

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	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	10
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	63
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.....	63
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.....	64
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.....	64
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.....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	64
8.12 投资组合报告附注.....	65
§ 9 基金份额持有人信息.....	66
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	66
§ 10 开放式基金份额变动.....	66
§ 11 重大事件揭示.....	67
11.1 基金份额持有人大会决议.....	67
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.....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	67
11.4 基金投资策略的改变.....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
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.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 其他重大事件.....	69
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	71
§ 13 备查文件目录.....	71
13.1 备查文件目录.....	71
13.2 存放地点.....	72
13.3 查阅方式.....	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	安信灵活配置混合
基金主代码	750001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 6 月 20 日
基金管理人	安信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,443,020,227.44 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	灵活运用多种投资策略，深入挖掘和把握市场投资机会，分享中国经济增长和资本市场发展的成果，力争为基金份额持有人创造当期收益和长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金采取“自上而下”和“自下而上”相结合的模式，在对中国经济结构和发展趋势进行分析的基础上，以行业运行周期和公司竞争优势分析为根本，结合金融市场行为分析，根据大类资产的收益与风险特征及其变化趋势的判断，动态运用并不断优化资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券投资策略、权证投资策略等多种策略，实现基金资产长期稳定增值。
业绩比较基准	60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债总指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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	安信基金管理有限责任公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	021-60637111
传真	0755-82799292	021-60635778
注册地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	518026	100033
法定代表人	刘入领	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www. essencefund. com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	-27,724,724.78	97,450,118.30	32,842,831.49
本期利润	83,574,024.47	110,650,502.27	48,229,970.94
加权平均基金份额 本期利润	0.0934	0.9772	0.5347
本期加权平均净值 利润率	3.35%	53.34%	44.63%
本期基金份额净值 增长率	17.18%	70.80%	55.23%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	2,128,469,091.40	272,203,955.61	46,970,757.66
期末可供分配基金 份额利润	1.4750	1.2450	0.3873
期末基金	4,026,193,630.91	520,491,277.23	169,028,923.75

资产净值			
期末基金份额净值	2.790	2.381	1.394
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	349.27%	283.41%	124.47%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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。

2、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。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

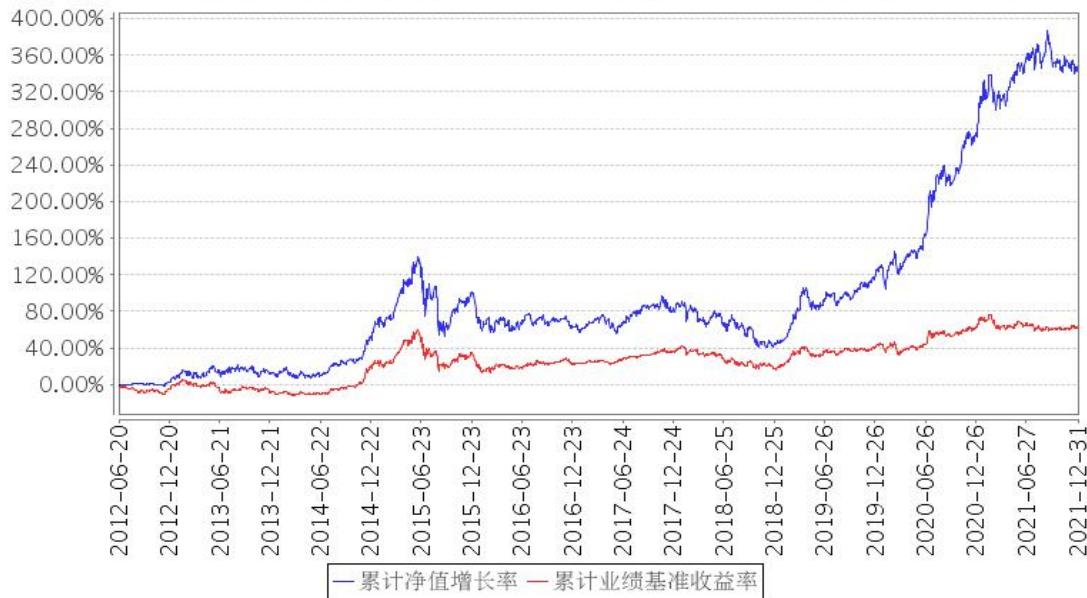
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.53%	0.68%	1.27%	0.47%	-1.80%	0.21%
过去六个月	-2.65%	0.92%	-2.36%	0.61%	-0.29%	0.31%
过去一年	17.18%	1.09%	-1.88%	0.70%	19.06%	0.39%
过去三年	210.69%	1.20%	38.45%	0.76%	172.24%	0.44%
过去五年	175.42%	1.19%	32.55%	0.71%	142.87%	0.48%
自基金合同生效起至今	349.27%	1.34%	62.54%	0.86%	286.73%	0.48%

注：根据《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基

准为： $60\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+40\% \times$ 中债总指数收益率。其中沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债总指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 60%、40% 的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

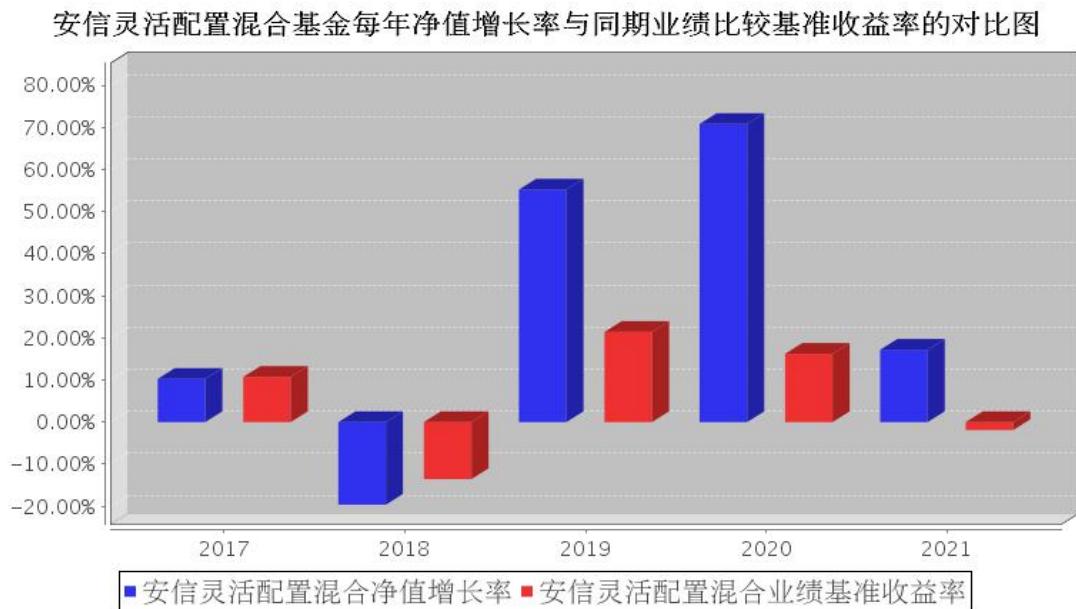
安信灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2012 年 6 月 20 日。

2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 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

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 77 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置

混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金(原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金(LOF)、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金(LOF)、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利

