

嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合  
型证券投资基金（LOF）  
2020 年年度报告

2020 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：2021 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 2021 年 03 月 23 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 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
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>	9
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遵规守信情况的说明	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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	17
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	17
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	17
<b>§ 6 审计报告</b>	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	58
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	58
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	58
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	58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
8.12 投资组合报告附注	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
9.2 期末上市基金前十名持有人	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>61</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
11.4 基金投资策略的改变	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	70
<b>§ 12 备查文件目录</b>	<b>70</b>
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	嘉实战略配售混合
场内简称	嘉实配售（扩位场内简称：嘉实配售）
基金主代码	501189
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 7 月 5 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	11,958,679,771.96 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	2019 年 3 月 29 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>（一）封闭运作期内，本基金主要采用战略配售股票及固定收益投资两种投资策略，力争基金资产的长期稳定增值。</p> <p>具体包括：战略配售股票投资策略：本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素等四方面指标分析战略配售股票的投资机会，并通过综合分析行业生命周期、景气程度、估值水平以及股票市场行业轮动规律等因素，精选战略配售股票；固定收益资产投资策略。</p> <p>（二）转为上市开放式基金（LOF）后具体投资策略包括：</p> <p>资产配置策略（本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例）、股票投资策略（本基金将根据政策因素、宏观因素、估值因素、市场因素四方面指标，在本合同约定的投资比例范围内制定并适时调整国内 A 股和香港（港股通标的股票）两地股票配置比例及投资策略）、债券投资策略、中小企业私募债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略。</p>
业绩比较基准	封闭运作期业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×60% + 中债总全价指数收益率×40%
风险收益特征	封闭运作期风险收益特征：本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金以投资战略配售股票为投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。

## 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 负责人	姓名	胡勇钦	许俊
	联系电话	(010) 65215588	010-66594319
	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	100005	1000818
法定代表人	经雷	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	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年 7 月 5 日 (基金合同生效日) - 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	777,137,845.80	486,627,192.65	198,591,014.49
本期利润	1,450,967,540.02	515,257,288.77	235,092,378.01
加权平均基金份额 本期利润	0.1213	0.0431	0.0197
本期加权	10.98%	4.14%	1.95%

平均净值利润率			
本期基金份额净值增长率	11.41%	4.23%	1.97%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	1,462,554,526.54	685,358,331.80	198,591,014.49
期末可供分配基金份额利润	0.1223	0.0573	0.0166
期末基金资产净值	14,160,250,868.84	12,708,356,404.43	12,185,997,905.13
期末基金份额净值	1.1841	1.0628	1.0197
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	18.41%	6.28%	1.97%

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	5.88%	0.29%	8.47%	0.59%	-2.59%	-0.30%
过去六个月	10.03%	0.36%	14.29%	0.79%	-4.26%	-0.43%

过去一年	11.41%	0.36%	16.22%	0.84%	-4.81%	-0.48%
自基金合同生效起至今	18.41%	0.23%	34.00%	0.81%	-15.59%	-0.58%

注：本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$\text{Return}(t) = 60\% * (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 40\% * (\text{中债总全价指数}(t) / \text{中债总全价指数}(t-1) - 1)$

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

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

转为上市开放式基金 LOF 后，本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$\text{Return}(t) = 45\% * (\text{沪深300指数}(t) / \text{沪深300指数}(t-1) - 1) + 45\% * (\text{恒生指数}(t) / \text{恒生指数}(t-1) - 1) + 10\% * (\text{中债综合财富指数}(t) / \text{中债综合财富指数}(t-1) - 1)$

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

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

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

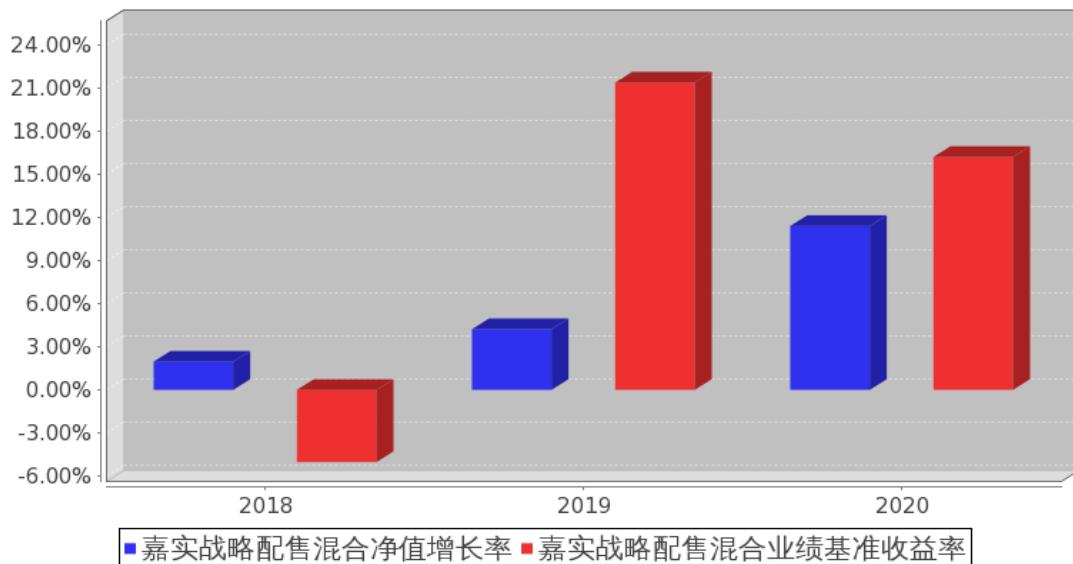
**嘉实战略配售混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**  
(2018年07月05日至2020年12月31日)



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

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

**嘉实战略配售混合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资格和特定资产管理业务资格。

截止2020年12月31日，基金管理人共管理205只开放式证券投资基金，其中包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数(QDII-LOF)、

嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面 120ETF、嘉实深证基本面 120ETF 联接、嘉实黄金（QDII-FOF-LOF）、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产（QDII）、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票（QDII）、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合（LOF）、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油（QDII-LOF）、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合（FOF）、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数（LOF）、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合（FOF）、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合（FOF）、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合（FOF）、嘉实致元

