

嘉实海外中国股票混合型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经由全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 境外资产托管人.....	5
2.5 信息披露方式.....	6
2.6 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	40
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	40

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	41
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	46
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	46
7.11 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8 其他重大事件	56
§11 备查文件目录	56
11.1 备查文件目录	56
11.2 存放地点	57
11.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实海外中国股票混合型证券投资基金
基金简称	嘉实海外中国股票混合(QDII)
基金主代码	070012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年10月12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	2,917,574,402.73份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分散投资风险，获取中长期稳定收益
投资策略	本基金基于对宏观经济形势、财政/货币政策、以及相关股票市场等因素的综合分析和预测，进行自上而下的资产配置，和自下而上的精选投资品种。具体策略包括：大类资产配置、股票投资的板块/行业配置、证券选择、币种配置及外汇管理。
业绩比较基准	MSCI 中国指数
风险收益特征	较高风险、较高收益

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
	联系电话	(010)65215588
	电子邮箱	service@jsfund.cn
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 境外资产托管人

项目	境外资产托管人
----	---------

名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行(香港)有限公司
注册地址	香港花园道1号中银大厦	
办公地址	香港花园道1号中银大厦	
邮政编码	-	

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层嘉实基金管理有限公司

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉实基金管理有限公司	北京市朝阳区建国门外大街21号北京国际俱乐部C座写字楼12A层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	253,204,663.76
本期利润	-124,652,094.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0395
本期加权平均净值利润率	-3.39%
本期基金份额净值增长率	-4.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	243,949,898.32
期末可供分配基金份额利润	0.0836
期末基金资产净值	3,237,087,330.78
期末基金份额净值	1.110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.18%

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

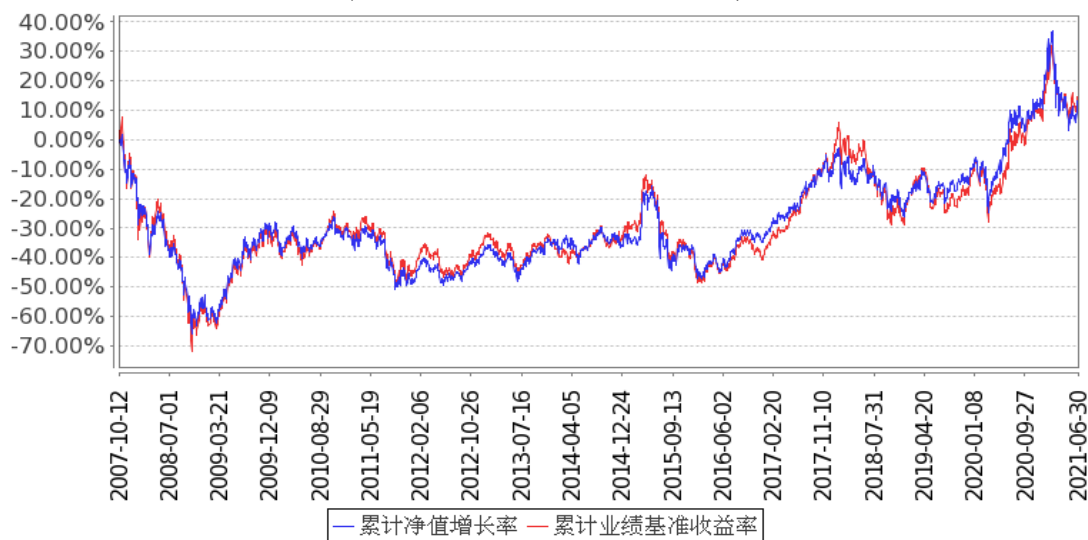
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	1.28%	1.12%	-0.30%	0.94%	1.58%	0.18%
过去三个月	-0.45%	1.25%	1.41%	1.07%	-1.86%	0.18%
过去六个月	-4.40%	1.82%	1.23%	1.47%	-5.63%	0.35%
过去一年	12.31%	1.62%	25.74%	1.44%	-13.43%	0.18%
过去三年	26.49%	1.42%	25.84%	1.41%	0.65%	0.01%
自基金合同生效起至今	11.18%	1.53%	13.62%	1.71%	-2.44%	-0.18%

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

嘉实海外中国股票混合(QDII)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

(2007年10月12日至2021年06月30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。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为嘉实基金管理有限公司，成立于1999年3月25日，是经中国证监会批准设立的第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，公司总部设在北京，在北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉设有分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人和QDII、特定资产管理业务资格。

截止2021年6月30日，基金管理人共管理223只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接(LOF)、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合(QDII)、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数(LOF)、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数(QDII-LOF)、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基本面120ETF联

接、嘉实黄金(QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创400ETF、嘉实中创400ETF联接、嘉实沪深300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产(QDII)、嘉实纯债债券、嘉实中证500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证500ETF联接、嘉实中证中期国债ETF、嘉实中证金边中期国债ETF联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票(QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费ETF、嘉实中证医药卫生ETF、嘉实中证金融地产ETF、嘉实3个月理财债券、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深300指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产ETF联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合(LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安6个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油(QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村A股ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实6个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国A50ETF联接、嘉实富时中国A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合(FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数(LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老2040混合(FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实中债1-3政金债指数、嘉实养老2050混合(FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老2030混合(FOF)、嘉实致元42个月定期债券、嘉实沪深300红利低波动ETF、嘉实新添益定期混合、嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动ETF、嘉实新兴科技100ETF、嘉