混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
张竞	本基金的 基金经 理，权益 投资部总 经理	2017 年 12 月 29 日	-	14 年	张竞先生，经济学硕士。历任华泰证券股 份有限公司研究员，安信证券股份有 限公司证券投资部投资经理助理、安信 基金管理有限责组研究部研究员，安信基金管理 有限责任公司研究部研究员、特定资产管 理部副总经理、特定资产管理部总经理。 现任安信基金管理有限责任公司权益投资 部总经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深 精选灵活配置混合型证券投资基金的基金 经理；现任安信策略精选灵活配置混合型 证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置 混合型证券投资基金、安信比较优势灵活 配置混合型证券投资基金、安信平稳合盈 一年持有期混合型证券投资基金、安信浩 盈 6 个月持有期混合型证券投资基金的基 金经理。
沈明辉	本基金的 基金经理 助理	2020 年 8 月 19 日	-	5 年	沈明辉先生，管理学硕士。历任广发证 券发展研究中心分析师，恒大集团研究院研 究员。安信基金管理有限责任公司研究部研 究员，现任安信基金管理有限责任公司研 究部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪 港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基 金经理助理；现任安信策略精选灵活配置 混合型证券投资基金的基金经理助理，安信工 业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券 投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。
 2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投

资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有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

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的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% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

经历了 2019-2020 年权益公募的“大年”之后。2021 年，偏股型公募基金收益回归正常，中位数回到 5% 左右，跑赢中证 800。全年看行业之间分化严重，表现较好的主要集中于两个领域，一个是需求端快速爆发或者预期快速爆发的新能源车以及风电、光伏；二是供给端优化的周期板块。

我们先总结一下 2021 年我们投资过程中成功和失败的部分。

2021 年成功的部分：

首先，对于“核心资产”的股票在达到我们测算的合理估值上限的时候坚定卖出，而不是等到估值不合理的时候被动卖出，使得我们很大程度上避免了年初的波动和损失。

2021 年年初的时候，以“茅指数”为代表的“核心资产”在趋势资金的推动下，市场的分化和演绎趋于极致。我们在一月中旬保持理性，不断降低风险收益比已经很低的“核心资产”，虽然曾经短暂面临净值的压力，但是最终较好的回避了“核心资产”突然掉头向下的风险。

其次，我们在一月中旬布局了基本面远超市场预期的品种。这些品种虽然不多，但是涨幅很大，不仅对净值形成了很好的贡献，并且有效的对冲了我们保留的部分长周期资产的向下波动。

例如，我们在一月中旬利用市场分化极致的机会布局了无论是基本面还是盈利预期差巨大的电解铝板块。最终，无论是行业基本面的变化还是公司的盈利都兑现了我们年初的判断，相关上市公司前三季度的利润就超过了其上市二十多年的利润总和。

2021 年失败的部分：

首先，2021 年我们错过了全年高举高打的新能源板块，特别是新能源车板块。新能源车板块在 2020 年表现较好的基础上，继续受到资金认可，不少公司股价出现了数倍涨幅。如果说 8 月份之后的新能源车行情有大家不断上调未来销量一致预期的背景下，开始忽略其作为周期成长行业的周期属性，有所泡沫化的话。7 月中旬前的几个核心中游品种的业绩超预期以及 7 月份开始的锂资源价格变化确实是通过产业研究可以做出预判的。但我们在这方面的研究只是跟踪性而非前瞻性，错失了巨大的投资机会。

其次是我们一个长期重仓持有的核心品种，我们忽略了行业之间勾稽关系所提示的风险，在中观需求已经出现历史上未曾出现变化的时候，仍然寄希望于通过微观调研寻找警示信号，在三季度损失了全年的超额收益后才对持仓进行了相应调整。

投资策略方面，本组合坚持逆向+自下而上精选高复合 ROE 的选股策略，同时坚持持有不受同一因素驱动的多个行业，即使再看好的单一行业，也不进行过多的风险暴露。长期通过坚持从个股研究的阿尔法中不断获得超额回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 2.790 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.18%，业绩比较基准收益率为 -1.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，我们认为宏观基本面最大的变数还是在于通胀。客观来讲，通胀的走势是很难清晰预测的，否则美联储的货币政策态度在短短的几个月中也不会出现如此急剧的变化。

在大宗可能分化的背景下，比较确定的是在供需失衡的情况下，传统能源和农产品在未来很长一段时间内价格都将处于高位。包括疫情的变化也会影响 PPI 向 CPI 的传导速度和力度，使得今年国内外的通胀变化破朔迷离。

而通胀的变化最终将决定货币政策的空间和节奏，也会影响资本市场的未来走向。

展望 2022 年，“变”与“不变”仍是未来的关键词。所谓“变”是指市场已经从 2021 年初只关注高景气成长扩展到关注估值和成长的匹配度，这个过程在 2022 年还将继续；“不变”是指市场在扩散过程中，能够持续创造超额收益大概率不是前几年的“核心资产”，而是仍然在各个细分领域中具备竞争力的“专精特新”龙头公司，但我们不看好二三线仅仅是静态估值便宜但竞争力不强的公司。

细分行业领域，我们对明年地产销量持有谨慎预期，但是对于竣工的趋势好转有所预期，因此认为地产产业链将呈现分化的态势，开工端和竣工端产业链冷暖自知。与地产销量谨慎相对应的是我们认为地产行业本身的格局未来会得到极大的优化，类似于 2017 年供给侧行业的出清。即使未来新房销量下滑到均衡水平，国有地产公司受益于份额提升以及净利率回升，实际经营性盈利（非报表）的低点或已出现。

相较于我们熟悉的 A 股，我们预计 2022 年港股的风险收益比会更好。这么看的原因，不仅仅是由于 AH 溢价率已经到了近 10 年的高位以及沪深 300 已经连续三年跑赢恒生指数这类统计数据，更多的是基于价值角度的判断。虽然我们对于港股的认知远不如 A 股，但是我们仍然加大对于港股的研究和探索。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上

人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金管理法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、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。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金</p>

	的财务报告过程。
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> <ul style="list-style-type: none"> (1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、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。 (2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	吴翠蓉 邓雯
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2022 年 03 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7. 4. 7. 1	746, 678, 368. 53	79, 486, 263. 47
结算备付金		22, 696, 190. 27	3, 674, 928. 65
存出保证金		2, 848, 367. 63	197, 154. 61
交易性金融资产	7. 4. 7. 2	3, 162, 342, 707. 18	453, 439, 162. 38
其中：股票投资		2, 883, 309, 494. 43	414, 988, 005. 50
基金投资		—	—
债券投资		279, 033, 212. 75	38, 451, 156. 88
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	196, 400, 000. 00	26, 000, 000. 00
应收证券清算款		—	—
应收利息	7. 4. 7. 5	1, 983, 900. 85	509, 535. 31
应收股利		—	—
应收申购款		4, 772, 380. 13	177, 589. 75
递延所得税资产		—	—
其他资产	7. 4. 7. 6	—	—
资产总计		4, 137, 721, 914. 59	563, 484, 634. 17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		72, 202, 791. 19	39, 582, 812. 97
应付赎回款		24, 747, 544. 55	1, 583, 328. 55
应付管理人报酬		5, 119, 222. 72	486, 245. 53
应付托管费		853, 203. 78	81, 040. 93
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7. 4. 7. 7	8, 291, 430. 39	1, 079, 723. 90
应交税费		1, 840. 30	10. 07
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7. 4. 7. 8	312, 250. 75	180, 194. 99
负债合计		111, 528, 283. 68	42, 993, 356. 94
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	1,443,020,227.44	218,646,237.34
未分配利润	7.4.7.10	2,583,173,403.47	301,845,039.89
所有者权益合计		4,026,193,630.91	520,491,277.23
负债和所有者权益总计		4,137,721,914.59	563,484,634.17

注： 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.790 元，基金份额总额 1,443,020,227.44 份。

7.2 利润表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		166,943,661.73	119,109,483.46
1.利息收入		5,602,495.31	639,714.12
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,977,843.67	167,736.99
债券利息收入		2,978,967.45	101,782.05
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		645,684.19	370,195.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		47,742,312.12	105,112,521.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	34,151,346.37	100,614,965.49
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-2,664,073.87	3,230,856.38
资产支持证券投资 收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	16,255,039.62	1,266,699.37
3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.18	111,298,749.25	13,200,383.97
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.19	2,300,105.05	156,864.13
减：二、费用		83,369,637.26	8,458,981.19
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	37,172,200.51	3,075,893.17