42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宁	本基金、嘉实增强信用定期债券、嘉实新起点混合、嘉实新财富混合、嘉实新起航混合、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实新添华定期混合、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实润泽量化定期混合、嘉实润和量化定期混合、嘉	2018 年 7 月 5 日	-	16 年	2004 年 5 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任债券专职交易员、年金组合组合控制员、投资经理助理、机构投资部投资经理，现任债券基金经理。经济学硕士，具有基金从业资格。

	实新添荣定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实致盈债券、嘉实新添元定期混合、嘉实新添益定期混合、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券基金经理				
王鑫晨	本基金、嘉实新添荣定期混合基金经理	2019 年 5 月 25 日	-	9 年	曾任 SPARX Group 、Citigroup Global Markets 研究员。2017 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司任行业研究员。本科，具有基金从业资格。
谭丽	本基金、嘉实价值优势混合、嘉实新消费股票、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实价值精选股票、嘉实价值发现三个月定期混合基金经理	2020 年 1 月 8 日	-	19 年	曾在北京海问投资咨询有限公司、国信证券股份有限公司及泰达荷银基金管理有限公司任研究员、基金经理助理职务。2007 年 9 月加入嘉实基金管理有限公司，曾任研究员、投资经理、策略组投资总监，现任基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格。

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金管理法》及其各项配套法规、《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息

披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

非常令人唏嘘的 2020 年过去了，再一次提醒，回顾历史不是要预测未来，而是让我们知道未来多么不确定，没有想到 2020 年人类社会遭遇的巨大不确定性来自于一场公共卫生危机，全球经济经历了二战以来最深的衰退，是人类百年不遇的劫难，人们的生活方式随之发生了很大的改变。

去年这个时候正值疫情爆发，时光飞逝，奇幻的一年过去了，疫情还在继续，一年前我们写道：“现阶段，常识和长钱最重要……此次波动可能制造出中期最好买点”，现在回过头看，我们

低估了疫情的持久性，与此相关联，我们也低估了流动性充裕的程度，表现在资本市场，就是显著低估了市场的涨幅，正确的是在高波动的上半年确实出现了极佳的买点，从那个低点至今，很多基金都实现了翻倍的收益，这种强烈的赚钱效应，也吸引了储蓄的大搬家，2020 年毫无疑问是一个基金大年，机构崛起，机构重仓股受到前所未有的追捧，也催生了结构性的估值泡沫。

回顾我们过去一年的股票投资策略，我们对经济的乐观在去年下半年创造了良好的收益，我们看好逆周期调节政策下，经济将会呈现的韧性，在 7 月份我们开始意识到海外需求的拉动，中国经济开启了强劲的复苏，之后每个月的宏观数据都在印证我们的判断，这种复苏不是传统的地产拉动，因而更加健康和持续，叠加海内外异常积极的货币以及财政政策，各国经济逐渐依次复苏，在这个过程中，中国的制造地位更加稳固，成为全世界的出口中心以及全球经济的拉动引擎，我们组合的配置策略始终是攻守兼备，我们一方面布局低估值的银行、地产行业的龙头公司，一方面在顺周期的行业和标的中积极布局，这个组合在上半年承受了较多的相对排名压力，我们无法接受上百倍 PE 的医疗、科技以及白酒，对于绝大多数科创板股票以及创业板龙头股票，我们只能敬而远之，尽管这些资产阶段性成为市场资金追捧的主流，我们相信股市短期是投票机，长期是称重器，我们坚持对安全边际的要求，我们不做趋势投资，甚至在辛苦的和市场作对，我们认为投资人逐渐成熟，作为理应更加理性的机构投资人，更应该约束自己的投资行为与投资纪律，我们始终立足于绝对收益，而不是相对排名。

我们股票重仓持有的可选消费以及制造业的周期成长股在 2020 年基本面逐渐转好，行业地位进一步提升，也同样受到了资金的追捧，上半年市场处于对经济的悲观预期，此类资产给出了非常好的介入价格，我们在这类资产上的加仓为组合做出了很大的贡献，当然有一些我们守候了多年的品种，逐渐被市场所认可，也获得了客观的涨幅，这再一次告诉我们，投资要耐得住寂寞，才能迎来繁华。

债券市场报告期内走出明显过山车行情，全年维度波动不大。节奏上，5 月之前主线是疫情下流动性极度宽松叠加经济衰退预期，债市走出波澜壮阔的牛市，随后市场主线在于货币政策预期重建，在经济复苏及政策边际收紧下开启长达数月调整，年末信用事件的蔓延在冲击后为债市带来小幅喘息。

报告期内继续构建按利率债+存单+高等级信用债为主的债券组合，报告期内增持高等级商业银行金融债以提高静态，整体久期中性，中等杠杆，永煤事件后组合通过利率债及中长期高等级信用债拉长久期。

#### 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 1.1841 元；本报告期基金份额净值增长率为 11.41%，业

绩比较基准收益率为 16.22%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

所有的配置策略都是基于对经济周期和市场周期的理解，站在今天，首先我们需要回答中国经济在 2021 年将处在经济周期的什么阶段，我们认为此轮复苏的持续性将超出预期，因为驱动力更加持续，我们将看到消费、服务和制造业投资的持续复苏，也会看到基建投资、房地产投资的韧性，我们会看到上游资源品以及中游工业品价格的抬升，也会看到终端消费品价格的上涨，当然我们最终还是要面对“逃不过的周期”，我们会始终保持对周期的敬畏之心。放一年甚至更长的时间维度，我们相信通胀预期可能导致长端利率上升，增加金融市场的波动，尤其考虑到 2020 年的货币大幅扩张，2021 年的核心是低利率能否持续。

股票行业配置上，我们始终保持攻守兼备的特点，结合自下而上精选个股，结合估值水平，我们在必需消费、医疗服务、科技等板块仍然会配置较少，会较 2020 年更加注重低估值的品种，主要在金融、地产、公用事业行业，也会更加重视低估值的中小盘股票，我们认为会存在一些收益率丰厚的机会，当然这需要我们努力去寻找，

