允反映了嘉实中证金融地产 ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度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,我们独立于嘉实中证金融地产 ETF 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>嘉实中证金融地产 ETF 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中证金融地产 ETF 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中证金融地产 ETF 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中证金融地产 ETF 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,</p>   |



|           |   |
|-----------|---|
|           | <p>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，就可能对嘉实中证金融地产 ETF 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中证金融地产 ETF 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 | 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

### 7.1 资产负债表

会计主体：嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|------------|---------|-------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> |         |                         |                          |
| 银行存款       | 7.4.7.1 | 1,024,836.50            | 1,345,288.34             |
| 结算备付金      |         | 5,502.99                | 34,253.70                |
| 存出保证金      |         | 4,019.54                | 11,982.75                |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 77,154,299.65              | 82,373,035.19               |
| 其中：股票投资         |            | 76,696,299.65              | 82,373,035.19               |
| 基金投资            |            | -                          | -                           |
| 债券投资            |            | 458,000.00                 | -                           |
| 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         |            | 51,413.45                  | 61,450.02                   |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 119.05                     | 127.85                      |
| 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            |            | 78,240,191.18              | 83,826,137.85               |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>2020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         |            | -                          | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                          | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 32,038.63                  | 35,507.95                   |
| 应付托管费           |            | 6,407.72                   | 7,101.60                    |
| 应付销售服务费         |            | -                          | -                           |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 4,929.73                   | 13,028.86                   |
| 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    | 145,000.00                 | 140,000.00                  |
| 负债合计            |            | 188,376.08                 | 195,638.41                  |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                            |                             |
| 实收基金            | 7.4.7.9    | 38,240,886.00              | 37,740,886.00               |
| 未分配利润           | 7.4.7.10   | 39,810,929.10              | 45,889,613.44               |
| 所有者权益合计         |            | 78,051,815.10              | 83,630,499.44               |
| 负债和所有者权益总计      |            | 78,240,191.18              | 83,826,137.85               |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.0411 元，基金份额总额 38,240,886.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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<br>12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年<br>12 月 31 日 |
| 一、收入                   |            | -4,433,887.97                       | 4,217,698.04                        |
| 1. 利息收入                |            | 4,317.68                            | 10,156.71                           |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 4,111.24                            | 7,696.24                            |
| 债券利息收入                 |            | 57.26                               | 34.06                               |
| 资产支持证券利息收入             |            | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 149.18                              | 2,426.41                            |
| 证券出借利息收入               |            | -                                   | -                                   |
| 其他利息收入                 |            | -                                   | -                                   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 2,925,138.97                        | 6,259,678.37                        |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | 673,833.09                          | 3,191,645.22                        |
| 基金投资收益                 | -          | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | 55,885.13                           | 44,577.55                           |
| 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   | 2,195,420.75                        | 3,023,455.60                        |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -7,392,300.42                       | -2,121,099.62                       |
| 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   | 28,955.80                           | 68,962.58                           |
| 减：二、费用                 |            | 645,664.90                          | 791,736.15                          |
| 1. 管理人报酬               | -          | 355,842.53                          | 414,664.71                          |
| 2. 托管费                 | -          | 71,168.48                           | 82,932.97                           |
| 3. 销售服务费               | -          | -                                   | -                                   |
| 4. 交易费用                | 7.4.7.19   | 40,742.25                           | 114,633.92                          |
| 5. 利息支出                |            | -                                   | -                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出          |            | -                                   | -                                   |
| 6. 税金及附加               |            | 0.05                                | 0.06                                |
| 7. 其他费用                | 7.4.7.20   | 177,911.59                          | 179,504.49                          |

|                     |  |               |              |
|---------------------|--|---------------|--------------|
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |  | -5,079,552.87 | 3,425,961.89 |
| 减：所得税费用             |  | -             | -            |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |  | -5,079,552.87 | 3,425,961.89 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 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)                        | 37,740,886.00                               | 45,889,613.44  | 83,630,499.44  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | -5,079,552.87  | -5,079,552.87  |
| 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)      | 500,000.00                                  | -999,131.47    | -499,131.47    |
| 其中：1. 基金申购款                            | 14,500,000.00                               | 15,688,553.01  | 30,188,553.01  |
| 2. 基金赎回款                               | -14,000,000.00                              | -16,687,684.48 | -30,687,684.48 |
| 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)                        | 38,240,886.00                               | 39,810,929.10  | 78,051,815.10  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 27,240,886.00                               | 29,754,730.91  | 56,995,616.91  |
| 二、本期经营活                                | -   | 3,425,961.89   | 3,425,961.89   |

|  |                |                |                |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 动产生的基金净值变动数（本期利润）                      |                |                |                |
| 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）      | 10,500,000.00  | 12,708,920.64  | 23,208,920.64  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 57,500,000.00  | 65,394,244.68  | 122,894,244.68 |
| 2. 基金赎回款                               | -47,000,000.00 | -52,685,324.04 | -99,685,324.04 |
| 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）                        | 37,740,886.00  | 45,889,613.44  | 83,630,499.44  |

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

嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金(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[2013]921号《关于核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》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《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型交易型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2014年6月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为239,240,886.00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》、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数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。

#### 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 and 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

每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。本基金收益分配采取现金方式。

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。

(2) 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<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款           | 1,024,836.50            | 1,345,288.34             |
| 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   | 1,024,836.50 | 1,345,288.34 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年12月31日  |               |               |
|---------------|---------------------|---------------|---------------|
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 82,768,393.49       | 76,696,299.65 | -6,072,093.84 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场               | 458,000.00    | 458,000.00    |
|               | 银行间市场               | -             | -             |
|               | 合计                  | 458,000.00    | 458,000.00    |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -             |
| 基金            | -                   | -             | -             |
| 其他            | -                   | -             | -             |
| 合计            | 83,226,393.49       | 77,154,299.65 | -6,072,093.84 |
| 项目            | 上年度末<br>2020年12月31日 |               |               |
|               | 成本                  | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 81,052,828.61       | 82,373,035.19 | 1,320,206.58  |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                   | -             | -             |
| 债券            | 交易所市场               | -             | -             |
|               | 银行间市场               | -             | -             |
|               | 合计                  | -             | -             |
| 资产支持证券        | -                   | -             | -             |
| 基金            | -                   | -             | -             |
| 其他            | -                   | -             | -             |
| 合计            | 81,052,828.61       | 82,373,035.19 | 1,320,206.58  |