2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	6, 195, 366. 69	512, 648. 84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 20	39, 728, 137. 82	4, 643, 998. 53
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		1, 387. 14	30. 02
7. 其他费用	7. 4. 7. 21	272, 545. 10	226, 410. 63
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		83, 574, 024. 47	110, 650, 502. 27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		83, 574, 024. 47	110, 650, 502. 27

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	218, 646, 237. 34	301, 845, 039. 89	520, 491, 277. 23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	83, 574, 024. 47	83, 574, 024. 47
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)	1, 224, 373, 990. 10	2, 197, 754, 339. 11	3, 422, 128, 329. 21
其中：1. 基金申购款	1, 872, 349, 024. 11	3, 368, 558, 205. 80	5, 240, 907, 229. 91
2. 基金赎回款	-647, 975, 034. 01	-1, 170, 803, 866. 69	-1, 818, 778, 900. 70
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	1, 443, 020, 227. 44	2, 583, 173, 403. 47	4, 026, 193, 630. 91

权益(基金净值)			
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	121,285,264.39	47,743,659.36	169,028,923.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	110,650,502.27	110,650,502.27
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)	97,360,972.95	143,450,878.26	240,811,851.21
其中：1. 基金申购款	181,714,962.31	200,968,484.54	382,683,446.85
2. 基金赎回款	-84,353,989.36	-57,517,606.28	-141,871,595.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	218,646,237.34	301,845,039.89	520,491,277.23

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：

刘入领

范瑛

苗杨

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

安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金（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”）2012 年 4 月 5 日下发的证监许可[2012]442 号文“关于核准安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信策略精选灵活配置混合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。本基金募集期间为 2012 年 5 月 21 日至 2012

年 6 月 15 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2012)验字第 60962175_H04 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2012 年 6 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 743,426,623.31 份基金份额，其中认购资金利息折合 134,013.84 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板股票、创业板股票，以及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、权证、债券、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规允许或中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 30%—80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为： $60\% \times \text{沪深 } 300 \text{ 指数收益率} + 40\% \times \text{中债总指数收益率}$ 。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

本基金以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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，除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

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

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类

金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

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

金融资产转移

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的股票、债券、资产支持证券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；
- (2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够的可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；
- (3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；
- (4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

为股利收益。债券投资在持有期间应取得的按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除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。资产支持证券投资在持有期间应取得的按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除在适用情况下由证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。

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。

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。

其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值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；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

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

7.4.6.3 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

基金从上市公司分配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，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	746,678,368.53	79,486,263.47
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	746,678,368.53	79,486,263.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,743,806,731.11	2,883,309,494.43	139,502,763.32
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	87,570,620.75	1,678,592.00
	银行间市场	189,933,950.00	-149,950.00
	合计	277,504,570.75	1,528,642.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,021,311,301.86	3,162,342,707.18	141,031,405.32
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票	385,395,653.90	414,988,005.50	29,592,351.60
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	38,310,852.41	38,451,156.88
	银行间市场	-	-
	合计	38,310,852.41	38,451,156.88
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	423,706,506.31	453,439,162.38	29,732,656.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	196,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	196,400,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	26,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	26,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日
	应收活期存款利息	应收定期存款利息	
应收活期存款利息	101,324.06	-	4,665.40
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	11,234.63	-	1,819.07

应收债券利息	1,786,995.26	517,356.31
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	82,936.92	-14,403.04
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	1,409.98	97.57
合计	1,983,900.85	509,535.31

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	8,291,180.39	1,079,723.90
银行间市场应付交易费用	250.00	-
合计	8,291,430.39	1,079,723.90

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	92,950.75	5,894.99
应付证券出借违约金	-	-
应付银行间账户维护费	9,300.00	9,300.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付审计费	90,000.00	45,000.00
合计	312,250.75	180,194.99

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	218,646,237.34	218,646,237.34
本期申购	1,872,349,024.11	1,872,349,024.11
本期赎回(以“-”号填列)	-647,975,034.01	-647,975,034.01
本期末	1,443,020,227.44	1,443,020,227.44

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。

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	272,203,955.61	29,641,084.28	301,845,039.89
本期利润	-27,724,724.78	111,298,749.25	83,574,024.47
本期基金份额交易产生的变动数	1,883,989,860.57	313,764,478.54	2,197,754,339.11
其中：基金申购款	2,901,701,651.74	466,856,554.06	3,368,558,205.80
基金赎回款	-1,017,711,791.17	-153,092,075.52	-1,170,803,866.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,128,469,091.40	454,704,312.07	2,583,173,403.47

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间	
		2020年1月1日至2020年12月31日	
活期存款利息收入	1,750,383.42	127,879.38	
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	208,209.22	37,778.78	
其他	19,251.03	2,078.83	
合计	1,977,843.67	167,736.99	

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间	
		2020年1月1日至2020年12月31日	
卖出股票成交总额	13,818,430,780.55	1,596,735,047.68	
减：卖出股票成本总额	13,784,279,434.18	1,496,120,082.19	
买卖股票差价收入	34,151,346.37	100,614,965.49	

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间	
		2020年1月1日至2020年12月31日	
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	436,131,798.61	69,501,565.14	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	436,456,013.64	66,231,539.14	
减：应收利息总额	2,339,858.84	39,169.62	
买卖债券差价收入	-2,664,073.87	3,230,856.38	

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,255,039.62	1,266,699.37
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,255,039.62	1,266,699.37

7.4.7.18 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	111,298,749.25	13,200,383.97
股票投资	109,910,411.72	13,209,208.76
债券投资	1,388,337.53	-8,824.79
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	111,298,749.25	13,200,383.97

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,180,467.29	95,378.80
基金转换费收入	119,637.76	61,436.58
其他	-	48.75
合计	2,300,105.05	156,864.13

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	39,723,962.82	4,643,998.53
银行间市场交易费用	4,175.00	-
合计	39,728,137.82	4,643,998.53

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	25,345.10	14,910.63
银行间账户维护费	37,200.00	46,500.00
合计	272,545.10	226,410.63

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
安信证券股份有限公司（“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东

佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		金额单位：人民币元
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	
	12,698,588,242.73	42.43	891,126,922.44	26.63	
安信证券					

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日				金额单位：人民币元
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)	
	9,032,526.65	39.02	2,629,220.03	31.71	
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日				
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)	
	633,879.36	23.37	414,262.62	38.37	

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	单位：人民币元	
		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日	
当期发生的基金应支付的管理费	37,172,200.51		3,075,893.17
其中：支付销售机构的客户维护费	4,846,393.14		296,757.13

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	单位：人民币元	
		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日	
当期发生的基金应支付的托管费	6,195,366.69		512,648.84

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

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

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金合同生效日(2012年6月20日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,484,914.98	21,002,442.47
报告期内申购/买入总份额	4,049,817.74	5,484,914.98
报告期内因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	21,002,442.47
报告期内持有的基金份额	9,534,732.72	5,484,914.98
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.66%	2.51%

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

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

关联方名称	本期末		上年度末	
	2021年12月31日	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	2020年12月31日	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
安信证券	5,339,038.12	0.37	5,339,038.12	2.44

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	746,678,368.53	1,750,383.42	79,486,263.47	127,879.38

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位： 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年02月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-

301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年01月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年01月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年02月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月	2022年1月	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-

		1 日	10 日							
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021 年 8 月 11 日	2022 年 02 月 28 日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021 年 8 月 17 日	2022 年 2 月 24 日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021 年 8 月 23 日	2022 年 2 月 28 日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021 年 8 月 25 日	2022 年 3 月 1 日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021 年 8 月 26 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021 年 8 月 27 日	2022 年 3 月 7 日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-