实致安3个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技100ETF联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动ETF联接、嘉实致禄3个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造100ETF、嘉实沪深300红利低波动ETF联接、嘉实安元39个月定期纯债债券、嘉实中债3-5年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证500指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁3个月定期纯债债券、嘉实中证500成长估值ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费ETF联接、嘉实医药健康100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实H股50ETF(QDII)、嘉实浦惠6个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债1-5年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠6个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合、嘉实民安添岁稳健养老一年持有期混合(FOF)、嘉实港股优势混合、嘉实睿享安久双利18个月持有期债券、嘉实中证沪港深互联网ETF、嘉实中证软件服务ETF、嘉实品质回报混合、嘉实创业板两年定期混合、嘉实竞争力优选混合、嘉实浦盈一年持有期混合、嘉实中证稀土产业ETF、嘉实阿尔法优选混合、嘉实中证大农业ETF、嘉实匠心回报混合、嘉实医药健康100ETF联接、嘉实价值臻选混合、嘉实品质优选股票、嘉实恒生科技ETF(QDII)、嘉实丰年一年定期纯债债券、嘉实领先优势混合、嘉实中证科创创业50ETF、嘉实养老目标日期2045五年持有期混合(FOF)、嘉实优势精选混合。其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时,基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋茜	本基金、嘉实原油(QDII-LOF)基金经理	2015年10月24日	-	23年	曾任上海申银证券机构销售部及国际部交易员、LG securities (HK) Co., Ltd 研究员、上海沪光国际资产管理(香港)有限公司基金经理助理、德意志资产管理(香港)有限公司基金经理。2009年9月加入嘉实国际资产管理有限公司。硕士研究生,具有基金从业资格,中国香港籍。
陈叶雁南	本基金基金经理	2019年8月23日	-	16年	曾于华盛顿哥伦比亚特区的Pepco Energy Services任职,负责财务规划及参与能源

					衍生工具买卖。曾任东方汇理资产管理大中华投资经理。于2015年9月加入嘉实国际，担任投资经理及股票研究团队主管。硕士研究生，特许金融分析师（CFA），中国国籍。
--	--	--	--	--	--

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

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

（3）2021年7月24日，本基金管理人发布《关于嘉实海外中国股票混合（QDII）基金经理变更的公告》，增聘胡宇飞先生担任本基金基金经理，蒋一茜女士、陈叶雁南女士不再担任本基金基金经理，本基金由胡宇飞先生单独管理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；通过IT系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

大中华区股市在2021年上半年小幅上涨，MSCI中国净收益（美元计）指数涨1.8%，但海外中资股（美元计）因国内外政策因素影响而下跌6.4%，拖累市场整体表现。

新冠疫苗部署及美国持续扩大的财政刺激方案在新年伊始为全球市场带来乐观情绪，带动大中华区股市不断上涨。但对全球经济活动恢复正常的乐观憧憬迅速演变为对通胀飙涨以及货币政策收紧的担忧。中国股票自2月春节假期后反复回落，并在上半年随后时间呈区间震荡格局。

在全球主要经济体中，中国经济最早自新冠疫情中复苏，然而宏观经济指标如社会消费品零售及工业生产的增速因基数效应及广东疫情扰动而逐步自高位回落。同时，虽然中国承诺宏观政策不急转弯，但宏观政策正常化的过程为市场带来一定扰动。4月底举行的中国中央政治局会议强调复苏不均衡、基础不稳固，在一定程度上缓解了市场对宏观政策收紧的过度忧虑。在经济复苏势头放缓及宏观政策不及欧美宽松的背景下，大中华区股市上半年整体表现不强。海外中资股同时因国内外政策而受压。在国际层面，中美地缘政治摩擦持续，不利市场气氛。在国内，互联网平台反垄断及校外培训监管加强，也拖累海外中资股表现。

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1.110元；本报告期基金份额净值增长率为-4.40%，业绩比较基准收益率为1.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管市场不时担忧中国宏观政策收紧，但对中国不利的宏观经济环境有望在下半年消退。中国央行宣布执行全面降准0.5个百分点，货币政策呈现边际宽松取向，有利于保护商业银行利差，支持小微企业，以及化解地方政府隐性债务风险。中国宏观政策在下半年仍有微调空间，以应对宏观经济可能面对的不利因素。除了近期中国央行宣布的降准措施外，中国财政政策在上半年保持节制，在下半年也有发力空间。而从中长期来看，中国良好的疫情管控、领先于全球的经济增长，以及稳健的宏观政策为中国资产带来优势。