#### 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|------------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息   | 104.71             | 107.05              |
| 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  | 2.50               | 15.40               |
| 应收债券利息     | 10.04              | -                   |
| 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         | 1.80               | 5.40                |
| 合计         | 119.05             | 127.85              |

## 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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 4,929.73           | 13,028.86           |
| 银行间市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 合计          | 4,929.73           | 13,028.86           |

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020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        | 135,000.00         | 130,000.00          |
| 应付指数使用费     | 10,000.00          | 10,000.00           |
| 合计          | 145,000.00         | 140,000.00          |

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |               |
|------|-----------------------------|---------------|
|      | 基金份额（份）                     | 账面金额          |
| 上年度末 | 37,740,886.00               | 37,740,886.00 |
| 本期申购 | 14,500,000.00               | 14,500,000.00 |

|               |                |                |
|---------------|----------------|----------------|
| 本期赎回（以“-”号填列） | -14,000,000.00 | -14,000,000.00 |
| - 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           | 38,240,886.00  | 38,240,886.00  |

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           | 62,917,882.19  | -17,028,268.75 | 45,889,613.44  |
| 本期利润           | 2,312,747.55   | -7,392,300.42  | -5,079,552.87  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,214,298.72   | -2,213,430.19  | -999,131.47    |
| 其中：基金申购款       | 25,082,232.11  | -9,393,679.10  | 15,688,553.01  |
| 基金赎回款          | -23,867,933.39 | 7,180,248.91   | -16,687,684.48 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | 66,444,928.46  | -26,633,999.36 | 39,810,929.10  |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 3,759.13              | 6,735.66              |
| 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 | 268.80                | 815.11                |
| 其他        | 83.31                 | 145.47                |
| 合计        | 4,111.24              | 7,696.24              |

#### 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                    | 上年度可比期间               |
|----------------------|-----------------------|-----------------------|
|                      | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 股票投资收益——买卖<br>股票差价收入 | 1,282,263.90          | 3,489,886.32          |
| 股票投资收益——赎回<br>差价收入   | -608,430.81           | -298,241.10           |

|                      |            |              |
|----------------------|------------|--------------|
| 股票投资收益——申购<br>差价收入   | -          | -            |
| 股票投资收益——证券<br>出借差价收入 | -          | -            |
| 合计                   | 673,833.09 | 3,191,645.22 |

#### 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<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12<br>月31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额       | 15,376,654.67                   | 40,360,733.43                        |
| 减：卖出股票成本总<br>额 | 14,094,390.77                   | 36,870,847.11                        |
| 买卖股票差价收入       | 1,282,263.90                    | 3,489,886.32                         |

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|-----------------|-----------------------------|--------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总<br>额  | 30,687,684.48               | 99,685,324.04                        |
| 减：现金支付赎回款总<br>额 | 6,705,814.48                | 20,895,721.04                        |
| 减：赎回股票成本总额      | 24,590,300.81               | 79,087,844.10                        |
| 赎回差价收入          | -608,430.81                 | -298,241.10                          |

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

#### 7.4.7.12.5 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<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31<br>日 |
|---------------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖<br>债券（、债转股及债券<br>到期兑付）差价收入 | 55,885.13                       | 44,577.55                            |
| 债券投资收益——赎回<br>差价收入                    | -                               | -                                    |
| 债券投资收益——申购<br>差价收入                    | -                               | -                                    |
| 合计                                    | 55,885.13                       | 44,577.55                            |

#### 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<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月<br>31日 |
|---------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债<br>券到期兑付）成交总额       | 494,032.77                      | 328,212.22                           |
| 减：卖出债券（、债转股<br>及债券到期兑付）成本总<br>额 | 438,100.00                      | 283,600.00                           |
| 减：应收利息总额                        | 47.64                           | 34.67                                |
| 买卖债券差价收入                        | 55,885.13                       | 44,577.55                            |

#### 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                    | 上年度可比期间               |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
|               | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 2,195,420.75          | 3,023,455.60          |
| 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            | 2,195,420.75          | 3,023,455.60          |

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------|-----------------------|-----------------------|
|            | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | -7,392,300.42         | -2,121,099.62         |
| 股票投资       | -7,392,300.42         | -2,121,099.62         |
| 债券投资       | -                     | -                     |
| 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                     | -7,392,300.42 | -2,121,099.62 |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年<br>12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                               | -                                    |
| 替代损益    | 28,955.80                       | 68,962.58                            |
| 合计      | 28,955.80                       | 68,962.58                            |

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|-----------|---------------------------------|----------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 40,742.25                       | 114,633.92                       |
| 银行间市场交易费用 | -                               | -                                |
| 合计        | 40,742.25                       | 114,633.92                       |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|---------|---------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 55,000.00                       | 50,000.00                        |
| 信息披露费   | 80,000.00                       | 80,000.00                        |
| 证券出借违约金 | -                               | -                                |
| 银行划款手续费 | 2,911.59                        | 4,504.49                         |
| 指数使用费   | 40,000.00                       | 40,000.00                        |
| 其他      | -                               | 5,000.00                         |
| 合计      | 177,911.59                      | 179,504.49                       |

