

# 金元顺安元启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：金元顺安基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022 年 03 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 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 .....	6
2.1	基金基本情况 .....	6
2.2	基金产品说明 .....	6
2.3	基金管理人和基金托管人.....	7
2.4	信息披露方式 .....	7
2.5	其他相关资料 .....	7
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	9
3.1	主要会计数据和财务指标.....	9
3.2	基金净值表现 .....	10
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	11
§4	管理人报告 .....	12
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9	管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	18
4.10	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
§5	托管人报告 .....	19
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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 .....	19
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.....	19

§6	审计报告 .....	20
6.1	审计报告基本信息 .....	20
6.2	审计报告的基本内容 .....	20
§7	年度财务报表 .....	23
7.1	资产负债表 .....	23
7.2	利润表 .....	25
7.3	所有者权益（基金净值）变动表 .....	27
7.4	报表附注 .....	28
§8	投资组合报告 .....	62
8.1	期末基金资产组合情况 .....	62
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	62
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 .....	64
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
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 .....	73
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 .....	74
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 .....	74
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 .....	74
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	74
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12	投资组合报告附注 .....	75
§9	基金份额持有人信息 .....	79
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	79
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	79
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 .....	79
§10	开放式基金份额变动 .....	80
§11	重大事件揭示 .....	81
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	81
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 .....	81
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	81

11.4	基金投资策略的改变 .....	81
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	82
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.....	82
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
11.8	其他重大事件 .....	84
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	88
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.....	88
12.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	88
§13	备查文件目录 .....	89
13.1	备查文件目录 .....	89
13.2	存放地点 .....	89
13.3	查阅方式 .....	89

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	金元顺安元启灵活配置混合
基金主代码	004685
交易代码	004685
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 11 月 14 日
基金管理人	金元顺安基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	192,930,518.55 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过积极灵活的资产配置，在严格控制投资组合风险的基础上，力争实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金通过发掘经济发展及结构转型过程中所显现的投资机会，力争获取持续稳健的投资超额收益。在资产配置方面，本基金根据国内外宏观经济、政策环境、市场运行趋势等因素确定基金的大类资产配置比例。在权益资产投资方面，采用“自上而下”的方式，选择与政策调控、经济发展，深化改革具有相关性较高的行业中的个股进行配置；同时，结合“自下而上”的方式，精选上市公司股票作为投资方向。在债券投资方面，选择具有票息优势的债券品种作为主要的债券投资标的。最后，在综合考量投资组合的风险收益特征基础上，本基金完成组合构建。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%

风险收益特征	本基金系混合型基金，属于中等风险、中等收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
--------	--

### 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		金元顺安基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	封涌	罗菲菲
	联系电话	021-68881801	010-58560666
	电子邮箱	service@jysa99.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-666-0666	95568
传真		021-68881875	010-57093382
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		200120	100031
法定代表人		任开宇	高迎欣

### 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.jysa99.com
基金年度报告备置地点	本基金管理人、基金托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
注册登记机构	金元顺安基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区花园石桥路33号花旗集团大厦3608室



## §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	98,396,695.18	84,011,586.04	14,164,755.71
本期利润	126,226,528.22	73,115,493.29	15,415,379.70
加权平均基金份额本期利润	0.7363	0.5625	0.1567
本期加权平均净值利润率	35.03%	35.94%	13.90%
本期基金份额净值增长率	39.85%	50.21%	13.55%
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	275,171,174.09	123,855,988.11	24,935,144.59
期末可供分配基金份额利润	1.4263	0.8544	0.2225
期末基金资产净值	500,318,521.21	268,815,637.92	138,378,163.84
期末基金份额净值	2.5933	1.8544	1.2345
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	159.33%	85.44%	23.45%

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、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（为期末余额，不是当期发生数）；

3、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；

4、所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；

### 3.2 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	14.41%	0.83%	1.11%	0.39%	13.30%	0.44%
过去六个月	25.60%	0.83%	-1.89%	0.51%	27.49%	0.32%
过去一年	39.85%	0.84%	-1.21%	0.59%	41.06%	0.25%
过去三年	138.53%	0.92%	32.30%	0.64%	106.23%	0.28%
自基金合同生效起至今	159.33%	0.79%	16.21%	0.64%	143.12%	0.15%

#### 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

金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2017年11月14日-2021年12月31日)



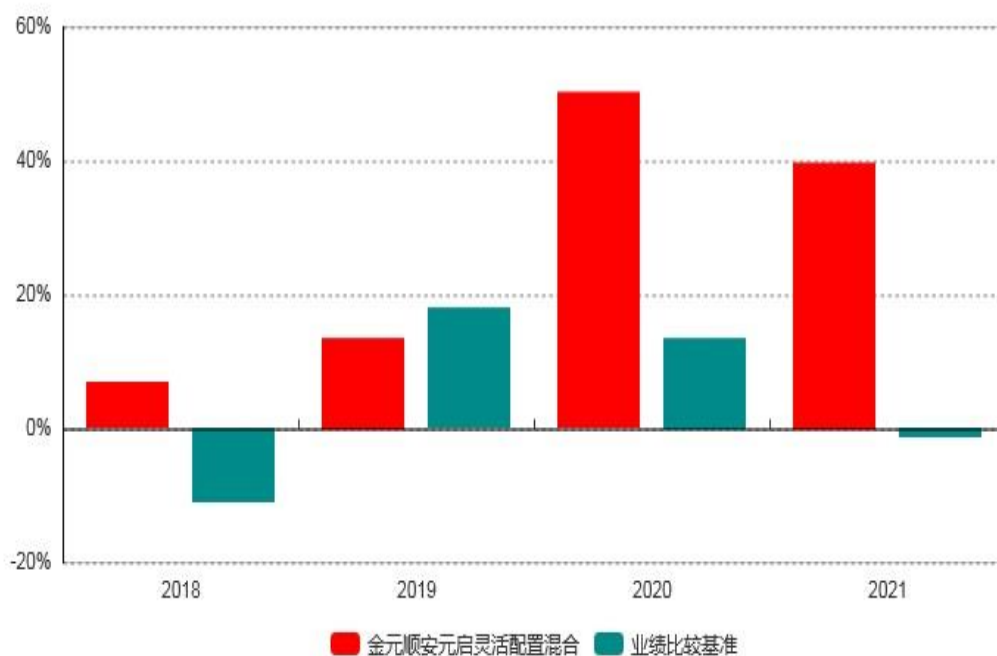
注：

1、本基金合同生效日为 2017 年 11 月 14 日，业绩基准累计增长率以 2017 年 11 月 13 日指数为基准；

2、本基金的投资组合比例为股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 0%—95%，权证投资比例占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券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；

3、本基金业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%”。

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



### 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过利润分配。

## §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

金元比联基金管理有限公司（以下简称“金元比联”、“公司”或“本基金管理人”，系金元顺安基金管理有限公司前身）成立于 2006 年 11 月，由金元证券股份有限公司（以下简称“金元证券”）与比利时联合资产管理公司（以下简称“比联资管”）共同发起设立的中外合资基金管理有限公司。公司总部设在上海陆家嘴，旗下设立北京分公司及子公司——上海金元百利资产管理有限公司。