在外部环境方面，随着全球供应逐步恢复，大宗商品价格上涨压力有望逐步缓解。与此同时，美联储鹰派信号或被市场过分解读。在美国经济复苏势头放缓、就业市场仍未完全恢复的背景下，投资经理预期美联储仍将持续维持低息环境，为全球流动性带来支撑。面对短期市场波动，投资经理将依附于中国在消费升级与产业升级方面的长期成长机遇。在细分行业领域，运动品牌/服装、食品饮料、出口相关、硬件/软件科技以及新能源公司不仅不受行业反垄断监管打击，反而受益于双循环、科技自主及碳中和等长期国家战略。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金实施了利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“6.4.11 利润分配情况”。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在嘉实海外中国股票混合型证券投资基金（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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	184,560,798.40	295,397,545.28
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,917,623,698.54	3,902,112,449.95
其中：股票投资		2,917,623,698.54	3,621,766,734.37
基金投资		-	280,345,715.58
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		148,166,899.08	-
应收利息	6.4.7.5	1,709.38	3,191.36
应收股利		5,059,297.79	2,767,512.40
应收申购款		922,200.82	595,131.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,256,334,604.01	4,200,875,830.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		13,578,083.74	23,798,547.44
应付管理人报酬		4,744,999.53	6,233,172.64
应付托管费		790,833.25	1,038,862.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	945,529.14
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	133,356.71	261,630.75
负债合计		19,247,273.23	32,277,742.09
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,917,574,402.73	3,584,594,408.38
未分配利润	6.4.7.10	319,512,928.05	584,003,680.44
所有者权益合计		3,237,087,330.78	4,168,598,088.82
负债和所有者权益总计		3,256,334,604.01	4,200,875,830.91

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.110元，基金份额总额2,917,574,402.73份。

6.2 利润表

会计主体：嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30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6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
一、收入		-76,531,364.68	435,095,289.60
1. 利息收入		81,391.89	111,112.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	81,391.89	111,112.13
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		304,952,625.49	260,318,440.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	211,825,114.66	244,215,085.65
基金投资收益	6.4.7.13	79,616,611.37	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	13,510,899.46	16,103,354.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-377,856,758.57	169,544,676.07
4. 汇兑收益（损失以“-”		-4,186,646.24	5,079,825.61

号填列)			
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.19	478,022.75	41,235.32
减: 二、费用		48,120,730.13	53,609,713.52
1. 管理人报酬	-	33,075,149.94	37,983,525.93
2. 托管费	-	5,512,524.95	6,330,587.68
3. 销售服务费	-	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	9,001,692.02	9,124,566.48
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		286,619.80	-
7. 其他费用	6.4.7.21	244,743.42	171,033.43
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-124,652,094.81	381,485,576.08
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-124,652,094.81	381,485,576.08

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 嘉实海外中国股票混合型证券投资基金

本报告期: 2021年1月1日至2021年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	3,584,594,408.38	584,003,680.44	4,168,598,088.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期净利润)	-	-124,652,094.81	-124,652,094.81
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)	-667,020,005.65	-132,861,762.69	-799,881,768.34
其中: 1. 基金申购款	94,275,581.57	21,311,750.62	115,587,332.19
2. 基金赎回款	-761,295,587.22	-154,173,513.31	-915,469,100.53
四、本期向基金	-	-6,976,894.89	-6,976,894.89

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)	2,917,574,402.73	319,512,928.05	3,237,087,330.78
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	5,012,252,999.45	-476,623,197.16	4,535,629,802.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	381,485,576.08	381,485,576.08
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)	-598,233,840.49	50,027,803.23	-548,206,037.26
其中：1. 基金申购款	32,430,202.96	-3,896,282.27	28,533,920.69
2. 基金赎回款	-630,664,043.45	53,924,085.50	-576,739,957.95
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)	4,414,019,158.96	-45,109,817.85	4,368,909,341.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

经雷

黄志泉

李袁

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

嘉实海外中国股票混合型证券投资基金(原名为嘉实海外中国股票股票型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]261号《关于同意嘉实海外中国股票股票型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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《嘉实海外中国股票股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实海外中国股票股票型证券投资基金基金合同》于2007年10月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为29,750,330,282.51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,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

6.4.2 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》、《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金基金合同》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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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[2014]81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]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]127号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》及其他相关境内外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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收企业所得税。

(3) 对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(4) 目前基金取得的源自境外的其他收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

(5) 基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(6) 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	184,560,798.40
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	184,560,798.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,076,952,821.01	2,917,623,698.54	840,670,877.53
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	2,076,952,821.01	2,917,623,698.54	840,670,877.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,707.80
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	-
应收债券利息	-
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	1.58
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	1,709.38

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

无。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,424.98
应付证券出借违约金	-
预提费用	128,931.73
合计	133,356.71

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	3,584,594,408.38	3,584,594,408.38
本期申购	94,275,581.57	94,275,581.57
本期赎回(以“-”号填列)	-761,295,587.22	-761,295,587.22
- 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	2,917,574,402.73	2,917,574,402.73

注:

申购含红利再投、转换入份额,赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	28,443,199.96	555,560,480.48	584,003,680.44
本期利润	253,204,663.76	-377,856,758.57	-124,652,094.81
本期基金份额交易产生的变动数	-30,721,070.51	-102,140,692.18	-132,861,762.69
其中:基金申购款	4,112,126.63	17,199,623.99	21,311,750.62
基金赎回款	-34,833,197.14	-119,340,316.17	-154,173,513.31
本期已分配利润	-6,976,894.89	-	-6,976,894.89
本期末	243,949,898.32	75,563,029.73	319,512,928.05

6.4.7.11 存款利息收入

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	80,660.30
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	-
其他	731.59
合计	81,391.89

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位:人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	211,825,114.66
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	211,825,114.66

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	2,092,901,978.95
减：卖出股票成本总额	1,881,076,864.29
买卖股票差价收入	211,825,114.66

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	290,726,887.60
减：卖出/赎回基金成本总额	211,110,276.23
基金投资收益	79,616,611.37

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.15 贵金属投资收益

6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 衍生工具收益

6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	13,510,899.46
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	13,510,899.46

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-377,856,758.57
股票投资	-308,621,319.22
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-69,235,439.35
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	-377,856,758.57

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	478,022.75
合计	478,022.75

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	9,001,692.02
银行间市场交易费用	-
合计	9,001,692.02

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

审计费用	69,424.36
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款手续费	10,132.63
其他	105,679.06
合计	244,743.42

6.4.7.22 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行(香港)有限公司	基金托管人的子公司、境外资产托管人
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	33,075,149.94	37,983,525.93
其中：支付销售机构的客户维护费	5,043,165.97	5,519,639.33

注：1. 支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.8%/当年天数。2. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,512,524.95	6,330,587.68

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.3% 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×0.3%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
报告期初持有的基金份额	20,391,217.00	20,391,217.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	20,391,217.00	20,391,217.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.70%	0.46%

注：本基金的基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

申购/买入含红利再投、转换入份额，赎回/卖出含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020年6月30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	10,979,183.07	80,660.30	53,119,202.06	111,029.96
中国银行(香港)有限公司_活期	173,581,615.33	-	292,278,341.48	-

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年1月19日	-	2021年1月18日	0.020	4,855,602.65	2,121,292.24	6,976,894.89	2020年年度收益分配于2021年实施
合计	-	-	-	0.020	4,855,602.65	2,121,292.24	6,976,894.89	-

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

根据香港联合交易所有限公司于2020年1月24日发布的《关于中国动物保健品有限公司取消上市地位》的通告，由2020年1月30日上午9时起，中国动物保健品有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型证券投资，风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属较高风险、收益的品种。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分散投资风险，获取中长期稳定收益。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法，主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程

度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人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6.4.12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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	184,560,798.40	-	-	-	184,560,798.40
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-2,917,623,698.54	2,917,623,698.54
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	148,166,899.08	148,166,899.08
应收利息	-	-	-	1,709.38	1,709.38
应收股利	-	-	-	5,059,297.79	5,059,297.79
应收申购款	-	-	-	922,200.82	922,200.82
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	184,560,798.40	-	-	-3,071,773,805.61	3,256,334,604.01
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	13,578,083.74	13,578,083.74
应付管理人报酬	-	-	-	4,744,999.53	4,744,999.53
应付托管费	-	-	-	790,833.25	790,833.25
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	133,356.71	133,356.71
负债总计	-	-	-	19,247,273.23	19,247,273.23
利率敏感度缺口	184,560,798.40	-	-	-3,052,526,532.38	3,237,087,330.78
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020年12月31日					
资产					
银行存款	295,397,545.28	-	-	-	295,397,545.28
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-3,902,112,449.95	-	3,902,112,449.95
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	3,191.36	3,191.36
应收股利	-	-	-	2,767,512.40	2,767,512.40
应收申购款	-	-	-	595,131.92	595,131.92
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	295,397,545.28	-	-3,905,478,285.63	-	4,200,875,830.91
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	-	-	-	23,798,547.44	23,798,547.44
应付管理人报酬	-	-	-	6,233,172.64	6,233,172.64
应付托管费	-	-	-	1,038,862.12	1,038,862.12
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-
应付税费	-	-	-	945,529.14	945,529.14
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	261,630.75	261,630.75
负债总计	-	-	-	32,277,742.09	32,277,742.09
利率敏感度缺口	295,397,545.28	-	-3,873,200,543.54	-	4,168,598,088.82

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月）	

			31日)
分析	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产和负债进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	51,083,213.56	122,815,192.58	-	173,898,406.14
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	703,748,867.50	2,213,874,831.04	-	2,917,623,698.54
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	3,344,657.39	-	3,344,657.39
应收利息	-	0.42	-	0.42
应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	16,038,093.62	132,128,805.46	-	148,166,899.08
其它资产	-	-	-	-

资产合计	770,870,174.68	2,472,163,486.89	-	3,243,033,661.57
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	770,870,174.68	2,472,163,486.89	-	3,243,033,661.57
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	124,757,055.06	153,074,671.63	-	277,831,726.69
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	884,249,956.71	3,017,862,493.24	-	3,902,112,449.95
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收利息	-	0.46	-	0.46