#### 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       |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)                          | 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 |
| 嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“嘉实中证金融地产ETF联接”) | 本基金的联接基金    |

#### 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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>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  | 355,842.53                  | 414,664.71                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                           | -                                |

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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×0.50%/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<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>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 | 71,168.48                   | 82,932.97                        |

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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×0.10%/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

份额单位：份

| 关联方名称             | 本期末<br>2021年12月31日 |                             | 上年度末<br>2020年12月31日 |                             |
|-------------------|--------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
|                   | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例(%) | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例(%) |
| 嘉实中证金融<br>地产ETF联接 | 30,188,600.00      | 78.94                       | 30,871,900.00       | 81.80                       |

## 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<br>2021年1月1日至2021年12月31<br>日 |          | 上年度可比期间<br>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   |
| 中国银行股份有限公司<br>活期 | 1,024,836.50                    | 3,759.13 | 1,345,288.34                     | 6,735.66 |

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

报告期末(2021年12月31日)，本基金持有281,700股中国银行的A股普通股，估值总额为人民币859,185.00元，占基金资产净值的比例为1.10%(2020年12月31日：275,400股，估值总额为人民币875,772.00元，占基金资产净值的比例为1.05%)。

## 7.4.11 利润分配情况

本期(2021年1月1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<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日 | 可流通<br>日 | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总<br>额 | 备注 |

|                      |          |                     |                    |            |          |            | 位：股)             |            |            |    |
|----------------------|----------|---------------------|--------------------|------------|----------|------------|------------------|------------|------------|----|
| 001234               | 泰慕士      | 2021年<br>12月31<br>日 | 2022年<br>1月11<br>日 | 新发未<br>上市  | 16.53    | 16.53      | 333              | 5,504.49   | 5,504.49   | -  |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券 |          |                     |                    |            |          |            |                  |            |            |    |
| 证券<br>代码             | 证券<br>名称 | 成功<br>认购日           | 可流通<br>日           | 流通受<br>限类型 | 认购<br>价格 | 期末估<br>值单价 | 数量<br>(单<br>位：张) | 期末<br>成本总额 | 期末估值总<br>额 | 备注 |
| 113052               | 兴业<br>转债 | 2021年<br>12月28<br>日 | 2022年<br>1月14<br>日 | 新债未<br>上市  | 100.00   | 100.00     | 4,580            | 458,000.00 | 458,000.00 | -  |

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

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

#### 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

本基金属股票型证券投资基金，预期风险和收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。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进行被动指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争日均跟踪偏离度的绝对值

不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。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风险管理制，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，将风险控制可在承受的范围。

#### **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<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 458,000.00         | -                   |
| AAA 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 458,000.00         | -                   |

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、流通受限制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<br>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                    | 1,024,836.50 | -     | -          | -             | 1,024,836.50  |
| 结算备付金                   | 5,502.99     | -     | -          | -             | 5,502.99      |
| 存出保证金                   | 4,019.54     | -     | -          | -             | 4,019.54      |
| 交易性金融资产                 | -            | -     | 458,000.00 | 76,696,299.65 | 77,154,299.65 |
| 衍生金融资产                  | -            | -     | -          | -             | -             |
| 买入返售金融资产                | -            | -     | -          | -             | -             |
| 应收证券清算款                 | -            | -     | -          | 51,413.45     | 51,413.45     |
| 应收利息                    | -            | -     | -          | 119.05        | 119.05        |
| 应收股利                    | -            | -     | -          | -             | -             |
| 应收申购款                   | -            | -     | -          | -             | -             |
| 递延所得税资产                 | -            | -     | -          | -             | -             |

|                     |              |      |            |               |               |
|---------------------|--------------|------|------------|---------------|---------------|
| 其他资产                | -            | -    | -          | -             | -             |
| 资产总计                | 1,034,359.03 | -    | 458,000.00 | 76,747,832.15 | 78,240,191.18 |
| 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               | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -          | 32,038.63     | 32,038.63     |
| 应付托管费               | -            | -    | -          | 6,407.72      | 6,407.72      |
| 应付销售服务费             | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应付交易费用              | -            | -    | -          | 4,929.73      | 4,929.73      |
| 应付税费                | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应付利息                | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应付利润                | -            | -    | -          | -             | -             |
| 递延所得税负债             | -            | -    | -          | -             | -             |
| 其他负债                | -            | -    | -          | 145,000.00    | 145,000.00    |
| 负债总计                | -            | -    | -          | 188,376.08    | 188,376.08    |
| 利率敏感度缺口             | 1,034,359.03 | -    | 458,000.00 | 76,559,456.07 | 78,051,815.10 |
| 上年度末<br>2020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                | 1,345,288.34 | -    | -          | -             | 1,345,288.34  |
| 结算备付金               | 34,253.70    | -    | -          | -             | 34,253.70     |
| 存出保证金               | 11,982.75    | -    | -          | -             | 11,982.75     |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -          | 82,373,035.19 | 82,373,035.19 |
| 衍生金融资产              | -            | -    | -          | -             | -             |
| 买入返售金融资产            | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应收证券清算款             | -            | -    | -          | 61,450.02     | 61,450.02     |
| 应收利息                | -            | -    | -          | 127.85        | 127.85        |
| 应收股利                | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应收申购款               | -            | -    | -          | -             | -             |
| 递延所得税资产             | -            | -    | -          | -             | -             |
| 其他资产                | -            | -    | -          | -             | -             |
| 资产总计                | 1,391,524.79 | -    | -          | 82,434,613.06 | 83,826,137.85 |
| 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               | -            | -    | -          | -             | -             |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -          | 35,507.95     | 35,507.95     |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应付托管费   | -            | - | - | 7,101.60      | 7,101.60      |
| 应付销售服务费 | -            | - | - | -             | -             |
| 应付交易费用  | -            | - | - | 13,028.86     | 13,028.86     |
| 应付税费    | -            | - | - | -             | -             |
| 应付利息    | -            | - | - | -             | -             |
| 应付利润    | -            | - | - | -             | -             |
| 递延所得税负债 | -            | - | - | -             | -             |
| 其他负债    | -            | - | - | 140,000.00    | 140,000.00    |
| 负债总计    | -            | - | - | 195,638.41    | 195,638.41    |
| 利率敏感度缺口 | 1,391,524.79 | - | - | 82,238,974.65 | 83,630,499.44 |