301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股锁定	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城	2021	2022	新股锁	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-

	交	年 10 月 20 日	年 4 月 29 日	定						
301092	争光 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁 定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁 定	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚 医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股锁 定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301098	金埔 园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股锁 定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创 电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	新股锁 定	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光 股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股锁 定	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301101	明月 镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股锁 定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅 股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股锁 定	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301118	恒光 股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股锁 定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉 维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁 定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源 环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新股锁 定	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-

301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股锁定	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
601728	中国电信	2021年8月	2022年2月	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-

		11 日	21 日								
688148	芳源股份	2021 年 7 月 30 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	4.58	34.00	11,860	54,318.80	403,240.00	-	
688255	凯尔达	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 25 日	新股锁定	47.11	37.87	1,648	77,637.28	62,409.76	-	
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-	
688511	天微电子	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-	
688670	金迪克	2021 年 7 月 23 日	2022 年 2 月 7 日	新股锁定	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	-	
688776	国光电气	2021 年 8 月 24 日	2022 年 02 月 28 日	新股锁定	51.44	184.99	1,447	74,433.68	267,680.53	-	

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021 年 12 月 29 日	2022 年 1 月 14 日	新债未上市	100.00	100.00	38,440	3,843,949.45	3,843,949.45	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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，本基金无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，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化

指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，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

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在

银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 2.22%（2020 年 12 月 31 日：3.19%）。

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	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	189,784,000.00	21,823,908.00
合计	189,784,000.00	21,823,908.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 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
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
AAA	18,165,156.35	16,411,249.83
AAA 以下	71,084,056.40	215,999.05
未评级	-	-
合计	89,249,212.75	16,627,248.88

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基

金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。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，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	746,678,368.53	-	-	-	746,678,368.53
结算备付金	22,696,190.27	-	-	-	22,696,190.27
存出保证金	2,848,367.63	-	-	-	2,848,367.63
交易性金融资产	190,946,862.40	78,882,652.50	9,203,697.85	2,883,309,494.43	3,162,342,707.18
买入返售金融资产	196,400,000.00	-	-	-	196,400,000.00
应收利息	-	-	-	1,983,900.85	1,983,900.85
应收申购款	-	-	-	4,772,380.13	4,772,380.13
资产总计	1,159,569,788.83	78,882,652.50	9,203,697.85	2,890,065,775.41	4,137,721,914.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	24,747,544.55	24,747,544.55
应付管理人报酬	-	-	-	5,119,222.72	5,119,222.72
应付托管费	-	-	-	853,203.78	853,203.78
应付证券清算款	-	-	-	72,202,791.19	72,202,791.19
应付交易费用	-	-	-	8,291,430.39	8,291,430.39
应交税费	-	-	-	1,840.30	1,840.30
其他负债	-	-	-	312,250.75	312,250.75
负债总计	-	-	-	111,528,283.68	111,528,283.68
利率敏感度缺口	1,159,569,788.83	78,882,652.50	9,203,697.85	2,778,537,491.73	4,026,193,630.91
上年度末 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	79,486,263.47	-	-	-	79,486,263.47
结算备付金	3,674,928.65	-	-	-	3,674,928.65
存出保证金	197,154.61	-	-	-	197,154.61
交易性金融资产	21,823,908.00	16,208,252.50	418,996.38	414,988,005.50	453,439,162.38
买入返售金融资产	26,000,000.00	-	-	-	26,000,000.00
应收利息	-	-	-	509,535.31	509,535.31
应收申购款	-	-	-	177,589.75	177,589.75
资产总计	131,182,254.73	16,208,252.50	418,996.38	415,675,130.56	563,484,634.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,583,328.55	1,583,328.55
应付管理人报酬	-	-	-	486,245.53	486,245.53
应付托管费	-	-	-	81,040.93	81,040.93
应付证券清算款	-	-	-	39,582,812.97	39,582,812.97
应付交易费用	-	-	-	1,079,723.90	1,079,723.90
应交税费	-	-	-	10.07	10.07
其他负债	-	-	-	180,194.99	180,194.99
负债总计	-	-	-	42,993,356.94	42,993,356.94

利率敏感度缺口	131,182,254.73	16,208,252.50	418,996.38	372,681,773.62	520,491,277.23
---------	----------------	---------------	------------	----------------	----------------

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）	
分析		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
1. 市场利率下降 25 个基点	1,101,778.81	159,422.28	
2. 市场利率上升 25 个基点	-1,090,296.73	-157,106.32	

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。本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和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 30%—80%，权证投资占基金资产净值的比例为 0—3%，债券及其他金融工具投资占基金资产的比例为 20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券合计比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		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	2,883,309,494.43	71.61	414,988,005.50	79.73
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	2,883,309,494.43	71.61	414,988,005.50	79.73

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	1. 沪深 300 指数上 升 5%	147,546,593.48	23,485,655.79
	2. 沪深 300 指数下 降 5%	-147,546,593.48	-23,485,655.79

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 2,964,712,692.06 元，划分为第二层次的余额为人民币 197,630,015.12 元，无划分为第三层次

的余额(于 2020 年 12 月 31 日,本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 427,997,915.47 元,划分为第二层次的余额为人民币 25,441,246.91 元,无划分为第三层次的余额)。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌、交易不活跃或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券,若出现交易不活跃的情况,本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次;根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性,确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

(2) 根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以上统称新金融工具相关会计准则),以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号),自 2022 年 1 月 1 日起,本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	2,883,309,494.43	69.68
	其中: 股票	2,883,309,494.43	69.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	279,033,212.75	6.74
	其中: 债券	279,033,212.75	6.74

	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	196,400,000.00	4.75
	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	769,374,558.80	18.59
8	其他各项资产	9,604,648.61	0.23
9	合计	4,137,721,914.59	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	40,307,076.80	1.00
B	采矿业	265,119,507.60	6.58
C	制造业	1,566,831,805.61	38.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,990,535.40	1.47
E	建筑业	97,598,306.19	2.42
F	批发和零售业	19,973,390.24	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	272,666,519.47	6.77
J	金融业	56,993,436.00	1.42
K	房地产业	504,336,103.00	12.53
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	297,189.64	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	127,263.79	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,883,309,494.43	71.61

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	600048	保利发展	19,532,400	305,291,412.00	7.58
2	601899	紫金矿业	27,331,908	265,119,507.60	6.58
3	002648	卫星化学	6,583,144	263,523,254.32	6.55
4	600519	贵州茅台	108,790	223,019,500.00	5.54
5	603501	韦尔股份	612,300	190,284,471.00	4.73
6	600570	恒生电子	2,800,889	174,075,251.35	4.32
7	600383	金地集团	12,192,530	158,137,114.10	3.93
8	300171	东富龙	2,729,366	137,942,157.64	3.43
9	603986	兆易创新	683,160	120,133,686.00	2.98
10	002541	鸿路钢构	1,952,287	104,525,445.98	2.60
11	000792	盐湖股份	2,857,200	101,116,308.00	2.51
12	600885	宏发股份	1,350,239	100,781,838.96	2.50
13	601668	中国建筑	19,518,300	97,591,500.00	2.42
14	300496	中科创达	545,075	75,449,281.50	1.87
15	603236	移远通信	302,860	61,753,154.00	1.53
16	600900	长江电力	2,598,702	58,990,535.40	1.47
17	300033	同花顺	394,200	56,993,436.00	1.42
18	603279	景津装备	952,407	44,172,636.66	1.10
19	001979	招商蛇口	3,066,535	40,907,576.90	1.02
20	002714	牧原股份	755,380	40,307,076.80	1.00
21	603855	华荣股份	1,553,700	39,277,536.00	0.98
22	600399	抚顺特钢	1,206,600	29,887,482.00	0.74
23	002250	联化科技	1,404,660	25,241,740.20	0.63
24	003021	兆威机电	260,120	20,770,582.00	0.52
25	300036	超图软件	688,500	20,689,425.00	0.51
26	600703	三安光电	537,814	20,200,293.84	0.50
27	002643	万润股份	854,169	20,192,555.16	0.50
28	002727	一心堂	516,000	19,871,160.00	0.49
29	300748	金力永磁	434,260	19,493,931.40	0.48
30	603733	仙鹤股份	391,300	15,968,953.00	0.40
31	002960	青鸟消防	164,100	7,967,055.00	0.20
32	603129	春风动力	25,100	4,342,300.00	0.11
33	300679	电连技术	79,900	4,194,750.00	0.10
34	002472	双环传动	152,000	4,192,160.00	0.10
35	300487	蓝晓科技	40,900	4,022,515.00	0.10
36	605305	中际联合	20,600	1,983,574.00	0.05
37	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.04