应收申购款	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
资产合计	1,009,007,011.77	3,170,937,165.33	-	4,179,944,177.10
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,009,007,011.77	3,170,937,165.33	-	4,179,944,177.10

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	所有外币相对人民币升值5%	162,151,683.08	208,997,208.86
	所有外币相对人民币贬值5%	-162,151,683.08	-208,997,208.86

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	2,917,623,698.54	90.13	3,621,766,734.37	86.88
交易性金融资产—基金投资	—	—	280,345,715.58	6.73
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	2,917,623,698.54	90.13	3,902,112,449.95	93.61

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末(2021年6月30日)	上年度末(2020年12月31日)
分析	业绩比较基准上升5%	191,145,524.95	200,206,000.05
	业绩比较基准下降	-191,145,524.95	-200,206,000.05

	5%		
--	----	--	--

6.4.14 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 2,917,623,698.54 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 3,902,112,449.95 元，无属于第二层次的余额，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。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,917,623,698.54	89.60
	其中：普通股	2,213,874,831.04	67.99
	存托凭证	703,748,867.50	21.61
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	184,560,798.40	5.67
8	其他各项资产	154,150,107.07	4.73
9	合计	3,256,334,604.01	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
中国香港	2,213,874,831.04	68.39
美国	703,748,867.50	21.74
合计	2,917,623,698.54	90.13

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
非必需消费品	771,476,430.52	23.83
通信服务	668,467,308.32	20.65
金融	412,800,654.31	12.75
医疗保健	274,246,559.00	8.47
工业	273,770,207.73	8.46
信息技术	189,276,998.60	5.85

必需消费品	170,430,661.19	5.26
房地产	151,155,116.11	4.67
能源	5,999,762.76	0.19
-	-	-
-	-	-
合计	2,917,623,698.54	90.13

注：以上分类采用彭博提供的国际通用行业分类标准。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	中国香港	608,000	295,448,309.76	9.13
2	Meituan	美团-W	3690 HK	香港证券交易所	中国香港	994,200	265,052,161.09	8.19
3	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港证券交易所	中国香港	3,941,500	217,276,369.95	6.71
4	Wuxi Biologics Cayman Inc	药明生物	2269 HK	香港证券交易所	中国香港	1,123,500	133,027,999.52	4.11
5	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA UN	纽约证券交易所	美国	89,634	131,315,735.16	4.06
6	Baidu Inc	百度	BIDU UW	纳斯达克证券交易所	美国	87,943	115,839,785.10	3.58
7	Bilibili Inc	哔哩哔哩	BILI UW	纳斯达克证券交易所	美国	145,982	114,902,225.49	3.55
8	Longfor Group Holdings Ltd	龙湖集团	960 HK	香港证券交易所	中国香港	3,111,000	112,604,138.28	3.48
9	Pinduoduo Inc	拼多多	PDD UW	纳斯达克证券交易所	美国	121,245	99,489,027.81	3.07
10	China Resources Beer Holdings Co	华润啤酒	291 HK	香港证券交易所	中国香港	1,696,000	98,431,735.68	3.04

	Ltd							
111	Techtronic Industries Co Ltd	创科实业	669 HK	香港证券交易所	中国香港	835,500	94,269,505.10	2.91
112	Ever Sunshine Lifestyle Services Group Ltd	永升生活服务	1995 HK	香港证券交易所	中国香港	5,830,000	93,527,788.99	2.89
113	AIA Group Ltd	友邦保险	1299 HK	香港证券交易所	中国香港	1,146,000	92,018,895.12	2.84
114	NetEase Inc	网易	NTES UQ	纳斯达克证券交易所	美国	99,170	73,834,695.48	2.28
115	China Mengniu Dairy Co Ltd	蒙牛乳业	2319 HK	香港证券交易所	中国香港	1,843,000	71,998,925.51	2.22
116	XPeng Inc	小鹏汽车	XPEV UN	纽约证券交易所	美国	237,357	68,111,405.03	2.10
117	Alibaba Health Information Technology Ltd	阿里健康	241 HK	香港证券交易所	中国香港	4,564,000	65,394,897.93	2.02
118	ANTA Sports Products Ltd	安踏体育	2020 HK	香港证券交易所	中国香港	429,000	65,252,712.10	2.02
119	Xiaomi Corp	小米集团	1810 HK	香港证券交易所	中国香港	2,890,600	64,940,682.10	2.01
200	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	中国平安	2318 HK	香港证券交易所	中国香港	953,500	60,337,178.69	1.86
201	Shenzhou International Group Holdings Ltd	申洲国际	2313 HK	香港证券交易所	中国香港	351,500	57,354,567.13	1.77
202	Nexteer Automotive Group Ltd	耐世特	1316 HK	香港证券交易所	中国香港	6,176,000	55,500,401.66	1.71
203	BeiGene Ltd	百济神州	BGNE UW	纳斯达克证券交易所	美国	24,745	54,860,697.34	1.69