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）            | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点      | -6,536.78                   | -                 |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 6,648.50                    | -                 |

#### 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）            | 上年度末（2020年12月31日） |

|    |                |   |      |
|----|----------------|---|------|
|    |                |   | 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<br>2021年12月31日 |               | 上年度末<br>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  | 76,696,299.65      | 98.26         | 82,373,035.19       | 98.50         |
| 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            | 76,696,299.65      | 98.26         | 82,373,035.19       | 98.50         |

#### 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           | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |

|    | 动              | 本期末（2021年12月31日） | 上年度末（2020年12月31日） |
|----|----------------|------------------|-------------------|
| 分析 | 业绩比较基准上升<br>5% | 3,836,187.35     | 4,088,922.32      |
|    | 业绩比较基准下降<br>5% | -3,836,187.35    | -4,088,922.32     |

#### 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 76,690,795.16 元，属于第二层次的余额为 463,504.49 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 81,879,419.66 元，第二层次 493,615.53 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（上年度末：无）。

## (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。

## § 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              | 76,696,299.65 | 98.03         |
|    | 其中：股票             | 76,696,299.65 | 98.03         |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 458,000.00    | 0.59          |
|    | 其中：债券             | 458,000.00    | 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      | 1,030,339.49  | 1.32          |
| 8  | 其他各项资产            | 55,552.04     | 0.07          |
| 9  | 合计                | 78,240,191.18 | 100.00        |

注：股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值 (元)   | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | -          | -             |
| B  | 采矿业      | -          | -             |
| C  | 制造业      | 119,497.00 | 0.15          |
| D  | 电力、热力、燃气 | -          | -             |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
|   | 及水生产和供应业        |               |       |
| E | 建筑业             | 222,576.90    | 0.29  |
| F | 批发和零售业          | 67,473.00     | 0.09  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业     | -             | -     |
| H | 住宿和餐饮业          | -             | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | -             | -     |
| J | 金融业             | 68,602,271.23 | 87.89 |
| K | 房地产业            | 7,633,043.22  | 9.78  |
| L | 租赁和商务服务业        | -             | -     |
| M | 科学研究和技术服务业      | -             | -     |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | -             | -     |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -             | -     |
| P | 教育              | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作         | -             | -     |
| R | 文化、体育和娱乐业       | -             | -     |
| S | 综合              | -             | -     |
|   | 合计              | 76,644,861.35 | 98.20 |

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）   | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|-----------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -         | -            |
| B  | 采矿业              | -         | -            |
| C  | 制造业              | 23,881.29 | 0.03         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -         | -            |
| E  | 建筑业              | 4,713.80  | 0.01         |
| F  | 批发和零售业           | -         | -            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | -         | -            |
| H  | 住宿和餐饮业           | -         | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -         | -            |
| J  | 金融业              | -         | -            |
| K  | 房地产业             | -         | -            |
| L  | 租赁和商务服务业         | -         | -            |
| M  | 科学研究和技术服         | -         | -            |

|   |               |           |      |
|---|---------------|-----------|------|
|   | 务业            |           |      |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | -         | -    |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -         | -    |
| P | 教育            | -         | -    |
| Q | 卫生和社会工作       | -         | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 22,843.21 | 0.03 |
| S | 综合            | -         | -    |
|   | 合计            | 51,438.30 | 0.07 |

### 8.2.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资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  | 600036 | 招商银行 | 165,400 | 8,056,634.00 | 10.32        |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 144,700 | 7,294,327.00 | 9.35         |
| 3  | 300059 | 东方财富 | 110,560 | 4,102,881.60 | 5.26         |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 194,300 | 3,699,472.00 | 4.74         |
| 5  | 600030 | 中信证券 | 113,800 | 3,005,458.00 | 3.85         |
| 6  | 601398 | 工商银行 | 468,100 | 2,167,303.00 | 2.78         |
| 7  | 000001 | 平安银行 | 129,576 | 2,135,412.48 | 2.74         |
| 8  | 002142 | 宁波银行 | 52,983  | 2,028,189.24 | 2.60         |
| 9  | 000002 | 万科A  | 90,900  | 1,796,184.00 | 2.30         |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 367,100 | 1,692,331.00 | 2.17         |
| 11 | 600837 | 海通证券 | 129,000 | 1,581,540.00 | 2.03         |
| 12 | 600048 | 保利发展 | 96,000  | 1,500,480.00 | 1.92         |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 469,100 | 1,379,154.00 | 1.77         |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 156,853 | 1,337,956.09 | 1.71         |
| 15 | 600016 | 民生银行 | 331,564 | 1,293,099.60 | 1.66         |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 45,715  | 1,239,790.80 | 1.59         |
| 17 | 601688 | 华泰证券 | 68,800  | 1,221,888.00 | 1.57         |
| 18 | 601211 | 国泰君安 | 60,300  | 1,078,767.00 | 1.38         |
| 19 | 000776 | 广发证券 | 39,500  | 971,305.00   | 1.24         |
| 20 | 601229 | 上海银行 | 132,933 | 947,812.29   | 1.21         |
| 21 | 600919 | 江苏银行 | 157,850 | 920,265.50   | 1.18         |
| 22 | 601169 | 北京银行 | 197,627 | 877,463.88   | 1.12         |
| 23 | 600999 | 招商证券 | 49,680  | 876,852.00   | 1.12         |