2012 年 03 月，经中国证监会核准，比联资管将所持有的金元比联 49% 股权转让于惠理基金管理香港有限公司（以下简称“惠理香港”），公司更名为金元惠理基金管理有限公司（以下简称“金元惠理”）。

2012 年 10 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本增加至 24,500 万元。

2016 年 03 月，经中国证监会核准，惠理香港将所持有的金元惠理 49% 股权转让于上海泉意金融信息服务有限公司（以下简称“泉意金融”），公司更名为金元顺安基金管理有限公司（以下简称“金元顺安”）。

2017 年 11 月，经中国证监会核准，公司双方股东按持股比例向公司增资人民币 9,500 万元，公司注册资本增加至 34,000 万元。

2020 年 04 月，公司股东泉意金融更名为“上海前易信息咨询服务有限公司”。

金元顺安始终坚持以“取信于市场、取信于社会”作为行为准则，遵循“诚实信用，勤勉尽责，以专业经营方式管理和运作基金财产和客户资产，在合法、合规的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，从而使公司稳步、健康发展”的投资理念。遵守法律、行政法规和中国证券监督管理委员会的规定，遵守社会公德、商业道德，诚实守信，遵循基金份额持有人利益优先、公平对待其管理的不同基金财产和客户资产的原则，接受政府和社会公众的监督，承担社会责任。

截止至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人管理金元顺安宝石动力混合型证券投资基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰利债券型证券投资基金、金元顺安价值增长混合型证券投资基金、金元顺安消费主题混合型证券投资基金、金元顺安优质精选灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安丰祥债券型证券投资基金、金元顺安金元宝货币市场基金、金元顺安沅楹债券型证券投资基金、金元顺安金通宝货币市场基金、金元顺安桉盛债券型证券投资基金、金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金、金元顺安沅顺定期开放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泰定期开

放债券型发起式证券投资基金、金元顺安沅泉债券型证券投资基金、金元顺安泓丰纯债 87 个月定期开放债券型证券投资基金和金元顺医疗健康混合型证券投资基金共 17 只开放式证券投资基金。

#### 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		
缪玮彬	本基金基金经理	2017-11-14	-	23 年	总经理助理，金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，复旦大学经济学硕士。曾任华泰资产管理有限公司固定收益部总经理，宝盈基金管理有限公司研究员，金元证券有限责任公司资产管理部总经理助理，联合证券有限责任公司高级投资经理，华宝信托投资有限责任公司投资经理。2016 年 10 月加入金元顺安基金管理有限公司，历任金元顺安价值增长混合型证券投资基金和金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理。23 年基金等金融行业从业经历，具有基金从业资格。

注：

- 1、此处的任职日期、离任日期均指公司做出决定之日，若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日；
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 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

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》，建立了科学完善的制度和流程，从事前、事中、事后等各个业务环节严格控制不同基金之间可能存在的利益输送，覆盖了全部开放式基金及特定客户资产管理组合；涵盖了境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的各个环节。

在投资环节，本基金管理人建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。在交易环节，为确保交易的公平执行，本基金管理人交易管理实行集中交易，投资组合的投资决策过程和交易执行过程分开，各投资组合的所有证券买卖活动须通过交易部集中统一完成。在报告分析环节，本基金管理人每季度和每年对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异、对连续四个季度期间内、不同时间窗内（日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差进行分析，根据收益率差异和交易价差的大小，说明是否符合公平交易的原则，由投资组合经理、分管风险管理副总经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人高度重视投资者利益保护。本报告期内，本基金管理人严格遵守公司投资交易业务流程及公平交易制度。公司投资交易行为监控体系由风险管理部、监察稽核部和交易部监督，确保公平交易制度的执行和实现。

本报告期内，本基金管理人对旗下开放式基金与其他投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《金元顺安基金管理有限公司公平交易管理制度》及其他相关法律法规和公司内部规章制度，制定了《金元顺安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，涵盖了所有可投资证券的一级市场申购、二级市场交易所公开竞价交易、

交易所大宗交易、银行间债券交易以及非公开发行股票申购、以公司名义进行的一级市场债券交易等可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本基金管理人采用定量分析和定性分析相结合的方式，建立并严格执行有效的异常交易日常监控制度，形成定期交易监控报告，按照报告路线实行及时报告的机制。本报告期内，未发现异常交易行为。

#### 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

2021 年仍旧是全球新冠疫情肆虐的一年，在变异毒株高传染性的影响下，全球感染人数增长较多。但是在疫苗的推广和保护下，以及新变异毒株的低致死率影响下，国际新冠疫情防控呈现了相对 2020 年趋好的趋势。为保持经济的稳定发展，世界各国逐步保持低限度的防控措施并有了放松的迹象，绝大多数经济活动都已经恢复正常，少数受损严重的行业也开始逐步复苏回升。2020 年以来世界发达经济体采取的非常宽松的货币政策虽然有效地支持了经济增长和稳定了就业，但是也带来了资产价格的大幅上涨和严重的通货膨胀，到 2021 年底有不少国家已经提出了退出过度宽松货币政策的意向，有些已经在退出的路上。2021 年我国的零星散发疫情虽然对少数部分经济领域产生负面影响，但整体经济增长仍具有较强的韧性，全球经济的偏热状态带来了旺盛的外需，给经济提供较强支撑，下半年在房地产调控见效的作用下经济下行压力有所增加。虽然原材料价格在高位运行，但是我国的 CPI 保持在合理区间，通胀压力不大，全年货币政策保持了稳健灵活的基调，有力地支持了经济的平稳运行。因此我国债券收益率在全年保持震荡平稳下行，股票市场则全年保持窄幅震荡走势。本基金在报告期内的策略为始终保持股票中高仓位运作，分散化投资，配置方向继续聚焦于低估值行业和疫后复苏行业。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末金元顺安元启灵活配置混合基金份额净值为 2.5933 元；

本报告期内，基金份额净值增长率为 39.85%，同期业绩比较基准收益率为-1.21%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从当前的疫情发展态势来看，整体疫情前景有向好的迹象，全球经济和政策都进入后疫情时代，各项经济活动和政策将回归正常化和常态。迫于经济过热和居高不下的通胀，发达经济体将很快进入宽松货币政策的退出进程，全球经济将逐步降温，从而会对我国的外需产生一定的影响。因此，我国的稳增长力度会有所加大，基建投资的增速会有所增长，房地产调控将更立足于长远稳定目标，短期下行压力将会逐步减弱。总体上来看，宏观经济仍能保持平稳运行，货币政策在一定时期内将为经济提供有力的支持。在此环境下，债券收益率会保持稳定，而股票市场会继续保持活跃状态。本基金在