				交易所				
24	Sunny Optical Technology Group Co Ltd	舜宇光学科技	2382 HK	香港证券交易所	中国香港	257,800	52,640,808.97	1.63
25	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	香港交易所	388 HK	香港证券交易所	中国香港	112,100	43,168,210.55	1.33
26	China Telecom Corp Ltd	中国电信	728 HK	香港证券交易所	中国香港	17,510,000	42,397,887.53	1.31
27	Xinte Energy Co Ltd	新特能源	1799 HK	香港证券交易所	中国香港	2,818,800	39,169,300.64	1.21
28	China Resources Mixc Lifestyle Services Ltd	华润万象生活	1209 HK	香港证券交易所	中国香港	871,700	38,550,977.83	1.19
29	Ming Yuan Cloud Group Holdings Ltd	明源云	909 HK	香港证券交易所	中国香港	1,123,000	36,022,116.13	1.11
30	Kingsoft Corp Ltd	金山软件	3888 HK	香港证券交易所	中国香港	921,000	35,673,391.40	1.10
31	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co Ltd	中联重科	1157 HK	香港证券交易所	中国香港	4,831,800	32,686,210.89	1.01
32	Trip.com Group Ltd	携程集团	TCOM UW	纳斯达克证券交易所	美国	128,344	29,400,420.54	0.91
33	WuXi AppTec Co Ltd	药明康德	2359 HK	香港证券交易所	中国香港	138,960	20,962,964.21	0.65
34	Tencent Music Entertainment Group	腾讯音乐娱乐集团	TME UN	纽约证券交易所	美国	159,945	15,994,875.55	0.49
35	China Southern Airline	南方航空	1055 HK	香港证券交易所	中国香港	3,520,000	14,117,402.11	0.44

	s Co Ltd			所				
36	Kuaishou Technology	快手	1024 HK	香港证券交易所	中国香港	62,000	10,049,529.41	0.31
37	China Oilfield Services Ltd	中海油服	2883 HK	香港证券交易所	中国香港	1,036,000	5,999,762.76	0.19

注：1. 本表所使用的证券代码为彭博代码。

2. 2020年2月4日《嘉实基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告》，自2020年2月3日起，嘉实基金管理有限公司对旗下证券投资基金持有的“中国动物保健品（代码：940 HK）”进行估值调整，估值价格为0.00元港币/股。报告期末本基金持有“中国动物保健品”638.7万股。香港联合交易所有限公司于2020年1月24日发布的《关于中国动物保健品有限公司取消上市地位》的通告，由2020年1月30日上午9时起，中国动物保健品有限公司的上市地位将根据除牌程序予以取消。

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Alibaba Group Holding Ltd	BABA UN	209,656,893.14	5.03
2	Xiaomi Corp	1810 HK	181,419,156.16	4.35
3	Techtronic Industries Co Ltd	669 HK	87,025,536.89	2.09
4	China Construction Bank Corp	939 HK	84,480,916.31	2.03
5	Xinte Energy Co Ltd	1799 HK	74,637,342.72	1.79
6	Nexteer Automotive Group Ltd	1316 HK	74,506,885.56	1.79
7	Baidu Inc	BIDU UN	67,574,659.90	1.62
8	BYD Co Ltd	1211 HK	63,333,817.58	1.52
9	XPeng Inc	XPEV UN	60,996,576.15	1.46
10	ANTA Sports Products Ltd	2020 HK	55,720,282.97	1.34
11	Shenzhou International Group Holdings Ltd	2313 HK	44,463,352.69	1.07
12	Zoomlion Heavy	1157 HK	43,329,946.24	1.04

	Industry Science and Technology Co Ltd			
13	Hong Kong Exchanges & Clearing Ltd	388 HK	43,077,112.52	1.03
14	Galaxy Entertainment Group Ltd	27 HK	39,908,811.33	0.96
15	China Telecom Corp Ltd	728 HK	38,681,764.67	0.93
16	RLX Technology Inc	RLX UN	38,061,748.34	0.91
17	Kuaishou Technology	1024 HK	37,426,972.16	0.90
18	Trip.com Group Ltd	TCOM UW	33,833,954.16	0.81
19	Tencent Holdings Ltd	700 HK	31,404,498.36	0.75
20	Meituan	3690 HK	25,151,892.54	0.60

7.5.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	Alibaba Group Holding Ltd	BABA UN	231,923,172.11	5.56
2	Ping An Insurance Group Co of China Ltd	2318 HK	150,664,826.48	3.61
3	NetEase Inc	9999 HK	136,495,487.73	3.27
4	Tencent Holdings Ltd	700 HK	116,923,871.15	2.80
5	Xiaomi Corp	1810 HK	101,692,382.24	2.44
6	Sino Biopharmaceutical Ltd	1177 HK	98,927,528.36	2.37
7	TAL Education Group	TAL UN	93,904,703.19	2.25
8	JD.com Inc	9618 HK	90,875,658.39	2.18
9	JD.com Inc	JD UW	85,080,845.20	2.04
10	China Construction Bank Corp	939 HK	83,217,326.38	2.00
11	HSBC Holdings PLC	5 HK	81,491,270.89	1.95
12	China Jinmao Holdings Group Lt	817 HK	68,790,872.96	1.65