38	002555	三七互娱	15,500	418,810.00	0.01
39	688148	芳源股份	11,860	403,240.00	0.01
40	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
41	688776	国光电气	1,447	267,680.53	0.01
42	301096	百诚医药	2,714	231,152.38	0.01
43	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.00
44	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.00
45	301052	果麦文化	2,520	89,331.48	0.00
46	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
47	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
48	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.00
49	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
50	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
51	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
52	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
53	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
54	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
55	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
56	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
57	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
58	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
59	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
60	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
61	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
62	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
63	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
64	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
65	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
66	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
67	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
68	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
69	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
70	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
71	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
72	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
73	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
74	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
75	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
76	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
77	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
78	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
79	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00

80	301188	力诺特玻	647	13, 250. 56	0.00
81	301138	华研精机	285	12, 785. 10	0.00
82	301026	浩通科技	203	12, 734. 19	0.00
83	301126	达嘉维康	662	12, 730. 26	0.00
84	301185	鸥玛软件	578	12, 230. 48	0.00
85	301013	利和兴	471	12, 104. 70	0.00
86	301021	英诺激光	290	12, 014. 70	0.00
87	301092	争光股份	323	11, 472. 96	0.00
88	301048	金鹰重工	843	10, 925. 28	0.00
89	301028	东亚机械	733	9, 895. 50	0.00
90	300774	倍杰特	444	9, 359. 52	0.00
91	301040	中环海陆	241	9, 280. 91	0.00
92	301078	孩子王	756	9, 177. 84	0.00
93	301062	上海艾录	523	8, 896. 23	0.00
94	301193	家联科技	297	8, 654. 58	0.00
95	301025	读客文化	403	8, 414. 64	0.00
96	300814	中富电路	328	7, 832. 64	0.00
97	301055	张小泉	355	7, 731. 90	0.00
98	301198	喜悦智行	262	7, 650. 40	0.00
99	301030	仕净科技	242	7, 627. 84	0.00
100	301016	雷尔伟	275	7, 128. 00	0.00
101	301098	金埔园林	307	6, 806. 19	0.00
102	301033	迈普医学	108	6, 476. 76	0.00
103	301049	超越科技	196	6, 452. 32	0.00
104	301032	新柴股份	513	6, 417. 63	0.00
105	301004	嘉益股份	312	6, 389. 76	0.00
106	301056	森赫股份	572	6, 343. 48	0.00
107	301036	双乐股份	205	6, 135. 65	0.00
108	301041	金百泽	215	6, 065. 15	0.00
109	301083	百胜智能	416	5, 911. 36	0.00
110	300854	中兰环保	203	5, 539. 87	0.00
111	301063	海锅股份	153	5, 524. 83	0.00
112	001234	泰慕士	333	5, 504. 49	0.00
113	301038	深水规院	266	5, 381. 18	0.00
114	301059	金三江	259	4, 998. 70	0.00
115	301027	华蓝集团	286	4, 761. 90	0.00
116	301037	保立佳	193	4, 682. 18	0.00
117	301053	远信工业	155	4, 460. 90	0.00
118	301057	汇隆新材	218	4, 146. 36	0.00
119	301068	大地海洋	144	4, 086. 72	0.00
120	301079	邵阳液压	140	3, 474. 80	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	601899	紫金矿业	514,524,240.69	98.85
2	603986	兆易创新	493,078,042.91	94.73
3	002466	天齐锂业	488,971,610.58	93.94
4	300059	东方财富	464,906,236.74	89.32
5	000063	中兴通讯	381,276,679.30	73.25
6	002594	比亚迪	335,418,402.69	64.44
7	603799	华友钴业	324,984,605.20	62.44
8	603501	韦尔股份	320,152,572.48	61.51
9	002415	海康威视	279,646,164.10	53.73
10	601012	隆基股份	276,607,165.08	53.14
11	000568	泸州老窖	274,059,408.33	52.65
12	300124	汇川技术	272,189,153.08	52.29
13	002648	卫星化学	269,697,113.16	51.82
14	600048	保利发展	262,241,326.13	50.38
15	600519	贵州茅台	256,509,450.40	49.28
16	600089	特变电工	221,313,405.66	42.52
17	600438	通威股份	213,291,724.95	40.98
18	002371	北方华创	197,965,165.00	38.03
19	600188	兖矿能源	197,399,825.25	37.93
20	600570	恒生电子	194,001,395.77	37.27
21	601919	中远海控	191,118,761.84	36.72
22	300033	同花顺	180,803,225.06	34.74
23	002460	赣锋锂业	177,674,440.01	34.14
24	600487	亨通光电	162,614,329.99	31.24
25	002475	立讯精密	159,373,484.15	30.62
26	300073	当升科技	152,293,619.25	29.26
27	600406	国电南瑞	147,027,372.96	28.25
28	300748	金力永磁	140,851,833.21	27.06
29	002129	中环股份	136,057,671.40	26.14
30	600383	金地集团	132,908,354.84	25.54
31	000039	中集集团	131,619,711.55	25.29
32	600399	抚顺特钢	130,454,050.15	25.06
33	002241	歌尔股份	130,433,950.00	25.06
34	000858	五粮液	130,282,398.43	25.03
35	002221	东华能源	124,385,385.69	23.90
36	000807	云铝股份	120,711,672.98	23.19
37	300496	中科创达	111,812,690.21	21.48

38	002202	金风科技	110,739,156.97	21.28
39	600989	宝丰能源	109,957,921.04	21.13
40	600808	马钢股份	104,565,580.00	20.09
41	601688	华泰证券	104,351,924.64	20.05
42	600030	中信证券	104,351,398.43	20.05
43	000776	广发证券	104,285,600.96	20.04
44	300171	东富龙	104,251,603.30	20.03
45	002541	鸿路钢构	102,796,522.43	19.75
46	600885	宏发股份	101,445,796.91	19.49
47	002250	联化科技	98,252,287.32	18.88
48	000792	盐湖股份	98,175,315.00	18.86
49	300450	先导智能	97,915,230.23	18.81
50	601668	中国建筑	97,367,214.00	18.71
51	002064	华峰化学	96,583,302.85	18.56
52	603659	璞泰来	95,397,122.15	18.33
53	002493	荣盛石化	92,339,016.26	17.74
54	600166	福田汽车	90,837,779.04	17.45
55	600884	杉杉股份	90,055,578.21	17.30
56	600900	长江电力	89,816,250.38	17.26
57	300207	欣旺达	89,233,404.17	17.14
58	600395	盘江股份	86,941,805.68	16.70
59	603308	应流股份	83,542,350.05	16.05
60	000596	古井贡酒	83,090,566.00	15.96
61	002203	海亮股份	83,030,892.04	15.95
62	600703	三安光电	81,998,742.92	15.75
63	300750	宁德时代	77,377,398.12	14.87
64	603259	药明康德	76,172,789.65	14.63
65	002709	天赐材料	74,591,698.80	14.33
66	300747	锐科激光	73,465,655.90	14.11
67	000988	华工科技	73,166,180.73	14.06
68	600563	法拉电子	73,012,329.50	14.03
69	600010	包钢股份	72,448,684.38	13.92
70	000423	东阿阿胶	71,899,028.46	13.81
71	000059	华锦股份	69,213,334.45	13.30
72	600036	招商银行	67,690,703.99	13.01
73	300724	捷佳伟创	67,398,800.14	12.95
74	300122	智飞生物	66,997,912.68	12.87
75	000762	西藏矿业	66,760,903.00	12.83
76	000651	格力电器	66,186,131.40	12.72
77	600549	厦门钨业	65,759,933.15	12.63
78	601965	中国汽研	65,575,157.36	12.60
79	600970	中材国际	65,424,604.40	12.57