报告期内的策略将继续注重于权益配置，保持灵活主动，继续保持明显地分散化投资，在股票的选择方面侧重较低的估值水平和公司经营环境好转等因素。

#### 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，本基金管理人持续将规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益作为工作的基点，进一步完善内部控制制度和流程体系，推动各项法规、内控体系和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过定期检查、报表揭示、专项检查、人员询问等方法，独立地开展公司的监察稽核工作，并就在监察稽核过程中发现的问题，及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，公司重点开展的监察稽核工作包括：

1、依据相关法律、法规和公司实际运作情况，修订和完善公司各项内部管理制度，为保障基金份额持有人的利益，保障公司的规范运作提供制度保障。

2、开展对公司各项业务的日常监察稽核工作，查找各项业务中的风险漏洞，保证公司各项业务的合规运作，重点加强了对于各业务环节的专项稽核。

3、加强对公司投资、交易、研究、会计估值、注册登记、市场营销等各项业务过程中的法律、合规及投资风险的防范与控制，在合法合规的基础上，充分保障基金份额持有人的利益。

4、开展反洗钱、反商业贿赂等各项工作，并通过开展法规培训等形式，提高员工的合规意识和风险责任意识。

通过上述工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金份额持有人谋求最大利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工

###### 1、估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由分管运营的副总经理、基金事务部、投资研究部、交易部、风险管理部、监察稽核部等部门总监组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责：

- （1）制定估值制度并在必要时修改；



(2) 确保估值方法符合现行法规;

(3) 批准证券估值的步骤和方法;

(4) 对异常情况做出决策。

分管运营的副总经理担任估值工作小组的组长, 分管运营的副总经理在基金事务部总监或者其他两个估值小组成员的建议下, 可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组 2/3 或以上多数票通过。

## 2、基金事务部的职责分工

基金事务部负责日常证券资产估值。该部门和公司投资部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后, 基金事务部定期将证券估值表向估值工作小组报告, 至少每月一次。

基金事务部职责:

(1) 获得独立、完整的证券价格信息;

(2) 每日证券估值;

(3) 检查价格波动并进行一般准确性评估;

(4) 向交易员或基金经理核实价格异常波动, 并在必要时向估值工作小组报告;

(5) 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

(6) 对估值调整和人工估值进行记录;

(7) 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金事务部总监认为必要时, 可以提议召开估值工作小组会议。

## 3、投资研究部的职责分工

(1) 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问询;

(2) 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

(3) 评价并确认基金事务部提供的估值报告;

(4) 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

## 4、交易部的职责分工

(1) 对基金事务部的证券价格信息需求做出即时回应;

(2) 通知基金事务部关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

(3) 评价并确认基金事务部提供的估值报告。

## 5、风险管理部、监察稽核部的职责分工

(1) 监督证券的整个估值过程;

(2) 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

- (3) 确保公司的估值制度和符合现行法律、法规的要求；
- (4) 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价值的风险；
- (5) 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯；
- (6) 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

#### **4.7.2 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突**

本公司参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### **4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明**

本报告期内，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### **4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第60657709_B13号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	金元顺安元启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>我们审计了金元顺安元启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，后附的金元顺安元启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，公允反映了金元顺安元启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，我们独立于金元顺安元启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。</p> <p>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	-
其他事项	-

<p>其他信息</p>	<p>金元顺安元启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。</p> <p>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>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<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，管理层负责评估金元顺安元启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>治理层负责监督金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，</p>

	<p>设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。-</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对金元顺安元启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金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露 李莉
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
审计报告日期	2021-03-25

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：金元顺安元启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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	11,812,262.08	3,509,905.43
结算备付金		6,863,253.78	3,323,302.91
存出保证金		106,895.83	126,303.61
交易性金融资产	7.4.7.2	403,713,570.88	256,811,984.46
其中：股票投资		377,268,970.88	211,055,219.46
基金投资		-	-
债券投资		26,444,600.00	45,756,765.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	78,000,000.00	6,000,000.00
应收证券清算款		-	2,852,014.84
应收利息	7.4.7.5	332,064.93	469,898.77
应收股利		-	-

应收申购款		7,339,060.16	81,799.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		508,167,107.66	273,175,209.95
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,605,546.87	2,994,725.11
应付赎回款		2,561,659.34	713,680.85
应付管理人报酬		553,696.26	356,249.14
应付托管费		36,913.10	23,749.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	30,770.88	96,166.94
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	60,000.00	175,000.00
负债合计		7,848,586.45	4,359,572.03



所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	192,930,518.55	144,959,649.81
未分配利润	7.4.7.10	307,388,002.66	123,855,988.11
所有者权益合计		500,318,521.21	268,815,637.92
负债和所有者权益总计		508,167,107.66	273,175,209.95

注：

报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.5933 元，基金份额总额 192,930,518.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		<b>133,558,847.71</b>	<b>77,819,627.85</b>
1.利息收入		1,961,147.40	1,458,758.95
其中：存款利息收入	7.4.7.11	116,358.52	63,462.28
债券利息收入		580,620.21	1,130,672.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,264,168.67	264,624.08
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		101,702,547.04	86,173,055.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	99,133,270.21	85,219,079.57

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	131,678.72	-124,651.59
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	2,437,598.11	1,078,627.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	27,829,833.04	-10,896,092.75
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,065,320.23	1,083,906.31
<b>减：二、费用</b>		<b>7,332,319.49</b>	<b>4,704,134.56</b>
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,381,464.85	3,039,129.84
2.托管费	7.4.10.2.2	358,764.41	202,608.79
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.19	1,390,735.51	1,031,515.00
5.利息支出		139.66	237,805.89
其中：卖出回购金融资产支出		139.66	237,805.89
6.税金及附加		0.06	0.04
7.其他费用	7.4.7.20	201,215.00	193,075.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>126,226,528.22</b>	<b>73,115,493.29</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>126,226,528.22</b>	<b>73,115,493.29</b>

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 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）	144,959,649.81	123,855,988.11	268,815,637.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	126,226,528.22	126,226,528.22
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）	47,970,868.74	57,305,486.33	105,276,355.07
其中：1.基金申购款	249,518,011.48	285,795,882.93	535,313,894.41
2.基金赎回款	-201,547,142.74	-228,490,396.60	-430,037,539.34
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）	192,930,518.55	307,388,002.66	500,318,521.21
项目	上年度可比期间 2020 年 01 月 01 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）	112,088,428.78	26,289,735.06	138,378,163.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	73,115,493.29	73,115,493.29
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）	32,871,221.03	24,450,759.76	57,321,980.79

其中：1.基金申购款	127,224,908.82	95,866,140.24	223,091,049.06
2.基金赎回款	-94,353,687.79	-71,415,380.48	-165,769,068.27
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）	144,959,649.81	123,855,988.11	268,815,637.92

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：

邝晓星

符刃

季泽

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

金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2017]658 号文《关于准予金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人金元顺安基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2017 年 11 月 14 日正式生效，首次设立募集规模为 200,112,777.30 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人与注册登记机构均为金元顺安基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金通过积极灵活的资产配置，在严格控制投资组合风险的基础上，力争实现基金资产的稳健增值。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款以及其他银行存款）、非金融企业债务融资工具、同业存单货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围和投资比例规定。