第二我们需要回答市场处于什么周期，简单的说就是我们应该更加勇敢，还是更加谨慎，如果只看指数，我们认为这个位置是很低的，是可以更加勇敢的，但是如果看结构，就发现我们处在一个不那么好的周期位置，部分股票因为各种原因已经昂贵的不敢直视，抱团本身形成的是一个结构性的牛市，也是部分行业或个股较全市场而言的估值泡沫，关注点已不是抱团标的的业绩表现，而是资金的“避险”效应以及这类资金后续还有多少，价值投资者认为风险是和估值水平高度相关的，走到今天，最好的避险行为就是不抱团，引用大师的话“没有什么东西会在投资中完全重复，泡沫也不会，每一种形式的非理性繁荣都是不尽相同的，我们只能寻找一些所谓“相似的韵脚”。

我们认为 2021 年股票盈利的增长与估值的收缩将会并行，在未来的某个日期，我们会因为适当的撤离而得到奖励，我们希望能够在 2019、2020 年连续两年高收益的情况下，通过高质量的选股来继续获得一定的绝对收益，让复利得以持续。

本基金债券部分将继续构建按利率债+存单+高等级信用债为主的债券组合，同时 2021 年面临到期开放，在实现投资策略的同时提高组合债券资产流动性，以应对即将到来的年度开放，久期策略最优，其次杠杆策略，信用债进入二季度逐步减持。

#### 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。对于新产品、新业务，从战略规划到具体产品方案，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) 主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(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) 负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），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，未发现新增产品、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机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成合规报告和各项统计、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历。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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（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(2021)第 23520 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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）（以下简称“嘉实战略配售混合基金”）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 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 opinion 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</p>

	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,公允反映了嘉实战略配售混合基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于嘉实战略配售混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
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>嘉实战略配售混合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战略配售混合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战略配售混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实战略配售混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作</p>

	<p>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，就可能导致对嘉实战略配售混合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战略配售混合基金不能持续经营。</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	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
审计报告日期	2021 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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	950,369.71	953,435.28
结算备付金		131,812,242.62	160,854,123.40
存出保证金		450,269.58	71,980.50
交易性金融资产	7.4.7.2	18,324,669,240.23	14,727,887,106.73
其中：股票投资		4,351,205,240.23	1,025,150,306.73
基金投资		-	-
债券投资		13,973,464,000.00	13,702,736,800.00
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		433,465.39	499,746,247.59
应收利息	7.4.7.5	227,322,552.90	258,813,577.93

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		18, 685, 638, 140. 43	15, 648, 326, 471. 43
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<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		4, 519, 917, 195. 11	2, 937, 269, 799. 63
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1, 186, 065. 61	1, 074, 823. 44
应付托管费		355, 819. 69	322, 447. 04
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7. 4. 7. 7	527, 281. 47	78, 087. 91
应交税费		564, 925. 06	511, 671. 09
应付利息		2, 615, 984. 65	493, 237. 89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7. 4. 7. 8	220, 000. 00	220, 000. 00
负债合计		4, 525, 387, 271. 59	2, 939, 970, 067. 00
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7. 4. 7. 9	11, 958, 679, 771. 96	11, 957, 825, 493. 14
未分配利润	7. 4. 7. 10	2, 201, 571, 096. 88	750, 530, 911. 29
所有者权益合计		14, 160, 250, 868. 84	12, 708, 356, 404. 43
负债和所有者权益总计		18, 685, 638, 140. 43	15, 648, 326, 471. 43

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1841 元，基金份额总额 11, 958, 679, 771. 96 份。

## 7.2 利润表

会计主体：嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		1, 561, 806, 543. 83	605, 250, 518. 34
1. 利息收入		465, 611, 096. 17	544, 498, 930. 17
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 11	2, 771, 093. 80	2, 160, 970. 41

债券利息收入		462,746,792.97	542,296,317.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	29,483.96
证券出借利息收入		93,209.40	12,157.95
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		422,365,753.44	32,121,492.05
其中：股票投资收益	7.4.7.12	361,803,433.04	33,847,281.25
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-34,839,895.91	-2,691,741.72
资产支持证券投资收益		-	-
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	95,402,216.31	965,952.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	673,829,694.22	28,630,096.12
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	-	-
减：二、费用		110,839,003.81	89,993,229.57
1. 管理人报酬		13,196,744.84	12,454,755.01
2. 托管费		3,959,023.47	3,736,426.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,285,822.16	309,993.22
5. 利息支出		87,244,030.39	72,461,814.31
其中：卖出回购金融资产支出		87,244,030.39	72,461,814.31
6. 税金及附加		824,221.05	718,272.69
7. 其他费用	7.4.7.20	329,161.90	311,967.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,450,967,540.02	515,257,288.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,450,967,540.02	515,257,288.77

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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)	11,957,825,493.14	750,530,911.29	12,708,356,404.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,450,967,540.02	1,450,967,540.02
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)	854,278.82	72,645.57	926,924.39
其中：1. 基金申购款	854,278.82	72,645.57	926,924.39
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	11,958,679,771.96	2,201,571,096.88	14,160,250,868.84
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 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)	11,950,905,527.12	235,092,378.01	12,185,997,905.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	515,257,288.77	515,257,288.77
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)	6,919,966.02	181,244.51	7,101,210.53
其中：1. 基金申购款	6,919,966.02	181,244.51	7,101,210.53
2. 基金赎回款	-	-	-

回款			
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	11,957,825,493.14	750,530,911.29	12,708,356,404.43

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

罗丽丽

罗丽丽

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 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF) (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[2018]925 号《关于准予嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)注册的批复》核准，由嘉实基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。经向中国证监会备案，《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于 2018 年 7 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 11,950,905,527.12 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《证券投资基金管理业务指引》、《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金(LOF)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、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由

于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。本基金场外收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内收益分配方式为现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。每一基金份额享有同等分配权。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金管理流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金管理流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票

的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外), 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	950,369.71	953,435.28
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	950,369.71	953,435.28