80	600057	厦门象屿	63,644,159.43	12.23
81	000002	万科A	62,890,462.05	12.08
82	000933	神火股份	62,567,770.40	12.02
83	300142	沃森生物	60,218,628.40	11.57
84	000983	山西焦煤	58,896,150.24	11.32
85	002080	中材科技	57,921,117.98	11.13
86	603236	移远通信	56,772,930.20	10.91
87	000625	长安汽车	55,717,231.20	10.70
88	601666	平煤股份	55,438,817.48	10.65
89	300034	钢研高纳	55,137,321.74	10.59
90	002727	一心堂	54,589,433.20	10.49
91	603993	洛阳钼业	54,267,678.00	10.43
92	000513	丽珠集团	53,554,004.57	10.29
93	002013	中航机电	52,072,669.75	10.00
94	600754	锦江酒店	52,067,351.79	10.00
95	002508	老板电器	50,037,072.60	9.61
96	600845	宝信软件	49,722,825.00	9.55
97	688012	中微公司	49,571,216.28	9.52
98	000001	平安银行	48,202,856.18	9.26
99	601636	旗滨集团	46,845,275.39	9.00
100	601838	成都银行	45,159,835.96	8.68
101	600216	浙江医药	44,788,888.04	8.61
102	600985	淮北矿业	44,482,212.04	8.55
103	601601	中国太保	44,309,313.42	8.51
104	000975	银泰黄金	43,629,430.93	8.38
105	603613	国联股份	42,852,221.00	8.23
106	600577	精达股份	42,127,191.75	8.09
107	601166	兴业银行	41,901,025.00	8.05
108	601577	长沙银行	41,821,453.51	8.03
109	601225	陕西煤业	41,551,161.00	7.98
110	000519	中兵红箭	41,371,689.78	7.95
111	600196	复星医药	41,185,851.30	7.91
112	002643	万润股份	40,925,121.62	7.86
113	002714	牧原股份	40,140,369.60	7.71
114	603279	景津环保	40,000,362.87	7.69
115	002245	蔚蓝锂芯	39,850,768.63	7.66
116	600273	嘉化能源	38,990,746.27	7.49
117	002079	苏州固锝	38,237,961.38	7.35
118	688777	中控技术	38,085,303.11	7.32
119	603855	华荣股份	38,019,773.10	7.30
120	600810	神马股份	37,523,932.85	7.21
121	688006	杭可科技	37,467,866.87	7.20

122	688388	嘉元科技	36,966,740.70	7.10
123	600988	赤峰黄金	35,709,404.95	6.86
124	600029	南方航空	34,518,537.77	6.63
125	601111	中国国航	34,514,379.00	6.63
126	001979	招商蛇口	34,460,336.15	6.62
127	600782	新钢股份	34,408,764.20	6.61
128	601318	中国平安	34,050,878.00	6.54
129	300035	中科电气	31,290,000.00	6.01
130	601369	陕鼓动力	31,188,051.64	5.99
131	300390	天华超净	31,164,497.00	5.99
132	600862	中航高科	31,030,823.53	5.96
133	600210	紫江企业	30,981,481.00	5.95
134	601311	骆驼股份	30,938,674.55	5.94
135	600258	首旅酒店	30,182,338.15	5.80
136	300054	鼎龙股份	29,705,233.29	5.71
137	600183	生益科技	29,622,454.90	5.69
138	601009	南京银行	29,527,192.18	5.67
139	002091	江苏国泰	29,419,393.00	5.65
140	688521	芯原股份	28,617,071.38	5.50
141	300979	华利集团	28,404,942.08	5.46
142	601633	长城汽车	27,707,496.67	5.32
143	603060	国检集团	26,634,177.89	5.12
144	688083	中望软件	25,621,560.16	4.92
145	300253	卫宁健康	25,151,953.00	4.83
146	688408	中信博	25,107,103.43	4.82
147	002555	三七互娱	25,076,773.28	4.82
148	300919	中伟股份	24,833,188.95	4.77
149	002484	江海股份	24,526,431.21	4.71
150	002745	木林森	24,449,593.64	4.70
151	002859	洁美科技	23,612,260.91	4.54
152	300115	长盈精密	23,014,838.08	4.42
153	300474	景嘉微	22,843,342.60	4.39
154	600803	新奥股份	22,437,298.27	4.31
155	600522	中天科技	22,352,958.79	4.29
156	002738	中矿资源	22,136,137.79	4.25
157	300408	三环集团	21,985,547.00	4.22
158	600009	上海机场	21,916,039.06	4.21
159	603806	福斯特	21,685,883.07	4.17
160	300036	超图软件	21,421,535.25	4.12
161	300682	朗新科技	21,270,766.24	4.09
162	600171	上海贝岭	21,262,316.69	4.09
163	002353	杰瑞股份	21,078,539.66	4.05

164	300451	创业慧康	20,985,731.75	4.03
165	300114	中航电测	18,916,540.64	3.63
166	003021	兆威机电	18,720,068.00	3.60
167	600006	东风汽车	18,551,541.88	3.56
168	002044	美年健康	18,518,809.01	3.56
169	300829	金丹科技	17,903,849.40	3.44
170	002436	兴森科技	16,664,080.87	3.20
171	603733	仙鹤股份	15,846,133.00	3.04
172	300601	康泰生物	14,860,595.00	2.86
173	002340	格林美	14,224,722.00	2.73
174	000921	海信家电	13,862,948.00	2.66
175	688023	安恒信息	13,848,758.93	2.66
176	688682	霍莱沃	13,786,357.15	2.65
177	002895	川恒股份	13,496,197.00	2.59
178	002833	弘亚数控	12,976,447.80	2.49
179	603979	金诚信	12,804,867.40	2.46
180	600765	中航重机	12,462,582.68	2.39
181	603187	海容冷链	12,307,272.20	2.36
182	688696	极米科技	11,949,214.40	2.30
183	600110	诺德股份	11,901,211.00	2.29
184	002867	周大生	11,888,989.34	2.28
185	688007	光峰科技	11,888,278.55	2.28
186	603156	养元饮品	11,567,842.08	2.22
187	688008	澜起科技	11,018,416.68	2.12
188	002179	中航光电	10,771,997.00	2.07
189	000739	普洛药业	10,766,748.00	2.07
190	600976	健民集团	10,722,527.34	2.06
191	600702	舍得酒业	10,698,879.00	2.06
192	300014	亿纬锂能	10,668,430.60	2.05
193	002756	永兴材料	10,526,536.96	2.02
194	603212	赛伍技术	10,494,632.00	2.02
195	002920	德赛西威	10,460,856.00	2.01
196	601969	海南矿业	10,416,175.00	2.00

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	483,236,709.74	92.84
2	002466	天齐锂业	442,038,742.55	84.93