	d			
13	Zijin Mining Group Co Ltd	2899 HK	59,592,793.18	1.43
14	Bilibili Inc	BILI UW	50,776,511.87	1.22
15	China Pacific Insurance Group Co Ltd	2601 HK	50,207,244.86	1.20
16	Shandong Gold Mining Co Ltd	1787 HK	45,993,344.95	1.10
17	Geely Automobile Holdings Ltd	175 HK	44,676,263.69	1.07
18	Alibaba Group Holding Ltd	9988 HK	44,578,992.96	1.07
19	Innovent Biologics Inc	1801 HK	40,860,482.41	0.98
20	BYD Co Ltd	1211 HK	40,664,745.42	0.98

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	1,486,147,985.75
卖出收入（成交）总额	2,092,901,978.95

注：7.5.1项“买入金额”、7.5.2项“卖出金额”及7.5.3项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

无。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

无。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

无。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

无。

7.11 投资组合报告附注

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

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

本基金投资于“CHINA MERCHANTS BANK CO.,LTD (03968)”的决策程序说明：基于对CHINA MERCHANTS BANK CO.,LTD 基本面研究以及二级市场的判断，本基金投资于“CHINA MERCHANTS BANK CO.,LTD”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。

7.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

7.11.3 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	-
2	应收证券清算款	148,166,899.08
3	应收股利	5,059,297.79
4	应收利息	1,709.38
5	应收申购款	922,200.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,150,107.07

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
252,883	11,537.25	199,254,248.34	6.83	2,718,320,154.39	93.17

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	36,445.92	0.00

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2007年10月12日) 基金份额总额	29,750,330,282.51
本报告期期初基金份额总额	3,584,594,408.38
本报告期基金总申购份额	94,275,581.57
减：本报告期基金总赎回份额	761,295,587.22
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	2,917,574,402.73

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动情况

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

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东方证券(香港)有限公司 Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	418,517, 991.71	11. 69%	837,03 5.97	15. 09%	-
中信建投(国际)证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	362,246, 488.16	10. 12%	724,49 3.00	13. 06%	-
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	336,968, 115.79	9.4 2%	182,58 4.17	3.2 9%	-
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	313,885, 868.95	8.7 7%	627,77 1.74	11. 31%	-
东方证券(香港)有限公司 Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	311,821, 344.81	8.7 1%	623,64 3.82	11. 24%	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation H ong Kong Securities Limited	-	299,757, 767.38	8.3 8%	133,87 1.53	2.4 1%	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	273,206, 412.20	7.6 3%	332,02 4.37	5.9 8%	-
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	-	190,026, 366.63	5.3 1%	380,05 2.74	6.8 5%	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	146,437, 876.49	4.0 9%	292,87 5.75	5.2 8%	-
元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited	-	145,516, 881.43	4.0 7%	315,96 9.06	5.6 9%	-
野村证券 NOMURA	-	140,027, 489.89	3.9 1%	280,05 4.98	5.0 5%	-
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	133,435, 797.30	3.7 3%	65,737 .08	1.1 8%	-
中泰国际证券有限公司 Zhongtai International Securities Limited	-	70,206,3 26.45	1.9 6%	105,30 9.49	1.9 0%	-

高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	68,790,8 72.96	1.9 2%	137,58 1.75	2.4 8%	-
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	62,291,4 55.45	1.7 4%	133,88 3.09	2.4 1%	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	54,064,0 59.35	1.5 1%	54,064 .06	0.9 7%	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	53,043,4 24.19	1.4 8%	24,739 .70	0.4 5%	-
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	45,439,6 78.30	1.2 7%	90,879 .35	1.6 4%	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	38,956,7 29.40	1.0 9%	46,748 .07	0.8 4%	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	38,681,7 64.67	1.0 8%	58,022 .65	1.0 5%	-
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	33,449,8 26.09	0.9 3%	66,899 .65	1.2 1%	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	32,864,6 02.55	0.9 2%	19,593 .33	0.3 5%	-
华泰金融控股 Huatai Financial Holdings	-	7,339,21 2.87	0.2 1%	14,678 .43	0.2 6%	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited	-	2,073,61 1.67	0.0 6%	-	-	-
Oppenheimer	-	-	-	-	-	-
大和资本市场香港有限公司 Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-
东航国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-

CES Capital International Co., Ltd.						
东盛证券(经纪)有限公司 Tung Shing Securities (Brokers)	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-
工银国际证券有限公司 ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong)Limited	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司 HUATAI SECURITIES CO.,LTD.	-	-	-	-	-	-
极讯公司 Instinet	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
凯基证券(香港)有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-
农银证券有限公司 CAF Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
派杰亚洲证券有限公司 Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	-	-	-	-	-
群益证券(香港)有限公司 CSC Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷(香港)有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司	-	-	-	-	-	-

Mizuho Securities Asia Limited						
申银万国证券(香港)有限公司 Shenyin Wanguo Securities (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
中国光大证券(香港)有限公司 China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 报告期内，本基金新增以下交易单元：