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,599,042,591.59	4,351,205,240.23	752,162,648.64
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	3,017,030,868.59	2,999,791,200.00
	银行间市场	10,969,634,626.19	10,973,672,800.00
	合计	13,986,665,494.78	13,973,464,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	17,585,708,086.37	18,324,669,240.23	738,961,153.86
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,003,059,715.89	1,025,150,306.73	22,090,590.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,699,372,747.20	2,706,425,100.00
	银行间市场	10,960,323,184.00	10,996,311,700.00
	合计	13,659,695,931.20	13,702,736,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	14,662,755,647.09	14,727,887,106.73	65,131,459.64

#### 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 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	206.67	75,338.14

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	59,315.50	72,384.40
应收债券利息	227,262,828.13	258,653,665.04
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	-	12,157.95
其他	202.60	32.40
合计	227,322,552.90	258,813,577.93

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	397,151.38	15,744.50
银行间市场应付交易费用	130,130.09	62,343.41
合计	527,281.47	78,087.91

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019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	220,000.00	220,000.00
合计	220,000.00	220,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	11,957,825,493.14	11,957,825,493.14
本期申购	854,278.82	854,278.82
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	11,958,679,771.96	11,958,679,771.96

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	685,358,331.80	65,172,579.49	750,530,911.29
本期利润	777,137,845.80	673,829,694.22	1,450,967,540.02
本期基金份额交易产生的变动数	58,348.94	14,296.63	72,645.57
其中：基金申购款	58,348.94	14,296.63	72,645.57
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,462,554,526.54	739,016,570.34	2,201,571,096.88

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	511,617.66	467,187.85
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	2,247,758.55	1,690,201.54
其他	11,717.59	3,581.02
合计	2,771,093.80	2,160,970.41

#### 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 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	361,803,433.04	33,847,281.25
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	361,803,433.04	33,847,281.25

### 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 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
卖出股票成交总额	1,495,237,544.04	66,179,993.84
减：卖出股票成本总 额	1,133,434,111.00	32,332,712.59
买卖股票差价收入	361,803,433.04	33,847,281.25

### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	-34,839,895.91	-2,691,741.72
债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	-34,839,895.91	-2,691,741.72

#### 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 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	11,168,325,126.03	12,424,008,179.73
减：卖出债券（、债转股 及债券到期兑付）成本总 额	10,943,696,830.69	12,110,165,037.15
减：应收利息总额	259,468,191.25	316,534,884.30

买卖债券差价收入	-34,839,895.91	-2,691,741.72
----------	----------------	---------------

#### 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。

#### 7.4.7.14 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 2020年1月1日至2020年12月31 日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31 日
股票投资产生的股利收	95,402,216.31	965,952.52

益		
其中：证券出借权益补偿收入	91,780.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	95,402,216.31	965,952.52

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间
		2019年1月1日至2019 年12月31日
1.交易性金融资产	673,829,694.22	28,630,096.12
股票投资	730,072,057.80	23,468,917.79
债券投资	-56,242,363.58	5,161,178.33
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	673,829,694.22	28,630,096.12

#### 7.4.7.18 其他收入

无。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间
		2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	5,201,422.16	234,963.71
银行间市场交易费用	84,400.00	75,029.51
合计	5,285,822.16	309,993.22

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间
		2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

银行划款手续费	71,961.90	54,767.92
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	329,161.90	311,967.92

#### 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

#### 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	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	13,196,744.84	12,454,755.01
其中：支付销售机构的客户维护费	3,381,044.04	3,729,223.29

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 0.10%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,959,023.47	3,736,426.42

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.03%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×0.03%/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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2020年1月1日至2020年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出	
中国银行股份有限公司	-	32,058,217.21	-	-	-	-
上年度可比期间						
2019年1月1日至2019年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出

-	-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---	---

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

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

无。

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

无。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019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 活期	950,369.71	511,617.66	953,435.28	467,187.85

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本期(2020年1月1日至2020年12月31日)，本基金未实施利润分配。

### 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

##### 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000895	双汇发展	2020年10月16日	2021年4月19日	非公开发行锁定	48.15	45.11	1,246,106	60,000,003.90	56,211,841.66	-
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新发未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300863	卡倍亿	2020年8月11日	2021年2月24日	新股锁定	18.79	103.22	3,421	64,280.59	353,115.62	-
300864	南大环境	2020年8月13日	2021年2月25日	新股锁定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300872	天阳科技	2020年8月14日	2021年2月25日	新股锁定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300884	狄耐克	2020年11月5日	2021年5月12日	新股锁定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-

300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股锁定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新股锁定	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-

300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股锁定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300925	法本信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股锁定	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新发未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新发未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15 日	新股锁定	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
601816	京沪高铁	2020 年 1 月 8 日	2021 年 1 月 21 日	战略配售新股锁定	4.88	5.62	102,459,016	499,999,998.08	575,819,669.92	-

605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新发未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688127	蓝特光学	2020 年 9 月 14 日	2021 年 3 月 22 日	新股锁定	15.41	33.60	5,322	82,012.02	178,819.20	-
688129	东来技术	2020 年 10 月 15 日	2021 年 4 月 23 日	新股锁定	15.22	16.34	5,033	76,602.26	82,239.22	-
688165	埃夫特	2020 年 7 月 7 日	2021 年 1 月 15 日	新股锁定	6.35	13.10	28,728	182,422.80	376,336.80	-
688356	键凯科技	2020 年 8 月 17 日	2021 年 2 月 26 日	新股锁定	41.18	105.06	2,433	100,190.94	255,610.98	-
688551	科威尔	2020 年 9 月 1 日	2021 年 3 月 10 日	新股锁定	37.94	33.34	2,211	83,885.34	73,714.74	-
688571	杭华股份	2020 年 12 月 2 日	2021 年 6 月 11 日	新股锁定	5.33	7.92	8,200	43,706.00	64,944.00	-
688586	江航装备	2020 年 7 月 24 日	2021 年 2 月 1 日	新股锁定	10.27	30.20	16,436	168,797.72	496,367.20	-
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新发未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688668	鼎通科技	2020 年 12 月 11 日	2021 年 6 月 21 日	新股锁定	20.07	24.56	3,037	60,952.59	74,588.72	-
688981	中芯国际	2020 年 7 月 9 日	2021 年 1 月 18 日	新股锁定	27.46	56.57	462,175	12,691,325.50	26,145,239.75	-