3	603986	兆易创新	375,991,899.08	72.24
4	000063	中兴通讯	352,158,972.02	67.66
5	002594	比亚迪	352,075,641.62	67.64
6	603799	华友钴业	297,610,854.08	57.18
7	000568	泸州老窖	284,087,780.00	54.58
8	300124	汇川技术	283,694,026.16	54.51
9	002415	海康威视	281,820,212.76	54.15
10	601012	隆基股份	262,487,889.06	50.43
11	600089	特变电工	258,813,455.54	49.72
12	601899	紫金矿业	250,655,766.79	48.16
13	600188	兖矿能源	234,241,250.49	45.00
14	600438	通威股份	211,574,622.96	40.65
15	002371	北方华创	195,976,777.20	37.65
16	601919	中远海控	185,763,218.16	35.69
17	002460	赣锋锂业	184,995,904.66	35.54
18	603501	韦尔股份	178,044,472.10	34.21
19	300073	当升科技	170,729,440.43	32.80
20	000807	云铝股份	168,919,539.00	32.45
21	002475	立讯精密	168,882,810.87	32.45
22	600406	国电南瑞	150,650,590.60	28.94
23	000858	五粮液	150,284,018.46	28.87
24	600487	亨通光电	147,737,809.58	28.38
25	002129	中环股份	145,988,372.49	28.05
26	000039	中集集团	138,689,663.80	26.65
27	300748	金力永磁	136,689,572.82	26.26
28	002202	金风科技	123,693,654.87	23.76
29	300033	同花顺	123,347,332.03	23.70
30	002241	歌尔股份	122,815,015.02	23.60
31	002221	东华能源	120,754,381.77	23.20
32	600884	杉杉股份	117,475,721.04	22.57
33	600395	盘江股份	110,133,307.88	21.16
34	600808	马钢股份	103,785,284.34	19.94
35	600399	抚顺特钢	102,157,557.00	19.63
36	600030	中信证券	100,005,311.00	19.21
37	300450	先导智能	97,050,195.70	18.65
38	601688	华泰证券	96,900,557.00	18.62
39	600989	宝丰能源	94,162,797.50	18.09
40	000983	山西焦煤	93,726,655.83	18.01
41	603259	药明康德	92,930,590.55	17.85
42	600563	法拉电子	92,453,022.55	17.76
43	000776	广发证券	90,903,979.73	17.47
44	603659	璞泰来	90,259,258.30	17.34

45	300207	欣旺达	87,932,245.63	16.89
46	000933	神火股份	87,800,202.32	16.87
47	600036	招商银行	87,333,845.32	16.78
48	600519	贵州茅台	82,940,553.26	15.94
49	300122	智飞生物	81,776,288.01	15.71
50	002064	华峰化学	81,264,283.34	15.61
51	002493	荣盛石化	80,851,186.50	15.53
52	600166	福田汽车	78,761,925.29	15.13
53	000596	古井贡酒	78,480,841.08	15.08
54	300750	宁德时代	78,215,327.02	15.03
55	000423	东阿阿胶	77,075,486.77	14.81
56	603308	应流股份	76,255,199.00	14.65
57	600010	包钢股份	76,243,156.00	14.65
58	002203	海亮股份	74,960,967.51	14.40
59	000988	华工科技	74,599,351.76	14.33
60	601666	平煤股份	74,453,239.19	14.30
61	300724	捷佳伟创	72,808,629.16	13.99
62	600057	厦门象屿	72,670,316.20	13.96
63	600970	中材国际	72,312,637.00	13.89
64	002709	天赐材料	72,137,752.95	13.86
65	300747	锐科激光	70,769,766.18	13.60
66	600549	厦门钨业	70,555,414.00	13.56
67	000762	西藏矿业	66,812,887.12	12.84
68	600845	宝信软件	64,783,522.11	12.45
69	000001	平安银行	63,749,703.60	12.25
70	600703	三安光电	61,365,072.00	11.79
71	000651	格力电器	61,006,391.27	11.72
72	000002	万科A	60,922,656.27	11.70
73	300496	中科创达	60,793,283.74	11.68
74	601965	中国汽研	57,433,664.16	11.03
75	000059	华锦股份	56,195,135.00	10.80
76	600985	淮北矿业	56,146,968.39	10.79
77	688012	中微公司	54,566,751.08	10.48
78	300142	沃森生物	54,149,716.07	10.40
79	002013	中航机电	54,028,515.75	10.38
80	002080	中材科技	53,069,260.40	10.20
81	603993	洛阳钼业	52,743,623.00	10.13
82	300034	钢研高纳	51,662,405.56	9.93
83	601166	兴业银行	51,464,494.14	9.89
84	601636	旗滨集团	49,782,777.00	9.56
85	601838	成都银行	47,669,271.00	9.16
86	000625	长安汽车	47,002,190.80	9.03

87	000513	丽珠集团	46,934,524.30	9.02
88	002245	蔚蓝锂芯	45,372,854.04	8.72
89	600754	锦江酒店	45,120,086.12	8.67
90	000519	中兵红箭	44,340,577.45	8.52
91	002508	老板电器	43,684,823.70	8.39
92	601225	陕西煤业	41,812,754.00	8.03
93	002727	一心堂	41,783,622.91	8.03
94	600273	嘉化能源	40,323,754.00	7.75
95	601601	中国太保	39,669,282.70	7.62
96	000975	银泰黄金	39,260,886.86	7.54
97	688006	杭可科技	38,227,621.53	7.34
98	688388	嘉元科技	38,019,370.64	7.30
99	002250	联化科技	37,993,470.00	7.30
100	603613	国联股份	36,986,127.18	7.11
101	600216	浙江医药	36,472,760.20	7.01
102	600196	复星医药	36,359,318.70	6.99
103	601577	长沙银行	35,923,534.94	6.90
104	600577	精达股份	34,800,919.76	6.69
105	688777	中控技术	33,030,869.38	6.35
106	688083	中望软件	32,650,750.81	6.27
107	601318	中国平安	32,625,890.14	6.27
108	600210	紫江企业	32,451,356.94	6.23
109	600782	新钢股份	32,310,722.20	6.21
110	002079	苏州固锝	32,270,094.78	6.20
111	600570	恒生电子	31,928,334.34	6.13
112	600810	神马股份	31,691,405.87	6.09
113	300035	中科电气	31,519,921.00	6.06
114	600900	长江电力	31,481,281.00	6.05
115	601009	南京银行	31,271,913.00	6.01
116	601633	长城汽车	30,902,593.24	5.94
117	600029	南方航空	30,840,987.72	5.93
118	002484	江海股份	30,795,327.00	5.92
119	002091	江苏国泰	30,551,423.83	5.87
120	600862	中航高科	30,496,277.38	5.86
121	600988	赤峰黄金	30,449,340.00	5.85
122	000725	京东方 A	30,324,445.00	5.83
123	601111	中国国航	29,759,040.97	5.72
124	300390	天华超净	29,738,194.58	5.71
125	002867	周大生	29,139,769.22	5.60
126	600183	生益科技	28,592,180.00	5.49
127	300054	鼎龙股份	28,046,143.34	5.39
128	601311	骆驼股份	27,661,052.30	5.31