本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×50%+中债综合指数收益率×50%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“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《中国证监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>》、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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 01 月 01 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、贷款和应收款项；

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

## 2、金融负债分类

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

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### 1、股票投资

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

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

#### 2、债券投资

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

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### 3、权证投资

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

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

### 4、股指/国债期货投资

买入或卖出股指/国债期货投资于成交日确认为股指/国债期货投资。股指/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

### 5、分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述 2、3 中相关原则进行计算；

### 6、回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

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

4、如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### **7.4.4.7 实收基金**

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

#### **7.4.4.8 损益平准金**

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

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未



分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1、存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

2、债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

3、资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

8、股指/国债期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

9、权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

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

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

12、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等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次分配比例不得低于收益分配基准日（即基金可供分配利润计算截止日）每份基金份额可供分配利润的 20%；若基金合同生效不满 3 个月，可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的从其规定。

#### **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**

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 04 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 09 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### **7.4.6.2 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 05 月 01 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同

业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 01 月 01 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 01 月 01 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。

#### **7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加**

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### **7.4.6.4 企业所得税**

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 01 月 01 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 09 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 01 月 01 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 09 月 08 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 7.4.7 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	11,812,262.08	3,509,905.43
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	11,812,262.08	3,509,905.43

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		358,956,230.03	377,268,970.88	18,312,740.85
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	26,465,600.00	26,444,600.00	-21,000.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	26,465,600.00	26,444,600.00	-21,000.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		385,421,830.03	403,713,570.88	18,291,740.85
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		220,675,030.75	211,055,219.46	-9,619,811.29
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	45,675,045.90	45,756,765.00	81,719.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	45,675,045.90	45,756,765.00	81,719.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	266,350,076.65	256,811,984.46	-9,538,092.19

#### 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均无衍生金融资产/负债余额。

#### 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	78,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	78,000,000.00	-
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	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-

##### 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均未持有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	1,511.00	266.79
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	3,088.50	1,495.50
应收债券利息	359,584.72	471,812.26
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-32,167.39	-3,732.58
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	48.10	56.80
合计	332,064.93	469,898.77

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 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	30,770.88	96,166.94
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	30,770.88	96,166.94

#### 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	60,000.00	175,000.00
合计	60,000.00	175,000.00

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	144,959,649.81	144,959,649.81
本期申购	249,518,011.48	249,518,011.48
本期赎回（以“-”号填列）	-201,547,142.74	-201,547,142.74
本期末	192,930,518.55	192,930,518.55

注：

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	124,825,345.37	-969,357.26	123,855,988.11
本期利润	98,396,695.18	27,829,833.04	126,226,528.22
本期基金份额交易产生的变动数	51,949,133.54	5,356,352.79	57,305,486.33



其中：基金申购款	275,354,766.40	10,441,116.53	285,795,882.93
基金赎回款	-223,405,632.86	-5,084,763.74	-228,490,396.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	275,171,174.09	32,216,828.57	307,388,002.66

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	24,667.43	18,803.96
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	89,882.19	43,127.47
其他	1,808.90	1,530.85
合计	116,358.52	63,462.28

#### 7.4.7.12 股票投资收益-买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	801,015,382.87	500,954,544.93
减：卖出股票成本总额	701,882,112.66	415,735,465.36
买卖股票差价收入	99,133,270.21	85,219,079.57

## 7.4.7.13 债券投资收益

## 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年12 月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	131,678.72	-124,651.59
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	131,678.72	-124,651.59

## 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12 月31日	2020年01月01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	73,557,332.35	309,705,005.29
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	72,157,125.90	307,059,308.67
减：应收利息总额	1,268,527.73	2,770,348.21
买卖债券差价收入	131,678.72	-124,651.59

## 7.4.7.13.3 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均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.15 衍生工具收益**

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,437,598.11	1,078,627.36
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,437,598.11	1,078,627.36

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	27,829,833.04	-10,896,092.75
——股票投资	27,932,552.14	-10,979,611.85
——债券投资	-102,719.10	83,519.10
——资产支持证券投资	-	-
——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	27,829,833.04	-10,896,092.75

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
基金赎回费收入	2,062,278.07	1,083,841.84
转换费收入	3,042.16	-
其他	-	64.47
合计	2,065,320.23	1,083,906.31

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	1,390,735.51	1,031,515.00
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,390,735.51	1,031,515.00

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	55,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	215.00	75.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他费用	3,000.00	-
合计	201,215.00	193,075.00

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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
金元顺安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司	基金托管人
金元证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
上海前易信息咨询服务有限公司	基金管理人的股东
上海金元百利资产管理有限公司	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**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

**7.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,381,464.85	3,039,129.84
其中：支付销售机构的客户维护费	1,131,183.12	471,712.80

注：

基金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：

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ ，

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。

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可

抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	358,764.41	202,608.79

注：

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。

计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 2 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 2 个工作日内支付。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

#### 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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

**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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**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 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 01 月 01 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
	中国民生银行股份有限公司	11,812,262.08	24,667.43	3,509,905.43

注：

除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2021 年度获得的利息收入为人民币 89,882.19 元（2020 年度：人民币 43,127.47 元），2021 年末结算备付金余额为人民币 6,863,253.78 元（2020 年末：人民币 3,323,302.91 元）。

**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直接购入关联方承销的证券。

**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无其他关联交易事项的说明。

**7.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期末未进行利润分配。

**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
601	中国	2021-	2022-	新股流	4.53	4.27	394,011	1,784,869.	1,682,426.9	-



728	电信	08-11	02-21	通受限				83	7	
688 176	亚虹 医药	2021- 12-29	2022- 01-07	新股未 上市	22.98	22.98	16,100	369,978.0 0	369,978.00	-
688 190	云路 股份	2021- 11-18	2022- 05-26	新股流 通受限	46.63	110.05	2,380	110,979.4 0	261,919.00	-
688 246	嘉和 美康	2021- 12-07	2022- 06-14	新股流 通受限	39.50	35.04	6,906	272,787.0 0	241,986.24	-
688 262	国芯 科技	2021- 12-28	2022- 01-06	新股未 上市	41.98	41.98	3,805	159,733.9 0	159,733.90	-
301 136	招标 股份	2021- 12-31	2022- 01-11	新股未 上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
688 071	华依 科技	2021- 07-21	2022- 02-07	新股流 通受限	13.73	61.06	1,101	15,116.73	67,227.06	-
301 050	雷电 微力	2021- 08-17	2022- 02-24	新股流 通受限	60.64	234.57	187	11,339.68	43,864.59	-
301 155	海力 风电	2021- 11-17	2022- 05-24	新股流 通受限	60.66	116.58	369	22,383.54	43,018.02	-
301 029	怡合 达	2021- 07-14	2022- 01-24	新股流 通受限	14.14	89.74	462	6,532.68	41,459.88	-
688 701	卓锦 股份	2021- 09-08	2022- 03-16	新股流 通受限	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
301 127	天源 环保	2021- 12-23	2022- 06-30	新股流 通受限	12.03	19.21	1,521	18,297.63	29,218.41	-
301 035	润丰 股份	2021- 07-21	2022- 01-28	新股流 通受限	22.04	56.23	495	10,909.80	27,833.85	-
301 211	亨迪 药业	2021- 12-14	2022- 06-22	新股流 通受限	25.80	35.13	735	18,963.00	25,820.55	-
301 069	凯盛 新材	2021- 09-16	2022- 03-28	新股流 通受限	5.17	44.15	539	2,786.63	23,796.85	-
301 149	隆华 新材	2021- 11-03	2022- 05-10	新股流 通受限	10.07	19.07	1,214	12,224.98	23,150.98	-
301 039	中集 车辆	2021- 07-01	2022- 01-10	新股流 通受限	6.96	12.44	1,844	12,834.24	22,939.36	-
301	华润	2021-	2022-	新股流	10.45	12.19	1,774	18,538.30	21,625.06	-