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

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,229,917,195.11 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
042000276	20 国电 CP001	2021 年 1 月 4 日	99.63	1,404,000	139,880,520.00
101801418	18 长电 MTN001	2021 年 1 月 4 日	100.76	362,000	36,475,120.00
101900328	19 沪港务 MTN001	2021 年 1 月 4 日	100.74	1,000,000	100,740,000.00
101900611	19 沪港务 MTN002	2021 年 1 月 4 日	100.65	700,000	70,455,000.00
112003124	20 农业银行 CD124	2021 年 1 月 4 日	97.90	848,000	83,019,200.00
112005016	20 建设银行 CD016	2021 年 1 月 4 日	97.54	2,500,000	243,850,000.00
112009445	20 浦发银行 CD445	2021 年 1 月 4 日	97.86	1,000,000	97,860,000.00
112010123	20 兴业银行 CD123	2021 年 1 月 4 日	98.14	1,000,000	98,140,000.00
112010131	20 兴业银行 CD131	2021 年 1 月 4 日	98.09	1,846,000	181,074,140.00
112010315	20 兴业银行 CD315	2021 年 1 月 4 日	97.16	1,000,000	97,160,000.00
112015148	20 民生银行 CD148	2021 年 1 月 4 日	97.77	1,000,000	97,770,000.00
112015216	20 民生银行 CD216	2021 年 1 月 4 日	97.99	1,000,000	97,990,000.00
112018125	20 华夏银行	2021 年 1 月 4	98.09	1,000,000	98,090,000.00

	行 CD125	日			
170210	17 国开 10	2021 年 1 月 4 日	103.29	200,000	20,658,000.00
180204	18 国开 04	2021 年 1 月 4 日	103.66	910,000	94,330,600.00
180208	18 国开 08	2021 年 1 月 4 日	100.49	1,000,000	100,490,000.00
180212	18 国开 12	2021 年 1 月 4 日	100.86	500,000	50,430,000.00
180409	18 农发 09	2021 年 1 月 4 日	100.71	1,000,000	100,710,000.00
190006	19 附息国 债 06	2021 年 1 月 4 日	100.52	400,000	40,208,000.00
190015	19 附息国 债 15	2021 年 1 月 4 日	99.34	200,000	19,868,000.00
190016	19 附息国 债 16	2021 年 1 月 4 日	100.16	300,000	30,048,000.00
190202	19 国开 02	2021 年 1 月 4 日	100.46	175,000	17,580,500.00
190203	19 国开 03	2021 年 1 月 4 日	100.69	436,000	43,900,840.00
190207	19 国开 07	2021 年 1 月 4 日	100.59	740,000	74,436,600.00
190209	19 国开 09	2021 年 1 月 4 日	100.54	400,000	40,216,000.00
190214	19 国开 14	2021 年 1 月 4 日	100.19	300,000	30,057,000.00
190409	19 农发 09	2021 年 1 月 4 日	100.26	500,000	50,130,000.00
200006	20 附息国 债 06	2021 年 1 月 4 日	95.99	211,000	20,253,890.00
200012	20 附息国 债 12	2021 年 1 月 4 日	101.51	183,000	18,576,330.00
200203	20 国开 03	2021 年 1 月 4 日	100.22	314,000	31,469,080.00
200206	20 国开 06	2021 年 1 月 4 日	99.58	500,000	49,790,000.00
200207	20 国开 07	2021 年 1 月 4 日	100.11	2,200,000	220,242,000.00
200208	20 国开 08	2021 年 1 月 4 日	98.67	3,850,000	379,879,500.00
200210	20 国开 10	2021 年 1 月 4 日	95.90	780,000	74,802,000.00
200212	20 国开 12	2021 年 1 月 4	100.57	1,400,000	140,798,000.00

		日			
200215	20 国开 15	2021 年 1 月 4 日	101.36	1,700,000	172,312,000.00
200404	20 农发 04	2021 年 1 月 4 日	94.71	1,400,000	132,594,000.00
200210	20 国开 10	2021 年 1 月 6 日	95.90	935,000	89,666,500.00
合计				35,194,000	3,485,950,820.00

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,290,000,000.00 元，于 2021 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。封闭运作期内，本基金以投资战略配售股票为投资策略，需参与并接受发行人战略配售股票，由此产生的投资风险与价格波动由投资者自行承担。转为上市开放式基金(LOF)后，本基金将投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。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面临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在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和风险管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法

去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日	
A-1	289,025,000.00		-
A-1 以下	-		-
未评级	199,860,000.00		-
合计	488,885,000.00		-

注：评级取自第三方评级机构。

##### 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	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
AAA	7,723,211,900.00	6,961,847,100.00
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	7,723,211,900.00	6,961,847,100.00

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
AAA	2,572,321,000.00	4,559,974,000.00
AAA 以下	—	—
未评级	—	—
合计	2,572,321,000.00	4,559,974,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

#### 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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完

全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

###### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	950,369.71	-	-	-	950,369.71
结算备付金	131,812,242.62	-	-	-	131,812,242.62
存出保证金	450,269.58	-	-	-	450,269.58
交易性金融资 产	8,836,610,200.00	4,119,596,800.00	1,017,257,000.00	4,351,205,240.23	18,324,669,240.23
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	433,465.39	433,465.39
应收利息	-	-	-	227,322,552.90	227,322,552.90
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,969,823,081.91	4,119,596,800.00	1,017,257,000.00	4,578,961,258.52	18,685,638,140.43
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	4,519,917,195.11	-	-	-	4,519,917,195.11
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,186,065.61	1,186,065.61
应付托管费	-	-	-	355,819.69	355,819.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	527,281.47	527,281.47
应付税费	-	-	-	564,925.06	564,925.06
应付利息	-	-	-	2,615,984.65	2,615,984.65
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	220,000.00	220,000.00
负债总计	4,519,917,195.11	-	-	5,470,076.48	4,525,387,271.59
利率敏感度缺口	4,449,905,886.80	4,119,596,800.00	1,017,257,000.00	4,573,491,182.04	14,160,250,868.84
上年度末 2019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	953,435.28	-	-	-	953,435.28
结算备付金	160,854,123.40	-	-	-	160,854,123.40
存出保证金	71,980.50	-	-	-	71,980.50
交易性金融资	6,455,970,000.00	6,674,562,400.00	572,204,400.00	1,025,150,306.73	14,727,887,106.73