|    |        |       |         |            |      |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 24 | 601988 | 中国银行  | 281,700 | 859,185.00 | 1.10 |
| 25 | 600958 | 东方证券  | 55,800  | 822,492.00 | 1.05 |
| 26 | 000166 | 申万宏源  | 150,540 | 770,764.80 | 0.99 |
| 27 | 601658 | 邮储银行  | 145,300 | 741,030.00 | 0.95 |
| 28 | 601818 | 光大银行  | 220,900 | 733,388.00 | 0.94 |
| 29 | 601377 | 兴业证券  | 71,750  | 708,890.00 | 0.91 |
| 30 | 601628 | 中国人寿  | 22,300  | 671,007.00 | 0.86 |
| 31 | 601009 | 南京银行  | 66,916  | 599,567.36 | 0.77 |
| 32 | 001979 | 招商蛇口  | 42,477  | 566,643.18 | 0.73 |
| 33 | 601939 | 建设银行  | 89,800  | 526,228.00 | 0.67 |
| 34 | 600926 | 杭州银行  | 39,612  | 507,825.84 | 0.65 |
| 35 | 601066 | 中信建投  | 17,300  | 506,025.00 | 0.65 |
| 36 | 601555 | 东吴证券  | 53,956  | 478,050.16 | 0.61 |
| 37 | 600015 | 华夏银行  | 82,316  | 460,969.60 | 0.59 |
| 38 | 002736 | 国信证券  | 38,500  | 441,980.00 | 0.57 |
| 39 | 601336 | 新华保险  | 11,128  | 432,656.64 | 0.55 |
| 40 | 601901 | 方正证券  | 55,000  | 431,200.00 | 0.55 |
| 41 | 600383 | 金地集团  | 30,200  | 391,694.00 | 0.50 |
| 42 | 601916 | 浙商银行  | 111,700 | 390,950.00 | 0.50 |
| 43 | 000783 | 长江证券  | 51,800  | 390,572.00 | 0.50 |
| 44 | 601788 | 光大证券  | 26,000  | 388,180.00 | 0.50 |
| 45 | 000069 | 华侨城 A | 54,800  | 385,792.00 | 0.49 |
| 46 | 601108 | 财通证券  | 33,500  | 372,520.00 | 0.48 |
| 47 | 600918 | 中泰证券  | 37,300  | 371,881.00 | 0.48 |
| 48 | 600109 | 国金证券  | 32,300  | 365,959.00 | 0.47 |
| 49 | 601155 | 新城控股  | 12,248  | 356,784.24 | 0.46 |
| 50 | 601838 | 成都银行  | 29,000  | 348,000.00 | 0.45 |
| 51 | 002797 | 第一创业  | 44,960  | 329,107.20 | 0.42 |
| 52 | 601077 | 渝农商行  | 82,700  | 318,395.00 | 0.41 |
| 53 | 000728 | 国元证券  | 40,800  | 314,160.00 | 0.40 |
| 54 | 601990 | 南京证券  | 29,600  | 293,336.00 | 0.38 |
| 55 | 002673 | 西部证券  | 35,934  | 289,987.38 | 0.37 |
| 56 | 600705 | 中航产融  | 71,600  | 284,252.00 | 0.36 |
| 57 | 600061 | 国投资本  | 34,508  | 283,655.76 | 0.36 |
| 58 | 601878 | 浙商证券  | 20,800  | 274,144.00 | 0.35 |
| 59 | 601198 | 东兴证券  | 21,700  | 252,371.00 | 0.32 |
| 60 | 601696 | 中银证券  | 18,500  | 248,825.00 | 0.32 |
| 61 | 601128 | 常熟银行  | 36,700  | 242,587.00 | 0.31 |
| 62 | 600369 | 西南证券  | 44,400  | 234,876.00 | 0.30 |
| 63 | 601162 | 天风证券  | 57,940  | 234,657.00 | 0.30 |
| 64 | 601997 | 贵阳银行  | 34,280  | 223,162.80 | 0.29 |
| 65 | 600606 | 绿地控股  | 51,285  | 222,576.90 | 0.29 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 66  | 002936 | 郑州银行  | 68,708 | 217,117.28 | 0.28 |
| 67  | 601995 | 中金公司  | 4,400  | 215,732.00 | 0.28 |
| 68  | 000750 | 国海证券  | 51,015 | 209,671.65 | 0.27 |
| 69  | 002926 | 华西证券  | 21,100 | 207,835.00 | 0.27 |
| 70  | 600909 | 华安证券  | 37,720 | 204,065.20 | 0.26 |
| 71  | 601881 | 中国银河  | 17,200 | 192,468.00 | 0.25 |
| 72  | 000656 | 金科股份  | 42,900 | 192,192.00 | 0.25 |
| 73  | 600848 | 上海临港  | 12,880 | 191,525.60 | 0.25 |
| 74  | 002500 | 山西证券  | 28,830 | 190,278.00 | 0.24 |
| 75  | 601998 | 中信银行  | 40,900 | 188,958.00 | 0.24 |
| 76  | 000537 | 广宇发展  | 7,500  | 180,750.00 | 0.23 |
| 77  | 601319 | 中国人保  | 38,000 | 178,600.00 | 0.23 |
| 78  | 600208 | 新潮中宝  | 57,600 | 171,648.00 | 0.22 |
| 79  | 000686 | 东北证券  | 18,920 | 166,117.60 | 0.21 |
| 80  | 002939 | 长城证券  | 12,600 | 163,170.00 | 0.21 |
| 81  | 600155 | 华创阳安  | 16,300 | 162,348.00 | 0.21 |
| 82  | 600390 | 五矿资本  | 30,040 | 159,812.80 | 0.20 |
| 83  | 600895 | 张江高科  | 10,300 | 155,118.00 | 0.20 |
| 84  | 601236 | 红塔证券  | 12,730 | 151,741.60 | 0.19 |
| 85  | 002966 | 苏州银行  | 22,300 | 150,971.00 | 0.19 |
| 86  | 002670 | 国盛金控  | 15,497 | 148,771.20 | 0.19 |
| 87  | 000540 | 中天金融  | 56,200 | 148,368.00 | 0.19 |
| 88  | 002958 | 青农商行  | 37,200 | 143,592.00 | 0.18 |
| 89  | 600325 | 华发股份  | 22,720 | 136,774.40 | 0.18 |
| 90  | 601456 | 国联证券  | 9,500  | 132,715.00 | 0.17 |
| 91  | 000987 | 越秀金控  | 14,900 | 129,630.00 | 0.17 |
| 92  | 600663 | 陆家嘴   | 11,900 | 129,234.00 | 0.17 |
| 93  | 002146 | 荣盛发展  | 29,100 | 126,585.00 | 0.16 |
| 94  | 601577 | 长沙银行  | 16,100 | 125,741.00 | 0.16 |
| 95  | 600811 | 东方集团  | 39,700 | 119,497.00 | 0.15 |
| 96  | 001914 | 招商积余  | 5,800  | 117,508.00 | 0.15 |
| 97  | 600908 | 无锡银行  | 20,000 | 113,400.00 | 0.15 |
| 98  | 600906 | 财达证券  | 8,600  | 109,736.00 | 0.14 |
| 99  | 600064 | 南京高科  | 11,700 | 109,278.00 | 0.14 |
| 100 | 000961 | 中南建设  | 25,500 | 105,570.00 | 0.14 |
| 101 | 600120 | 浙江东方  | 23,240 | 102,720.80 | 0.13 |
| 102 | 000671 | 阳光城   | 33,147 | 100,103.94 | 0.13 |
| 103 | 600376 | 首开股份  | 17,200 | 97,352.00  | 0.12 |
| 104 | 000718 | 苏宁环球  | 20,400 | 96,084.00  | 0.12 |
| 105 | 000402 | 金融街   | 16,000 | 90,560.00  | 0.12 |
| 106 | 600643 | 爱建集团  | 13,063 | 88,305.88  | 0.11 |
| 107 | 000563 | 陕国投 A | 26,640 | 86,047.20  | 0.11 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 108 | 601860 | 紫金银行 | 24,400 | 81,740.00 | 0.10 |
| 109 | 600901 | 江苏租赁 | 16,000 | 81,440.00 | 0.10 |
| 110 | 600266 | 城建发展 | 18,068 | 81,306.00 | 0.10 |
| 111 | 002244 | 滨江集团 | 16,600 | 77,356.00 | 0.10 |
| 112 | 600095 | 湘财股份 | 7,600  | 76,912.00 | 0.10 |
| 113 | 600928 | 西安银行 | 17,800 | 76,540.00 | 0.10 |
| 114 | 002423 | 中粮资本 | 9,200  | 74,520.00 | 0.10 |
| 115 | 600649 | 城投控股 | 16,926 | 69,565.86 | 0.09 |
| 116 | 600648 | 外高桥  | 5,100  | 67,473.00 | 0.09 |
| 117 | 000031 | 大悦城  | 17,200 | 64,156.00 | 0.08 |
| 118 | 600639 | 浦东金桥 | 4,700  | 60,019.00 | 0.08 |
| 119 | 000046 | 泛海控股 | 27,900 | 52,452.00 | 0.07 |
| 120 | 002945 | 华林证券 | 3,800  | 51,908.00 | 0.07 |
| 121 | 002948 | 青岛银行 | 11,000 | 50,930.00 | 0.07 |
| 122 | 600823 | 世茂股份 | 15,100 | 49,528.00 | 0.06 |
| 123 | 600657 | 信达地产 | 11,600 | 43,268.00 | 0.06 |
| 124 | 600466 | 蓝光发展 | 20,400 | 41,616.00 | 0.05 |
| 125 | 601665 | 齐鲁银行 | 6,800  | 37,944.00 | 0.05 |
| 126 | 601187 | 厦门银行 | 4,000  | 27,600.00 | 0.04 |