090	材料	10-19	04-26	通受限						
301 221	光庭 信息	2021- 12-15	2022- 06-22	新股流 通受限	69.89	90.93	224	15,655.36	20,368.32	-
301 018	申菱 环境	2021- 06-28	2022- 01-07	新股流 通受限	8.29	26.02	782	6,482.78	20,347.64	-
301 087	可孚 医疗	2021- 10-15	2022- 04-25	新股流 通受限	93.09	75.43	261	24,296.49	19,687.23	-
300 994	久祺 股份	2021- 08-02	2022- 02-14	新股流 通受限	11.90	45.42	420	4,998.00	19,076.40	-
301 100	风光 股份	2021- 12-10	2022- 06-17	新股流 通受限	27.81	34.57	547	15,212.07	18,909.79	-
301 101	明月 镜片	2021- 12-09	2022- 06-16	新股流 通受限	26.91	50.43	371	9,983.61	18,709.53	-
301 180	万祥 科技	2021- 11-09	2022- 05-16	新股流 通受限	12.20	28.34	654	7,978.80	18,534.36	-
301 060	兰卫 医学	2021- 09-06	2022- 03-14	新股流 通受限	4.17	30.91	587	2,447.79	18,144.17	-
301 168	通灵 股份	2021- 12-02	2022- 06-10	新股流 通受限	39.08	54.86	329	12,857.32	18,048.94	-
301 111	粤万 年青	2021- 11-30	2022- 06-07	新股流 通受限	10.48	43.93	379	3,971.92	16,649.47	-
301 166	优宁 维	2021- 12-21	2022- 06-28	新股流 通受限	86.06	95.89	173	14,888.38	16,588.97	-
301 089	拓新 药业	2021- 10-20	2022- 04-27	新股流 通受限	19.11	69.92	220	4,204.20	15,382.40	-
301 138	华研 精机	2021- 12-08	2022- 06-15	新股流 通受限	26.17	53.55	285	7,458.45	15,261.75	-
301 185	鸥玛 软件	2021- 11-11	2022- 05-19	新股流 通受限	11.88	25.59	578	6,866.64	14,791.02	-
301 046	能辉 科技	2021- 08-10	2022- 02-17	新股流 通受限	8.34	48.96	290	2,418.60	14,198.40	-
301 126	达嘉 维康	2021- 11-30	2022- 06-07	新股流 通受限	12.37	21.35	662	8,188.94	14,133.70	-
301	奥尼	2021-	2022-	新股流	66.18	57.13	247	16,346.46	14,111.11	-

189	电子	12-21	06-28	通受限						
301 199	迈赫 股份	2021- 11-30	2022- 06-07	新股流 通受限	29.28	33.50	402	11,770.56	13,467.00	-
301 020	密封 科技	2021- 06-28	2022- 01-06	新股流 通受限	10.64	30.38	421	4,479.44	12,789.98	-
301 093	华兰 股份	2021- 10-21	2022- 05-05	新股流 通受限	58.08	50.21	250	14,520.00	12,552.50	-
301 021	英诺 激光	2021- 06-28	2022- 01-06	新股流 通受限	9.46	41.39	290	2,743.40	12,003.10	-
301 190	善水 科技	2021- 12-17	2022- 06-24	新股流 通受限	27.85	28.36	419	11,669.15	11,882.84	-
301 179	泽宇 智能	2021- 12-01	2022- 06-08	新股流 通受限	43.99	52.42	226	9,941.74	11,846.92	-
301 078	孩子 王	2021- 09-30	2022- 04-14	新股流 通受限	5.77	15.34	756	4,362.12	11,597.04	-
301 096	百诚 医药	2021- 12-13	2022- 06-20	新股流 通受限	79.60	80.15	139	11,064.40	11,140.85	-
301 048	金鹰 重工	2021- 08-11	2022- 02-28	新股流 通受限	4.13	12.95	843	3,481.59	10,916.85	-
301 092	争光 股份	2021- 10-21	2022- 05-05	新股流 通受限	36.31	35.50	300	10,893.00	10,650.00	-
301 028	东亚 机械	2021- 07-12	2022- 01-20	新股流 通受限	5.31	13.49	733	3,892.23	9,888.17	-
301 182	凯旺 科技	2021- 12-16	2022- 06-23	新股流 通受限	27.12	33.34	294	7,973.28	9,801.96	-
301 133	金钟 股份	2021- 11-19	2022- 05-26	新股流 通受限	14.33	34.23	286	4,098.38	9,789.78	-
301 045	天禄 科技	2021- 08-06	2022- 02-14	新股流 通受限	15.81	28.34	335	5,296.35	9,493.90	-
300 774	倍杰 特	2021- 07-26	2022- 02-16	新股流 通受限	4.57	20.90	444	2,029.08	9,279.60	-
301 040	中环 海陆	2021- 07-26	2022- 02-07	新股流 通受限	13.57	38.41	241	3,270.37	9,256.81	-
301	喜悦	2021-	2022-	新股流	21.76	34.24	262	5,701.12	8,970.88	-