产						
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	499,746,247.59	499,746,247.59	
应收利息	-	-	-	258,813,577.93	258,813,577.93	
应收股利	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	6,617,849,539.18	6,674,562,400.00	572,204,400.00	1,783,710,132.25	15,648,326,471.43	
负债						
短期借款	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,937,269,799.63	-	-	-	2,937,269,799.63	
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,074,823.44	1,074,823.44	
应付托管费	-	-	-	322,447.04	322,447.04	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	78,087.91	78,087.91	
应付税费	-	-	-	511,671.09	511,671.09	
应付利息	-	-	-	493,237.89	493,237.89	
应付利润	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	220,000.00	220,000.00	
负债总计	2,937,269,799.63	-	-	2,700,267.37	2,939,970,067.00	
利率敏感度缺口	3,680,579,739.55	6,674,562,400.00	572,204,400.00	1,781,009,864.88	12,708,356,404.43	

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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	市场利率上升 25 个基点	-53,082,954.69	-44,980,082.88
	市场利率下降 25 个基点	53,845,274.98	45,455,680.72

#### 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

无。

#### 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 2020年12月31日		上年度末 2019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	4,351,205,240.23	30.73	1,025,150,306.73	8.07
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	4,351,205,240.23	30.73	1,025,150,306.73	8.07

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额 (单位: 人民币元)	
分析		本期末 (2020 年 12 月 31 日)	上年度末 (2019 年 12 月 31 日)
业绩比较基准上升 5%	266,917,268.60	-	
业绩比较基准下降 5%	-266,917,268.60	-	

注: 于 2019 年 12 月 31 日, 本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 8.07%, 因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 3,689,149,396.64 元，属于第二层次的余额为 14,635,519,843.59 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 34,131,130.63 元，第二层次 14,693,755,976.10 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) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 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	4,351,205,240.23	23.29
	其中：股票	4,351,205,240.23	23.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,973,464,000.00	74.78
	其中：债券	13,973,464,000.00	74.78
	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	132,762,612.33	0.71

8	其他各项资产	228,206,287.87	1.22
9	合计	18,685,638,140.43	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,695,748,781.62	11.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	153,176,832.00	1.08
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	113,325,744.80	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	723,191,621.29	5.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	227,214.77	0.00
J	金融业	1,368,906,182.15	9.67
K	房地产业	296,613,782.50	2.09
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	15,081.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,351,205,240.23	30.73

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601658	邮储银行	177,311,000	847,546,580.00	5.99
2	601816	京沪高铁	102,459,016	575,819,669.92	4.07
3	600031	三一重工	10,901,287	381,327,019.26	2.69
4	600036	招商银行	7,672,037	337,186,026.15	2.38
5	000002	万科A	10,334,975	296,613,782.50	2.09

6	002925	盈趣科技	4,529,583	291,388,074.39	2.06
7	601633	长城汽车	6,624,881	250,486,750.61	1.77
8	300628	亿联网络	2,707,257	197,954,631.84	1.40
9	601166	兴业银行	8,824,800	184,173,576.00	1.30
10	600426	华鲁恒升	4,289,150	159,985,295.00	1.13
11	600886	国投电力	17,728,800	153,176,832.00	1.08
12	601021	春秋航空	2,658,343	147,351,952.49	1.04
13	600309	万华化学	1,597,136	145,403,261.44	1.03
14	000963	华东医药	4,266,168	113,309,422.08	0.80
15	000895	双汇发展	2,244,706	103,086,125.66	0.73
16	600176	中国巨石	3,984,237	79,525,370.52	0.56
17	603866	桃李面包	850,496	50,264,313.60	0.35
18	688981	中芯国际	462,175	26,145,239.75	0.18
19	300083	创世纪	370,100	4,359,778.00	0.03
20	688063	派能科技	5,499	1,422,151.38	0.01
21	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.01
22	688686	奥普特	2,330	505,144.00	0.00
23	688586	江航装备	16,436	496,367.20	0.00
24	688165	埃夫特	28,728	376,336.80	0.00
25	300863	卡倍亿	3,421	353,115.62	0.00
26	300896	爱美客	473	285,389.28	0.00
27	688356	键凯科技	2,433	255,610.98	0.00
28	688127	蓝特光学	5,322	178,819.20	0.00
29	300925	法本信息	3,528	162,719.99	0.00
30	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
31	688129	东来技术	5,033	82,239.22	0.00
32	688668	鼎通科技	3,037	74,588.72	0.00
33	688551	科威尔	2,211	73,714.74	0.00
34	688571	杭华股份	8,200	64,944.00	0.00
35	688618	三旺通信	1,117	59,938.22	0.00
36	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
37	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
38	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
39	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
40	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
41	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
42	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
43	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
44	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
45	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
46	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
47	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00

48	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
49	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
50	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
51	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
52	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
53	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
54	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
55	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
56	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
57	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
58	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
59	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
60	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
61	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
62	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
63	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
64	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601816	京沪高铁	499,999,998.08	3.93
2	000002	万科A	306,726,469.29	2.41
3	600036	招商银行	289,715,433.61	2.28
4	002925	盈趣科技	288,070,381.35	2.27
5	600309	万华化学	208,378,535.06	1.64
6	000895	双汇发展	190,462,604.88	1.50
7	601166	兴业银行	190,431,169.71	1.50
8	601633	长城汽车	184,745,694.82	1.45
9	600031	三一重工	180,800,299.69	1.42
10	600426	华鲁恒升	179,828,390.37	1.42
11	601021	春秋航空	151,165,432.67	1.19
12	300628	亿联网络	149,581,568.87	1.18
13	600886	国投电力	148,650,594.18	1.17
14	000651	格力电器	147,660,419.85	1.16
15	603866	桃李面包	130,042,038.25	1.02
16	600583	海油工程	110,146,509.48	0.87
17	000963	华东医药	101,036,979.06	0.80
18	600298	安琪酵母	89,819,042.28	0.71
19	600176	中国巨石	74,919,009.44	0.59
20	603129	春风动力	61,708,930.72	0.49