- (1) 信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED；
- (2) 东方证券(香港)有限公司 Orient Securities (Hong Kong) Limited；
- (3) 元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities (Hong Kong) Company Limited；
- (4) 野村证券 NOMURA。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购	权证交易	基金交易

	易		购		易		成交金额	占当期基金成交总额的比例
	成交金额	占当期成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例	成交金额	占当期成交总额的比例		
广发证券(香港)经济有限公司 GF Securities (Hong Kong) Brokerage Ltd	-	-	-	-	-	-	116,073,183.41	39.60%
麦格理银行有限公司香港分行 Macquaire Bank Limited Hong Kong Branch.	-	-	-	-	-	-	86,237,171.07	29.42%
高盛(亚洲)有限责任公司 Goldman Sachs (Asia) L.L.C	-	-	-	-	-	-	46,557,896.55	15.88%
野村证券 NOMURA	-	-	-	-	-	-	44,247,134.92	15.10%
信达国际证券有限公司 CINDA INTERNATIONAL SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投(国际)证券有限公司 China Securities (International) Brokerage Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券(香港)有限公司 China Merchants Securities (HK) Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券(香港)有限公司 Orient Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融香港证券有限公司 China International Capital Corporation Hong Kong Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
盛博香港有限公司 Sanford C. Bernstein (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
海通国际证券有限公司 Haitong International Securities Company Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
华兴证券有限公司 China Renaissance Security	-	-	-	-	-	-	-	-
元大证券(香港)有限公司 Yuanta Securities	-	-	-	-	-	-	-	-

(Hong Kong) Company Limited									
摩根士丹利亚洲有限公司 Morgan Stanley Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰国际证券有限公司 Zhongtai International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(亚太)有限公司 J.P.Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券国际有限公司 CITIC Securities International Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银集团 Union Bank of Switzerland	-	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限公司 BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
联昌证券有限公司 CIMB Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
法国巴黎证券(亚洲)有限公司 BNP PARIBAS Securities (Asia) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
美林(亚太)有限公司 Merrill Lynch (Asia Pacific) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰金融控股 Huatai Financial Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-	-
花旗环球金融亚洲有限公司 Citigroup Global Markets Asia Limited Oppenheimer	-	-	-	-	-	-	-	-	-
大和资本市场香港有限公司 Daiwa Capital Markets Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
德意志银行股份有限公司 Deutsche Bank	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东航国际金融有限公司 CES Capital International Co., Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
东盛证券(经纪)有限公司 Tung Shing Securities (Brokers)	-	-	-	-	-	-	-	-	-
富瑞金融集团 Jefferies Hong Kong Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
工银国际证券有限公司 ICBC International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券(香港)有限公司 Guotai Junan Securities(Hong Kong)Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司 HUATAI SECURITIES CO.,LTD.	-	-	-	-	-	-	-	-	-
极讯公司 Instinet	-	-	-	-	-	-	-	-	-
建银国际证券有限公司 CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
金贝塔证券有限公司 iGoldenbeta Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
凯基证券(香港)有限公司 KGI Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
里昂证券有限公司 CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-
麦格理资本证券股份有限公司 Macquarie Securities Group	-	-	-	-	-	-	-	-	-
农银证券有限公司 CAF Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-	-	-	-

派杰亚洲证券有限公司 Piper Jaffray Asia Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
群益证券 (香港) 有限公司 CSC Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞士信贷 (香港) 有限公司 Credit Suisse (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞穗证券亚洲有限公司 Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 (香港) 有限公司 Shenyin Wanguo Securities (H.K.) Ltd.	-	-	-	-	-	-	-	-
香港上海汇丰银行有限公司 The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
星展唯高达香港有限公司 DBS Vickers (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国光大证券 (香港) 有限公司 China Everbright Securities (HK) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司 China Galaxy International Financials Holdings	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	嘉实海外中国股票混合型证券投资基金 2020 年年度收益分配公告	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 01 月 15 日
2	关于嘉实海外中国股票混合 (QDII) 2021 年 4 月 2 日至 4 月 6 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 03 月 31 日
3	嘉实基金管理有限公司关于终止凤凰金信 (银川) 基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 07 日
4	关于嘉实海外中国股票混合 (QDII) 2021 年 5 月 19 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 05 月 17 日
5	嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021 年 05 月 29 日
6	关于嘉实海外中国股票混合 (QDII) 2021 年 7 月 1 日暂停申购、赎回及定投业务的公告	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 06 月 29 日

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

(1) 中国证监会核准嘉实海外中国股票混合型证券投资基金募集的文件;

- (2) 《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金基金合同》;
- (3) 《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金招募说明书》;
- (4) 《嘉实海外中国股票混合型证券投资基金托管协议》;
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照;
- (6) 报告期内嘉实海外中国股票混合型证券投资基金公告的各项原稿。

11.2 存放地点

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

11.3 查阅方式

(1) 书面查询: 查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询: 基金管理人网址: <http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问, 可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司, 咨询电话 400-600-8800, 或发 E-mail: service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日