### 8.3.2 期末积极投资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  | 603230 | 内蒙新华 | 883   | 22,843.21 | 0.03         |
| 2  | 001296 | 长江材料 | 310   | 18,376.80 | 0.02         |
| 3  | 001234 | 泰慕士  | 333   | 5,504.49  | 0.01         |
| 4  | 603176 | 汇通集团 | 1,924 | 4,713.80  | 0.01         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 4 支积极投资股票。

### 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  | 300059 | 东方财富 | 1,547,679.00 | 1.85           |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 1,166,776.00 | 1.40           |
| 3  | 002142 | 宁波银行 | 1,088,090.41 | 1.30           |
| 4  | 000002 | 万科A  | 913,261.00   | 1.09           |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 486,736.00   | 0.58           |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 450,507.00   | 0.54           |
| 7  | 601658 | 邮储银行 | 436,373.00   | 0.52           |
| 8  | 000166 | 申万宏源 | 407,824.00   | 0.49           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 9  | 600918 | 中泰证券 | 293,545.00 | 0.35 |
| 10 | 600837 | 海通证券 | 291,031.00 | 0.35 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 290,208.00 | 0.35 |
| 12 | 000776 | 广发证券 | 282,004.00 | 0.34 |
| 13 | 300033 | 同花顺  | 252,541.00 | 0.30 |
| 14 | 600016 | 民生银行 | 233,603.00 | 0.28 |
| 15 | 001979 | 招商蛇口 | 231,757.00 | 0.28 |
| 16 | 601696 | 中银证券 | 224,393.00 | 0.27 |
| 17 | 601916 | 浙商银行 | 219,507.00 | 0.26 |
| 18 | 601166 | 兴业银行 | 213,087.00 | 0.25 |
| 19 | 601077 | 渝农商行 | 203,129.00 | 0.24 |
| 20 | 601995 | 中金公司 | 190,846.00 | 0.23 |