### 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	601633	长城汽车	220,676,010.82	1.74
2	600298	安琪酵母	168,045,852.77	1.32
3	600309	万华化学	157,707,559.35	1.24
4	000895	双汇发展	153,315,665.89	1.21
5	600426	华鲁恒升	144,631,525.74	1.14
6	000651	格力电器	142,874,643.58	1.12
7	603866	桃李面包	139,363,261.05	1.10
8	600583	海油工程	79,582,369.79	0.63
9	603129	春风动力	62,002,063.23	0.49
10	002925	盈趣科技	52,538,184.00	0.41
11	601021	春秋航空	39,810,948.13	0.31
12	601166	兴业银行	24,021,788.00	0.19
13	600176	中国巨石	19,644,253.61	0.15
14	300999	金龙鱼	4,994,552.86	0.04
15	688396	华润微	4,163,398.73	0.03
16	000786	北新建材	3,840,783.00	0.03
17	600585	海螺水泥	3,760,765.00	0.03
18	688185	康希诺	3,620,755.62	0.03
19	000333	美的集团	3,233,733.40	0.03
20	002415	海康威视	2,858,456.56	0.02

### 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	3,729,416,986.70
卖出股票收入（成交）总额	1,495,237,544.04

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	312,005,000.00	2.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,640,444,600.00	32.77
	其中：政策性金融债	2,877,041,100.00	20.32
4	企业债券	1,961,184,700.00	13.85
5	企业短期融资券	488,885,000.00	3.45
6	中期票据	3,998,623,700.00	28.24
7	可转债（可交换债）	-	-

8	同业存单	2,572,321,000.00	18.17
9	其他	-	-
10	合计	13,973,464,000.00	98.68

**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	200208	20 国开 08	3,850,000	379,879,500.00	2.68
2	200210	20 国开 10	2,800,000	268,520,000.00	1.90
3	200203	20 国开 03	2,600,000	260,572,000.00	1.84
4	112005016	20 建设银行 CD016	2,500,000	243,850,000.00	1.72
5	200215	20 国开 15	2,400,000	243,264,000.00	1.72

**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) 2020 年 3 月 18 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚决定书（银保监罚决字（2020）2 号），对中国邮政储蓄银行股份有限公司因可回溯制度执行不到位、可回溯基础管理不到位、未传递或缺失可回溯视频资料、质检不合格业务占比较高等行为，违反了《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条，根据该法第四十六条规定，于 2020 年 3 月 9 日作出行政处罚决定，对邮储银行总行罚款 50 万元；因欺骗投保人的行为，违反了《中华人民共和国保险法》第一百三十三条规定，根据该法第一百六十五条规定，于 2020 年 3 月 9 日作出行政处罚决定，对邮储银行如东县支行罚款 30 万元。2020 年 5 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会发布行政处罚信息公开表（银保监罚决字（2020）10 号），对中国邮政储蓄银行股份有限公司在邮储银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送过程中，资金交易信息漏报严重、贸易融资业务漏报、分户账账户数据应报未报、关键且应报字段漏报或填报错误等违法违规行为，于 2020 年 4 月 20 日作出行政处罚决定，罚款合计 190 万元。

本基金投资于“邮储银行（601658）”的决策程序说明：基于对邮储银行基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“邮储银行”股票的决策流程，符合公司投资管理制度的相关规定。

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

### 8.12.2 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	450,269.58
2	应收证券清算款	433,465.39
3	应收股利	-
4	应收利息	227,322,552.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	228,206,287.87

### 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

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	601816	京沪高铁	575,819,669.92	4.07	战略配售新股锁定

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
315,563	37,896.33	4,659,389,119.00	38.96	7,299,290,652.96	61.04

### 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	全国社保基金一零零二组合	71,226,165.00	7.27
2	中广核财务有限责任公司	63,813,488.00	6.51
3	基本养老保险基金一零五组合	49,834,497.00	5.08
4	中国工商银行股份有限公司企业年金计划—中国建设银行1	32,000,000.00	3.26
5	中国建设银行股份有限公司—汇添富养老目标日期2030三年持有期混合型基金中基金（	30,711,070.00	3.13
6	工银瑞信添颐混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	28,173,884.00	2.87
7	深圳市恒泰融安投资管理有限公司—创弘价值精选FOF私募基金	28,000,000.00	2.86

8	中国建设银行股份有限公司一兴全安泰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)	27,959,002.00	2.85
9	汇添富基金—南京银行—汇添富旗舰 FOF19 号集合资产管理计划	21,977,217.00	2.24
10	工银瑞信添泰混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	21,154,779.00	2.16

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	4,454,868.42	0.04

### 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	>=100
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(2018年7月5日)基金份额总额	11,950,905,527.12
本报告期期初基金份额总额	11,957,825,493.14
本报告期基金总申购份额	854,278.82
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	11,958,679,771.96

## § 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

2020 年 4 月 8 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》，宋

振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020 年 5 月 6 日日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020 年 6 月 19 日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》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

2020 年 1 月 8 日日本基金管理人发布《关于增聘嘉实战略配售混合基金经理的公告》，聘请谭丽女士担任本基金基金经理，与刘宁女士、王鑫晨先生共同管理本基金。

#### (2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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 100,000.00 元，该审计机构已连续 3 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