198	智行	11-25	06-02	通受限						
301 108	洁雅 股份	2021- 11-25	2022- 06-06	新股流 通受限	57.27	56.01	160	9,163.20	8,961.60	-
301 025	读客 文化	2021- 07-06	2022- 01-24	新股流 通受限	1.55	20.84	403	624.65	8,398.52	-
300 814	中富 电路	2021- 08-04	2022- 02-14	新股流 通受限	8.40	23.80	328	2,755.20	7,806.40	-
301 055	张小 泉	2021- 08-26	2022- 03-07	新股流 通受限	6.90	21.69	355	2,449.50	7,699.95	-
301 081	严牌 股份	2021- 10-13	2022- 04-20	新股流 通受限	12.95	18.33	403	5,218.85	7,386.99	-
301 033	迈普 医学	2021- 07-15	2022- 01-26	新股流 通受限	15.14	59.93	108	1,635.12	6,472.44	-
301 049	超越 科技	2021- 08-17	2022- 02-24	新股流 通受限	19.34	32.88	196	3,790.64	6,444.48	-
301 032	新柴 股份	2021- 07-15	2022- 01-24	新股流 通受限	4.97	12.49	513	2,549.61	6,407.37	-
301 056	森赫 股份	2021- 08-27	2022- 03-07	新股流 通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301 083	百胜 智能	2021- 10-13	2022- 04-21	新股流 通受限	9.08	15.23	416	3,777.28	6,335.68	-
301 036	双乐 股份	2021- 07-21	2022- 02-16	新股流 通受限	23.38	29.80	205	4,792.90	6,109.00	-
301 041	金百 泽	2021- 08-02	2022- 02-11	新股流 通受限	7.31	28.18	215	1,571.65	6,058.70	-
301 072	中捷 精工	2021- 09-22	2022- 03-29	新股流 通受限	7.46	33.38	181	1,350.26	6,041.78	-
300 854	中兰 环保	2021- 09-08	2022- 03-16	新股流 通受限	9.96	27.28	203	2,021.88	5,537.84	-
301 063	海锅 股份	2021- 09-09	2022- 03-24	新股流 通受限	17.40	36.13	153	2,662.20	5,527.89	-
001 234	泰慕 士	2021- 12-31	2022- 01-11	新股未 上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301	深水	2021-	2022-	新股流	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-

038	规院	07-22	02-07	通受限						
301 059	金三 江	2021- 09-03	2022- 03-14	新股流 通受限	8.09	19.29	259	2,095.31	4,996.11	-
301 027	华蓝 集团	2021- 07-08	2022- 01-19	新股流 通受限	11.45	16.61	286	3,274.70	4,750.46	-
301 037	保立 佳	2021- 07-21	2022- 02-07	新股流 通受限	14.82	24.17	193	2,860.26	4,664.81	-
301 073	君亭 酒店	2021- 09-22	2022- 03-30	新股流 通受限	12.24	32.06	144	1,762.56	4,616.64	-
301 053	远信 工业	2021- 08-25	2022- 03-01	新股流 通受限	11.87	28.77	155	1,839.85	4,459.35	-
301 057	汇隆 新材	2021- 08-31	2022- 03-09	新股流 通受限	8.03	19.01	218	1,750.54	4,144.18	-
301 068	大地 海洋	2021- 09-16	2022- 03-28	新股流 通受限	13.98	28.36	144	2,013.12	4,083.84	-
301 079	邵阳 液压	2021- 10-11	2022- 04-19	新股流 通受限	11.92	29.17	140	1,668.80	4,083.80	-
<b>7.4.12.1.2 受限证券类别：债券</b>										
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
113 052	兴业 转债	2021- 12-28	2022- 01-14	新债未 上市	100.00	100.00	4,530	453,000.0 0	453,000.00	-

注：

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的权证。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告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 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人将风险管理融入公司各个业务层面的全面控制过程之中，并建立了三道防线：以各岗位职责为基础，形成第一道防线；通过相关岗位之间、相关部门之间相互监督制衡，形成第二道防线；由督察长、分管风险管理副总经理、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部对公司各机构、各部门、各岗位、各项业务进行监督、检查、评价，形成的第三道防线。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	25,991,600.00	38,799,495.00
合计	25,991,600.00	38,799,495.00

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据、政策性金融债和超短期融资券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	453,000.00	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	6,957,270.00
合计	453,000.00	6,957,270.00

注：

未评级债券包括国债、中央银行票据及政策性金融债。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度；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。

本基金所持证券均在证券交易所上市，因此，除在附注 7.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、买入返售金融资产等。

##### 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	11,812,262.08	-	-	-	11,812,262.08
结算备付金	6,863,253.78	-	-	-	6,863,253.78
存出保证金	106,895.83	-	-	-	106,895.83
交易性金融资产	26,444,600.00	-	-	377,268,970.88	403,713,570.88
买入返售金融资产	78,000,000.00	-	-	-	78,000,000.00
应收利息	-	-	-	332,064.93	332,064.93
应收申购款	-	-	-	7,339,060.16	7,339,060.16
<b>资产总计</b>	<b>123,227,011.69</b>	-	-	<b>384,940,095.97</b>	<b>508,167,107.66</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	4,605,546.87	4,605,546.87
应付赎回款	-	-	-	2,561,659.34	2,561,659.34
应付管理人报酬	-	-	-	553,696.26	553,696.26
应付托管费	-	-	-	36,913.10	36,913.10
应付交易费用	-	-	-	30,770.88	30,770.88
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>7,848,586.45</b>	<b>7,848,586.45</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>123,227,011.69</b>	-	-	<b>377,091,509.52</b>	<b>500,318,521.21</b>
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
<b>资产</b>					
银行存款	3,509,905.43	-	-	-	3,509,905.43
结算备付金	3,323,302.91	-	-	-	3,323,302.91
存出保证金	126,303.61	-	-	-	126,303.61
交易性金融资产	45,756,765.00	-	-	211,055,219.46	256,811,984.46
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	6,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	2,852,014.84	2,852,014.84
应收利息	-	-	-	469,898.77	469,898.77

应收申购款	-	-	-	81,799.93	81,799.93
<b>资产总计</b>	<b>58,716,276.95</b>	-	-	<b>214,458,933.00</b>	<b>273,175,209.95</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	2,994,725.11	2,994,725.11
应付赎回款	-	-	-	713,680.85	713,680.85
应付管理人报酬	-	-	-	356,249.14	356,249.14
应付托管费	-	-	-	23,749.99	23,749.99
应付交易费用	-	-	-	96,166.94	96,166.94
其他负债	-	-	-	175,000.00	175,000.00
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>4,359,572.03</b>	<b>4,359,572.03</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>58,716,276.95</b>	-	-	<b>210,099,360.97</b>	<b>268,815,637.92</b>

注：

表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1、以中央国债登记结算有限责任公司公布的 2021 年 12 月 31 日和 2020 年 12 月 31 日各债券的基点价值（BP 价值）为主要计算依据；		
	2、假设债券持仓结构保持不变；		
	3、银行存款、结算备付金及存出保证金以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产利息收益在交易时已确定，不受利率变化影响；		
	4、该利率敏感性分析不包括在交易所交易的可转换债券和可交换债券。		
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
	基准利率增加一个基点	-999.49	-2,494.96

	基准利率减少一个基点	999.56	2,495.15
--	------------	--------	----------

注：

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债均以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金主要投资于证券交易所上市的证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 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	377,268,970.88	75.41	211,055,219.46	78.51
交易性金融资产——基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产——债券投资	-	-	-	-
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	377,268,970.88	75.41	211,055,219.46	78.51