#### 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  | 300059 | 东方财富 | 1,418,285.00 | 1.70           |
| 2  | 000001 | 平安银行 | 1,168,288.00 | 1.40           |
| 3  | 000002 | 万科A  | 992,299.00   | 1.19           |
| 4  | 002142 | 宁波银行 | 661,430.00   | 0.79           |
| 5  | 300033 | 同花顺  | 631,506.00   | 0.76           |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 399,332.00   | 0.48           |
| 7  | 600036 | 招商银行 | 397,524.00   | 0.48           |
| 8  | 601099 | 太平洋  | 297,046.00   | 0.36           |
| 9  | 000776 | 广发证券 | 273,388.00   | 0.33           |
| 10 | 000166 | 申万宏源 | 239,219.00   | 0.29           |
| 11 | 001979 | 招商蛇口 | 224,477.00   | 0.27           |
| 12 | 002736 | 国信证券 | 184,557.00   | 0.22           |
| 13 | 601166 | 兴业银行 | 175,099.00   | 0.21           |
| 14 | 601825 | 沪农商行 | 173,628.80   | 0.21           |
| 15 | 601688 | 华泰证券 | 172,449.00   | 0.21           |
| 16 | 000783 | 长江证券 | 166,182.00   | 0.20           |
| 17 | 000069 | 华侨城A | 163,676.00   | 0.20           |
| 18 | 601009 | 南京银行 | 138,185.00   | 0.17           |
| 19 | 002839 | 张家港行 | 129,349.00   | 0.15           |
| 20 | 000728 | 国元证券 | 125,689.00   | 0.15           |

#### 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 | 16,842,945.46 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 15,376,654.67 |

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） | 458,000.00 | 0.59         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 458,000.00 | 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  | 113052 | 兴业转债 | 4,580 | 458,000.00 | 0.59         |

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

### 8.10 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 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

(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。

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

2021 年 8 月 20 日，中国人民银行银罚字（2021）26 号对兴业银行股份有限公司因违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定，于 2021 年 8 月 13 日作出行政处罚决定，罚款合计 5 万元。

2021 年 7 月 16 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）28 号），对交通银行股份有限公司理财业务和同业业务制度不健全等违法违规事实，于 2021 年 7 月 13 日作出行政处罚决定，罚款 4100 万元。

2021 年 6 月 11 日，宁波银保监局发布宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字（2021）36 号），对宁波银行股份有限公司代理销售保险不规范的违法违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、第四十八条第（一）项，于 2021 年 6 月 10 日作出行政处罚决定，罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分。2021 年 8 月 6 日，宁波银保监局发布宁波银保监局行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字（2021）57 号），对宁波银行股份有限公司贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、

房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎的违法违规事实，依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，于 2021 年 7 月 30 日作出行政处罚决定，罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。2021 年 12 月 31 日，宁波银保监局发布行政处罚信息公开表（甬银保监罚决字（2021）81 号），对宁波银行股份有限公司信用卡业务管理不到位的违法违规事实，于 2021 年 12 月 29 日作出行政处罚决定，罚款人民币 30 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

本基金投资于“招商银行（600036）”、“工商银行（601398）”、“兴业银行（601166）”、“交通银行（601328）”、“宁波银行（002142）”的决策程序说明：本基金投资目标为紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化，招商银行、工商银行、兴业银行、交通银行、宁波银行为标的指数成份股，本基金投资于“招商银行”、“工商银行”、“兴业银行”、“交通银行”、“宁波银行”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，其他五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。

### 8.12.2 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   | 4,019.54  |
| 2  | 应收证券清算款 | 51,413.45 |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 119.05    |
| 5  | 应收申购款   | -         |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 55,552.04 |

### 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

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|---------------|----------|
| 1  | 001234 | 泰慕士  | 5,504.49    | 0.01          | 新发未上市    |

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

## 9.1.1 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>(%) | 持有份额         | 占总份额比例<br>(%) |
| 625          | 61,185.42     | 33,530,068.00 | 87.68         | 4,710,818.00 | 12.32         |

## 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 项目                         | 持有份额 (份)      | 占总份额比例 (%) |
|----------------------------|---------------|------------|
| 嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 30,188,600.00 | 78.94      |

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                      | 持有份额 (份)      | 占上市总份额比例 (%) |
|----|----------------------------|---------------|--------------|
| 1  | 中泰证券股份有限公司                 | 3,340,368.00  | 8.74         |
| 2  | 苏德福                        | 1,311,580.00  | 3.43         |
| 3  | 毛新程                        | 116,500.00    | 0.30         |
| 4  | 李文哲                        | 109,300.00    | 0.29         |
| 5  | 程一军                        | 100,000.00    | 0.26         |
| 6  | 赖小毅                        | 99,600.00     | 0.26         |
| 7  | 刘海晖                        | 87,100.00     | 0.23         |
| 8  | 宋秉乾                        | 84,725.00     | 0.22         |
| 9  | 蒯重存                        | 78,600.00     | 0.21         |
| 10 | 段富云                        | 71,500.00     | 0.19         |
| 11 | 嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 30,188,600.00 | 78.94        |



注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

### 9.3 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 | 100.00    | 0.00        |

### 9.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

|                               |                |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2014年6月20日）<br>基金份额总额 | 239,240,886.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                  | 37,740,886.00  |
| 本报告期基金总申购份额                   | 14,500,000.00  |
| 减：本报告期基金总赎回份额                 | 14,000,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）      | -              |
| 本报告期末基金份额总额                   | 38,240,886.00  |