### 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	
民生证券股 份有限公司	2	510,014,011.77	11.03%	357,010.66	11.38%	-

中国国际金融股份有限公司	5	489,566,635.44	10.59%	309,062.04	9.85%	-
国泰君安证券股份有限公司	3	433,435,077.58	9.38%	303,407.04	9.67%	-
广发证券股份有限公司	4	406,805,256.75	8.80%	284,764.55	9.08%	-
方正证券股份有限公司	5	385,021,207.71	8.33%	269,514.79	8.59%	-
东吴证券股份有限公司	3	382,709,013.89	8.28%	241,603.38	7.70%	-
招商证券股份有限公司	2	374,179,079.48	8.09%	261,925.35	8.35%	-
华创证券有限责任公司	2	355,386,276.82	7.69%	248,771.19	7.93%	-
海通证券股份有限公司	3	354,203,290.06	7.66%	247,942.30	7.90%	-
天风证券股份有限公司	2	259,456,278.23	5.61%	163,801.14	5.22%	-
西部证券股份有限公司	2	225,484,511.38	4.88%	142,348.84	4.54%	-
国元证券股份有限公司	1	163,514,670.93	3.54%	114,460.25	3.65%	-
国金证券股份有限公司	2	85,427,182.19	1.85%	59,799.04	1.91%	-
华泰证券股份有限公司	5	82,909,232.05	1.79%	52,339.45	1.67%	-
浙商证券股	1	56,264,265.02	1.22%	39,384.98	1.26%	-

份有限公司						
安信证券股 份有限公司	3	42,605,438.42	0.92%	29,823.82	0.95%	-
长江证券股 份有限公司	2	16,284,589.00	0.35%	11,399.17	0.36%	-
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 份有限公司	3	-	-	-	-	-
东北证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
光大证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国海证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
宏信证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
华福证券有	1	-	-	-	-	-

限责任公司						
华西证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
平安证券股 份有限公司	4	-	-	-	-	-
瑞银证券有 限责任公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源证 券有限公司	3	-	-	-	-	-
西南证券股 份有限公司	2	-	-	-	-	-
湘财证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
新时代证券 股份有限公 司	2	-	-	-	-	-
信达证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	3	-	-	-	-	-
英大证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	2	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券有限 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券有	1	-	-	-	-	-

限公司						
中泰证券股 份有限公司	5	-	-	-	-	-
中信建投证 券股份有限 公司	4	-	-	-	-	-
中信证券股 份有限公司	7	-	-	-	-	-
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. 广州证券股份有限公司更名为中信证券华南股份有限公司。

4. 报告期内，本基金退租以下交易单元：天源证券经纪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：海通证券股份有限公司新增交易单元 1 个，中泰证券股份有限公司新增交易单元 1 个，华西证券股份有限公司新增交易单元 2 个。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的	成交金额	占当期债券 回购	成交金额	占当期权 证

		比例		成交总额的 比例		成交总额 的比例
民生证券 股份有限 公司	—	—	8,452,000,000.00	2.69%	—	—
中国国际 金融股份 有限公司	30,147,042.00	3.29%	52,194,200,000.00	16.59%	—	—
国泰君安 证券股份 有限公司	50,000,000.00	5.45%	—	—	—	—
广发证券 股份有限 公司	—	—	—	—	—	—
方正证券 股份有限 公司	—	—	46,619,000,000.00	14.82%	—	—
东吴证券 股份有限 公司	—	—	3,400,000,000.00	1.08%	—	—
招商证券 股份有限 公司	—	—	45,173,200,000.00	14.36%	—	—
华创证券 有限责任 公司	—	—	25,953,000,000.00	8.25%	—	—
海通证券 股份有限 公司	—	—	23,599,000,000.00	7.50%	—	—
天风证券 股份有限 公司	—	—	12,303,000,000.00	3.91%	—	—
西部证券 股份有限 公司	—	—	19,653,000,000.00	6.25%	—	—
国元证券 股份有限 公司	—	—	39,923,200,000.00	12.69%	—	—
国金证券 股份有限 公司	—	—	5,400,000,000.00	1.72%	—	—
华泰证券 股份有限 公司	836,803,900.00	91.26%	12,219,000,000.00	3.88%	—	—

浙商证券股份有限公司		-16,113,000,000.00	5.12%		
安信证券股份有限公司		-3,562,000,000.00	1.13%		
长江证券股份有限公司					
北京高华证券有限责任公司					
渤海证券股份有限公司					
长城证券股份有限公司					
东北证券股份有限公司					
东方证券股份有限公司					
东兴证券股份有限公司					
光大证券股份有限公司					
国海证券股份有限公司					
国信证券股份有限公司					
宏信证券有限责任公司					
华宝证券有限责任公司					
华福证券有限责任					

公司						
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
英大证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	关于嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基⾦(LOF)第三个受限开放期开放申购业务的公告	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	2020 年 01 ⽉ 02 ⽇
2	关于增聘嘉实战略配售混合基⾦经理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基⾦电子披露网站	2020 年 01 ⽉ 08 ⽇
3	嘉实基⾦管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基⾦信息披露管理办法》修改旗下部分基金基⾦合同及托管协议的公告	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	2020 年 01 ⽉ 22 ⽇
4	嘉实基⾦管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基⾦增加扩位证券简称的公告	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	2020 年 03 ⽉ 16 ⽇
5	关于嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基⾦(LOF)第四个受限开放期开放申购业务的公告	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	2020 年 07 ⽉ 02 ⽇
6	嘉实基⾦管理有限公司关于修订旗下部分基金基⾦合同及托管协议的公告	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	2020 年 10 ⽉ 17 ⽇
7	嘉实基⾦管理有限公司关于旗下基金投资双汇发展非公开发行股票的公告	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	2020 年 10 ⽉ 17 ⽇
8	关于嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基⾦(LOF)第五个受限开放期开放申购业务的公告	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	2020 年 12 ⽉ 31 ⽇

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基⾦注册的批复文

件；

- (2)《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- (3)《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- (4)《嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- (5)基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6)报告期内嘉实 3 年封闭运作战略配售灵活配置混合型证券投资基金公告的各项原稿。

## 12.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

## 12.3 查阅方式

- (1)书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。
- (2)网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>  
投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:[service@jsfund.cn](mailto:service@jsfund.cn)。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日