注：

本基金投资组合中股票资产及存托凭证占基金资产的比例为 0%—95%，权证投资比例占基金资产净值的比例不超过 3%，现金或到期日在一年以内的政府债券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。于资产负债表日，本基金面临的整体市场价格风险列示如上。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即与基金投资组合中股票投资的贝塔系数紧密相关；		
	2、以下分析中，除市场指标发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
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
	沪深 300 指数上涨 5%	3,341,574.29	8,983,652.16
	沪深 300 指数下跌 5%	-3,341,574.29	-8,983,652.16

注：

本基金管理人运用资本——资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

###### 7.4.14.1.1 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银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

###### 7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为人民币 373,449,444.36 元，第二层次的余额为人民币 27,055,265.83 元，第三层次的余

额为人民币 3,208,860.69 元。(2020 年 12 月 31 日,属于第一层次的余额为人民币 206,927,889.14 元,属于第二层次的余额为人民币 45,935,730.79 元,属于第三层次的余额为人民币 3,948,364.53 元。)

#### 7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关证券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次,确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

#### 7.4.14.1.2.3 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期末余额为人民币 3,208,860.69 元,期初余额为人民币 3,948,364.53 元,本期减少人民币 739,503.84 元。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号-金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号-金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号-套期会计》和《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》(以下合称"新金融工具准则")相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

除公允价值和执行新金融工具准则外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 25 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	377,268,970.88	74.24
	其中：股票	377,268,970.88	74.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,444,600.00	5.20
	其中：债券	26,444,600.00	5.20
	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	78,000,000.00	15.35
	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	18,675,515.86	3.68
8	其他各项资产	7,778,020.92	1.53
9	合计	508,167,107.66	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

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	4,259,337.00	0.85

B	采矿业	4,193,046.00	0.84
C	制造业	178,068,916.10	35.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,705,407.49	2.54
E	建筑业	25,136,903.20	5.02
F	批发和零售业	50,828,438.21	10.16
G	交通运输、仓储和邮政业	21,711,346.50	4.34
H	住宿和餐饮业	8,240,213.64	1.65
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,131,153.37	0.43
J	金融业	-	-
K	房地产业	16,264,553.02	3.25
L	租赁和商务服务业	21,086,974.95	4.21
M	科学研究和技术服务业	7,508,223.70	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	16,372,445.01	3.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,144.17	0.00
R	文化、体育和娱乐业	8,743,868.52	1.75
S	综合	-	-
	合计	377,268,970.88	75.41

### 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投资的股票。

## 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	600713	南京医药	990,800	4,864,828.00	0.97
2	002492	恒基达鑫	810,850	4,824,557.50	0.96
3	002678	珠江钢琴	660,800	4,757,760.00	0.95
4	002205	国统股份	564,800	4,591,824.00	0.92
5	002347	泰尔股份	900,000	4,581,000.00	0.92
6	002761	浙江建投	596,000	4,481,920.00	0.90
7	002905	金逸影视	593,340	4,473,783.60	0.89
8	601518	吉林高速	1,655,400	4,469,580.00	0.89
9	600829	人民同泰	662,600	4,452,672.00	0.89
10	002116	中国海诚	623,500	4,451,790.00	0.89
11	002769	普路通	662,245	4,443,663.95	0.89
12	600469	风神股份	871,800	4,350,282.00	0.87
13	600302	标准股份	858,800	4,302,588.00	0.86
14	600630	龙头股份	767,900	4,300,240.00	0.86
15	002181	粤传媒	944,900	4,299,295.00	0.86
16	000430	张家界	754,600	4,293,674.00	0.86
17	002209	达意隆	628,000	4,289,240.00	0.86
18	600819	耀皮玻璃	767,100	4,280,418.00	0.86
19	603366	日出东方	842,500	4,271,475.00	0.85
20	603999	读者传媒	777,680	4,261,686.40	0.85
21	002696	百洋股份	720,700	4,259,337.00	0.85
22	000419	通程控股	929,400	4,256,652.00	0.85
23	002295	精艺股份	603,400	4,247,936.00	0.85
24	000605	渤海股份	758,140	4,238,002.60	0.85



25	603817	海峡环保	680,200	4,237,646.00	0.85
26	300163	先锋新材	1,077,200	4,233,396.00	0.85
27	600617	国新能源	999,943	4,229,758.89	0.85
28	600113	浙江东日	631,040	4,227,968.00	0.85
29	600156	华升股份	1,006,300	4,226,460.00	0.84
30	600689	上海三毛	592,501	4,224,532.13	0.84
31	002388	新亚制程	749,200	4,217,996.00	0.84
32	600448	华纺股份	1,242,520	4,212,142.80	0.84
33	002787	华源控股	689,221	4,211,140.31	0.84
34	002613	北玻股份	1,143,700	4,208,816.00	0.84
35	300387	富邦股份	627,300	4,202,910.00	0.84
36	600232	金鹰股份	776,830	4,202,650.30	0.84
37	000548	湖南投资	1,046,200	4,195,262.00	0.84
38	002828	贝肯能源	488,700	4,193,046.00	0.84
39	603316	诚邦股份	759,540	4,192,660.80	0.84
40	600665	天地源	1,350,400	4,186,240.00	0.84
41	000619	海螺型材	792,800	4,185,984.00	0.84
42	600250	南纺股份	838,700	4,185,113.00	0.84
43	002187	广百股份	479,100	4,177,752.00	0.84
44	600828	茂业商业	1,156,100	4,173,521.00	0.83
45	000151	中成股份	490,000	4,169,900.00	0.83
46	601500	通用股份	780,500	4,167,870.00	0.83
47	000428	华天酒店	1,322,300	4,165,245.00	0.83
48	000759	中百集团	831,150	4,164,061.50	0.83
49	000014	沙河股份	524,700	4,155,624.00	0.83
50	002593	日上集团	1,015,000	4,151,350.00	0.83
51	300155	安居宝	595,400	4,149,938.00	0.83
52	603839	安正时尚	475,400	4,140,734.00	0.83

53	000868	安凯客车	1,027,300	4,140,019.00	0.83
54	002103	广博股份	840,400	4,134,768.00	0.83
55	600190	锦州港	1,450,700	4,134,495.00	0.83
56	603321	梅轮电梯	580,100	4,130,312.00	0.83
57	002877	智能自控	595,720	4,122,382.40	0.82
58	600858	银座股份	794,200	4,121,898.00	0.82
59	603021	山东华鹏	798,400	4,119,744.00	0.82
60	002887	绿茵生态	420,492	4,116,616.68	0.82
61	002660	茂硕电源	510,800	4,111,940.00	0.82
62	002855	捷荣技术	451,838	4,107,207.42	0.82
63	600678	四川金顶	680,700	4,104,621.00	0.82
64	600082	海泰发展	1,353,300	4,100,499.00	0.82
65	603528	多伦科技	586,600	4,100,334.00	0.82
66	600693	东百集团	1,012,100	4,088,884.00	0.82
67	002040	南京港	661,400	4,087,452.00	0.82
68	300210	森远股份	1,083,200	4,083,664.00	0.82
69	601007	金陵饭店	711,600	4,070,352.00	0.81
70	000779	甘咨询	454,500	4,054,140.00	0.81
71	600724	宁波富达	1,101,427	4,042,237.09	0.81
72	603041	美思德	325,580	4,033,936.20	0.81
73	002307	北新路桥	944,300	4,032,161.00	0.81
74	000715	中兴商业	824,200	4,030,338.00	0.81
75	000573	粤宏远 A	1,264,300	4,020,474.00	0.80
76	603790	雅运股份	379,780	3,999,083.40	0.80
77	603828	柯利达	978,300	3,991,464.00	0.80
78	002150	通润装备	632,960	3,987,648.00	0.80
79	002713	东易日盛	646,460	3,982,193.60	0.80
80	000524	岭南控股	534,400	3,981,280.00	0.80