129	600258	首旅酒店	27,624,991.73	5.31
130	601369	陕鼓动力	27,125,814.59	5.21
131	002738	中矿资源	26,987,773.51	5.19
132	300451	创业慧康	26,469,120.25	5.09
133	002745	木林森	25,122,205.37	4.83
134	002555	三七互娱	25,034,089.17	4.81
135	603060	国检集团	24,678,073.85	4.74
136	300979	华利集团	24,051,188.16	4.62
137	300919	中伟股份	23,853,278.90	4.58
138	603606	东方电缆	23,432,492.85	4.50
139	300408	三环集团	22,998,334.82	4.42
140	002859	洁美科技	22,982,180.06	4.42
141	603806	福斯特	22,447,740.46	4.31
142	688521	芯原股份	22,245,483.43	4.27
143	300253	卫宁健康	21,955,007.00	4.22
144	600009	上海机场	21,913,380.36	4.21
145	300682	朗新科技	21,810,835.75	4.19
146	002353	杰瑞股份	21,441,770.00	4.12
147	600522	中天科技	20,828,642.38	4.00
148	300474	景嘉微	20,128,343.90	3.87
149	600803	新奥股份	19,822,567.16	3.81
150	002044	美年健康	19,790,847.10	3.80
151	300115	长盈精密	19,753,054.38	3.80
152	688408	中信博	19,544,327.21	3.75
153	002340	格林美	19,539,815.88	3.75
154	688682	霍莱沃	18,975,045.29	3.65
155	300114	中航电测	18,688,427.13	3.59
156	600171	上海贝岭	18,000,782.00	3.46
157	002643	万润股份	17,519,226.15	3.37
158	603979	金诚信	17,110,801.37	3.29
159	600006	东风汽车	16,776,277.36	3.22
160	002436	兴森科技	15,237,293.00	2.93
161	300829	金丹科技	15,124,477.20	2.91
162	600765	中航重机	14,406,398.49	2.77
163	000921	海信家电	14,368,267.00	2.76
164	300014	亿纬锂能	14,349,246.38	2.76
165	688023	安恒信息	14,154,537.71	2.72
166	002920	德赛西威	14,027,374.00	2.70
167	688696	极米科技	14,009,779.49	2.69
168	300601	康泰生物	13,658,131.96	2.62
169	002895	川恒股份	13,096,424.00	2.52
170	600976	健民集团	12,837,800.00	2.47

171	600702	舍得酒业	12,573,112.00	2.42
172	002386	天原股份	12,272,238.99	2.36
173	600110	诺德股份	12,016,416.00	2.31
174	603229	奥翔药业	11,907,502.60	2.29
175	603156	养元饮品	11,649,614.00	2.24
176	002179	中航光电	11,193,971.00	2.15
177	002833	弘亚数控	11,102,964.60	2.13
178	688008	澜起科技	11,054,182.10	2.12
179	000739	普洛药业	11,027,182.00	2.12
180	600581	八一钢铁	10,815,630.00	2.08
181	600779	水井坊	10,606,867.00	2.04
182	601969	海南矿业	10,598,721.00	2.04
183	600882	妙可蓝多	10,466,919.80	2.01

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	16,142,690,511.39
卖出股票收入（成交）总额	13,818,430,780.55

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	189,784,000.00	4.71
	其中：政策性金融债	189,784,000.00	4.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	89,249,212.75	2.22
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	279,033,212.75	6.93

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	210407	21 农发 07	1,100,000	109,824,000.00	2.73
2	210404	21 农发 04	400,000	39,996,000.00	0.99
3	210411	21 农发 11	400,000	39,964,000.00	0.99
4	110047	山鹰转债	184,060	21,984,126.40	0.55
5	110063	鹰 19 转债	183,090	21,882,916.80	0.54

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金尚未在基金合同中明确股指期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与股指期货交易。

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

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金尚未在基金合同中明确国债期货的投资策略、比例限制、信息披露等，本基金暂不参与国债期货交易。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除韦尔股份（股票代码：603501 SH）、21 农发 07（股票代码：210407 CY）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 5 月 6 日，上海韦尔半导体股份有限公司因未及时披露公司重大事件被上海证监局警示【沪证监决[2021]67 号】。

2021 年 4 月 12 日，中国农业发展银行因未依法履行职责被乌审旗住房和城乡建设局罚款人民币 2,479.30 元【乌住建罚决字（2021）002 号】。

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没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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	2,848,367.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,983,900.85
5	应收申购款	4,772,380.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,604,648.61

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110047	山鹰转债	21,984,126.40	0.55
2	110063	鹰 19 转债	21,882,916.80	0.54
3	128081	海亮转债	14,031,089.80	0.35
4	128134	鸿路转债	11,731,956.60	0.29
5	132015	18 中油 EB	5,904,263.30	0.15
6	113042	上银转债	5,359,748.40	0.13

7	113021	中信转债	1,894,332.80	0.05
8	123073	同和转债	1,453,966.80	0.04
9	132009	17 中油 EB	1,162,862.40	0.03

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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 (%)
218,153	6,614.72	940,031,169.41	65.14	502,989,058.03	34.86

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,626,695.98	0.32

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部 门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年6月20日)	743,426,623.31
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	218,646,237.34
本报告期基金总申购份额	1,872,349,024.11
减：本报告期基金总赎回份额	647,975,034.01
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	1,443,020,227.44

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行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

一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第五次会议审议通过：自 2021 年 3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 90,000.00 元。

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未受到任何稽查或处罚。

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	
安信证券	2	12,698,588,2	42.43%	9,032,526.65	39.02%	-

		42.73				
招商证券	2	4,351,683,12 0.38	14.54%	3,965,685.39	17.13%	-
东方财富证券	2	3,258,370,50 0.52	10.89%	2,317,685.67	10.01%	-
中信证券	2	2,643,758,51 6.00	8.83%	2,409,269.74	10.41%	-
中金公司	2	1,810,435,82 5.96	6.05%	1,649,849.68	7.13%	-
华泰证券	2	1,169,574,13 6.99	3.91%	831,918.41	3.59%	-
中信建投	2	951,106,339. 21	3.18%	676,527.86	2.92%	新租
国信证券	1	894,711,251. 40	2.99%	636,424.91	2.75%	-
国泰君安	2	881,798,308. 94	2.95%	627,217.07	2.71%	-
长江证券	2	596,041,007. 15	1.99%	423,956.10	1.83%	-
申万宏源	2	499,238,296. 90	1.67%	454,955.67	1.97%	-
兴业证券	2	171,673,730. 28	0.57%	122,112.51	0.53%	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金管理有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	302,452,806.46	63.54%	1,000,000,000.00	40.26%	-	-
招商证券	31,798,960.41	6.68%	-	-	-	-

东方财富	5,997,793.28	1.26%	401,200,000.00	16.15%	-	-
中信证券	316,508.26	0.07%	-	-	-	-
中金公司	57,204,703.00	12.02%	567,700,000.00	22.86%	-	-
华泰证券	777,902.59	0.16%	-	-	-	-
中信建投	14,028,866.37	2.95%	196,400,000.00	7.91%	-	-
国信证券	23,703,206.10	4.98%	50,000,000.00	2.01%	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
长江证券	3,796,526.07	0.80%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	35,953,141.20	7.55%	268,300,000.00	10.80%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

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	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-22
2	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
3	安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	上海证券报、证券时报	2021-01-29
4	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
5	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 16 只基金新增华金证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-15
6	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-19
7	关于暂停安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	证券时报	2021-03-22
8	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金新增宁波银行股份有限公司为基金销售服务机构的公告	证券时报	2021-03-23
9	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-23

	益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告		
10	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-29
11	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 9 只基金新增上海证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-21
12	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-21
13	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增交通银行股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-04-30
14	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增爱建证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-30
15	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-05-20
16	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-06-26
17	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华融证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-15
18	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增英大证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-15
19	安信基金管理有限责任公司旗下 66 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-20
20	安信基金管理有限责任公司旗下 69 只基中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-08-27
21	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-03
22	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增粤开证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-09-08
23	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-22
24	安信基金管理有限责任公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-22

25	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-10-26
----	--------------------------------	-----------------------	------------

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20210101-20210126	51,299,451.37	27,417,091.22	37,866,491.60	40,850,050.99	2.83

产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

- (1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；
- (2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；
- (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、《安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日