## § 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。

2021年9月24日本基金管理人发布《关于嘉实中证金融地产ETF基金经理变更的公告》，李直先生不再担任本基金基金经理职务，本基金由刘珈吟女士单独管理。

#### （2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的审计费 55,000.00 元,该审计机构已连续 8 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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         | 交易单元数量 | 股票交易          |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|--------------|--------|---------------|--------------|-----------|------------|----|
|              |        | 成交金额          | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 中信建投证券股份有限公司 | 4      | 17,066,612.75 | 55.81%       | 11,946.75 | 55.80%     | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 3      | 13,515,890.56 | 44.19%       | 9,461.56  | 44.20%     | -  |
| 安信证券股份有限公司   | 3      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 渤海证券股份有限公司   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |

|                |   |   |   |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 长城证券股<br>份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 长江证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券股<br>份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券股<br>份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券股<br>份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券股<br>份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 光大证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券股<br>份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 国海证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国金证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券股<br>份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券股<br>份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有<br>限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股          | 1 | - | - | - | - | - |

|                |   |   |   |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 份有限公司          |   |   |   |   |   |   |
| 华创证券有<br>限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券有<br>限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股<br>份有限公司 | 5 | - | - | - | - | - |
| 华西证券股<br>份有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 联储证券有<br>限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 平安证券股<br>份有限公司 | 4 | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有<br>限责任公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证<br>券有限公司 | 3 | - | - | - | - | - |
| 天风证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股<br>份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 湘财证券股<br>份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券<br>股份有限公 | 2 | - | - | - | - | - |

|                      |    |   |   |   |   |   |
|----------------------|----|---|---|---|---|---|
| 司                    |    |   |   |   |   |   |
| 信达证券股<br>份有限公司       | 3  | - | - | - | - | - |
| 兴业证券股<br>份有限公司       | 3  | - | - | - | - | - |
| 野村东方国<br>际证券有限<br>公司 | 2  | - | - | - | - | - |
| 英大证券有<br>限责任公司       | 1  | - | - | - | - | - |
| 招商证券股<br>份有限公司       | 2  | - | - | - | - | - |
| 浙商证券股<br>份有限公司       | 1  | - | - | - | - | - |
| 中国国际金<br>融股份有限<br>公司 | 5  | - | - | - | - | - |
| 中国银河证<br>券股份有限<br>公司 | 2  | - | - | - | - | - |
| 中国中金财<br>富证券有限<br>公司 | 1  | - | - | - | - | - |
| 中航证券有<br>限公司         | 1  | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股<br>份有限公司       | 5  | - | - | - | - | - |
| 中信证券股<br>份有限公司       | 10 | - | - | - | - | - |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 中信证券华南股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

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. 华宝证券有限责任公司更名为华宝证券股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：国元证券股份有限公司退租交易单元 1 个。

5. 报告期内，本基金新增以下交易单元：东方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 2 个，联储证券有限责任公司新增交易单元 2 个，信达证券股份有限公司新增交易单元 2 个，野村东方国际证券有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 3 个。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称         | 债券交易       |              | 债券回购交易       |                | 权证交易 |              |
|--------------|------------|--------------|--------------|----------------|------|--------------|
|              | 成交金额       | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额         | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 494,032.77 | 100.00%      | 1,100,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -          | -            | -            | -              | -    | -            |

|                      |   |   |   |   |   |   |
|----------------------|---|---|---|---|---|---|
| 安信证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华<br>证券有限<br>责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 渤海证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券<br>股份有限<br>公司   | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券<br>股份有限         | - | - | - | - | - | - |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 公司         |   |   |   |   |   |   |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 宏信证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华宝证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 联储证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 瑞银证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西部证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券       | - | - | - | - | - | - |



|                      |  |  |  |  |  |  |
|----------------------|--|--|--|--|--|--|
| 股份有限<br>公司           |  |  |  |  |  |  |
| 湘财证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 新时代证<br>券股份有<br>限公司  |  |  |  |  |  |  |
| 信达证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 兴业证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 野村东方<br>国际证券<br>有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 英大证券<br>有限责任<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 招商证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 浙商证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中国国际<br>金融股份<br>有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中国银河<br>证券股份<br>有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中国中金<br>财富证券<br>有限公司 |  |  |  |  |  |  |
| 中航证券<br>有限公司         |  |  |  |  |  |  |
| 中泰证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中信证券<br>股份有限<br>公司   |  |  |  |  |  |  |
| 中信证券                 |  |  |  |  |  |  |

|              |  |  |  |  |  |  |
|--------------|--|--|--|--|--|--|
| 华南股份有限公司     |  |  |  |  |  |  |
| 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修订旗下部分指数基金基金合同等法律文件的公告          | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年3月31日  |
| 2  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                        | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年5月29日  |
| 3  | 嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告                        | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年7月23日  |
| 4  | 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                | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年9月1日   |
| 5  | 关于嘉实中证金融地产 ETF 基金经理变更的公告                    | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年9月24日  |
| 6  | 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    | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年9月28日  |
| 7  | 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 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年11月16日 |
| 8  | 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      | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年12月3日  |
| 9  | 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  | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年12月3日  |
| 10 | 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信息的公告            | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年12月24日 |
| 11 | 嘉实基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的公告           | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021年12月30日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别  | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |               |               |               | 报告期末持有基金情况    |          |
|--|----------------|-------------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|----------|
|  | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额          | 申购份额          | 赎回份额          | 持有份额          | 份额占比 (%) |
| 联接基金   | 1              | 2021-01-01 至 2021-12-31 | 30,871,900.00 | 39,000,000.00 | 39,683,300.00 | 30,188,600.00 | 78.94    |
| 产品特有风险   |                |                         |               |               |               |               |          |
| <p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> |                |                         |               |               |               |               |          |

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证金融地产交易型开放式指数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