81	002809	红墙股份	381,200	3,979,728.00	0.80
82	000978	桂林旅游	715,600	3,957,268.00	0.79
83	002591	恒大高新	690,100	3,933,570.00	0.79
84	002616	长青集团	645,200	3,922,816.00	0.78
85	002397	梦洁股份	989,200	3,907,340.00	0.78
86	600692	亚通股份	665,907	3,902,215.02	0.78
87	603183	建研院	577,403	3,343,163.37	0.67
88	603615	茶花股份	348,300	3,019,761.00	0.60
89	002571	德力股份	358,500	2,484,405.00	0.50
90	603608	天创时尚	335,540	2,187,720.80	0.44
91	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.34
92	600543	莫高股份	190,000	1,324,300.00	0.26
93	688176	亚虹医药	16,100	369,978.00	0.07
94	688190	云路股份	2,380	261,919.00	0.05
95	688246	嘉和美康	6,906	241,986.24	0.05
96	688262	国芯科技	3,805	159,733.90	0.03
97	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
98	688071	华依科技	1,101	67,227.06	0.01
99	301050	雷电微力	187	43,864.59	0.01
100	301155	海力风电	369	43,018.02	0.01
101	301029	怡合达	462	41,459.88	0.01
102	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.01
103	301127	C天源	1,521	29,218.41	0.01
104	301035	润丰股份	495	27,833.85	0.01
105	301211	亨迪药业	735	25,820.55	0.01
106	301069	凯盛新材	539	23,796.85	0.00
107	301149	隆华新材	1,214	23,150.98	0.00
108	301039	中集车辆	1,844	22,939.36	0.00

109	301090	华润材料	1,774	21,625.06	0.00
110	301221	光庭信息	224	20,368.32	0.00
111	301018	申菱环境	782	20,347.64	0.00
112	301087	可孚医疗	261	19,687.23	0.00
113	300994	久祺股份	420	19,076.40	0.00
114	301100	风光股份	547	18,909.79	0.00
115	301101	明月镜片	371	18,709.53	0.00
116	301180	万祥科技	654	18,534.36	0.00
117	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
118	301060	兰卫医学	587	18,144.17	0.00
119	301168	通灵股份	329	18,048.94	0.00
120	301111	粤万年青	379	16,649.47	0.00
121	301166	C优宁维	173	16,588.97	0.00
122	301089	拓新药业	220	15,382.40	0.00
123	301138	华研精机	285	15,261.75	0.00
124	301185	鸥玛软件	578	14,791.02	0.00
125	301046	能辉科技	290	14,198.40	0.00
126	301126	达嘉维康	662	14,133.70	0.00
127	301189	C奥尼	247	14,111.11	0.00
128	301199	迈赫股份	402	13,467.00	0.00
129	301020	密封科技	421	12,789.98	0.00
130	301093	华兰股份	250	12,552.50	0.00
131	301021	英诺激光	290	12,003.10	0.00
132	301190	善水科技	419	11,882.84	0.00
133	301179	泽宇智能	226	11,846.92	0.00
134	301078	孩子王	756	11,597.04	0.00
135	301096	百诚医药	139	11,140.85	0.00
136	301048	金鹰重工	843	10,916.85	0.00

137	301092	争光股份	300	10,650.00	0.00
138	301028	东亚机械	733	9,888.17	0.00
139	301182	凯旺科技	294	9,801.96	0.00
140	301133	金钟股份	286	9,789.78	0.00
141	301045	天禄科技	335	9,493.90	0.00
142	300774	倍杰特	444	9,279.60	0.00
143	301040	中环海陆	241	9,256.81	0.00
144	301198	喜悦智行	262	8,970.88	0.00
145	301108	洁雅股份	160	8,961.60	0.00
146	301025	读客文化	403	8,398.52	0.00
147	300814	中富电路	328	7,806.40	0.00
148	301055	张小泉	355	7,699.95	0.00
149	301081	严牌股份	403	7,386.99	0.00
150	301033	迈普医学	108	6,472.44	0.00
151	301049	超越科技	196	6,444.48	0.00
152	301032	新柴股份	513	6,407.37	0.00
153	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
154	301083	百胜智能	416	6,335.68	0.00
155	301036	双乐股份	205	6,109.00	0.00
156	301041	金百泽	215	6,058.70	0.00
157	301072	中捷精工	181	6,041.78	0.00
158	300854	中兰环保	203	5,537.84	0.00
159	301063	海锅股份	153	5,527.89	0.00
160	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
161	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
162	301059	金三江	259	4,996.11	0.00
163	301027	华蓝集团	286	4,750.46	0.00
164	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

165	301037	保立佳	193	4,664.81	0.00
166	301073	君亭酒店	144	4,616.64	0.00
167	301053	远信工业	155	4,459.35	0.00
168	301057	汇隆新材	218	4,144.18	0.00
169	301068	大地海洋	144	4,083.84	0.00
170	301079	邵阳液压	140	4,083.80	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	600617	国新能源	12,963,745.17	4.82
2	000419	通程控股	8,646,992.00	3.22
3	601500	通用股份	8,311,812.00	3.09
4	603366	日出东方	7,961,276.00	2.96
5	603321	梅轮电梯	7,499,283.00	2.79
6	002397	梦洁股份	7,497,974.00	2.79
7	600829	人民同泰	7,415,388.65	2.76
8	601518	吉林高速	7,402,261.48	2.75
9	601007	金陵饭店	7,401,732.74	2.75
10	300155	安居宝	7,381,802.00	2.75
11	000759	中百集团	7,378,920.50	2.74
12	002307	北新路桥	7,300,433.60	2.72
13	002696	百洋股份	7,193,379.90	2.68
14	002205	国统股份	7,135,987.85	2.65
15	002492	恒基达鑫	7,002,240.50	2.60
16	603828	柯利达	6,976,585.44	2.60

17	603316	诚邦股份	6,928,506.40	2.58
18	603817	海峡环保	6,922,984.00	2.58
19	300466	赛摩智能	6,896,070.00	2.57
20	002713	东易日盛	6,697,832.00	2.49
21	002769	普路通	6,653,978.15	2.48
22	603998	方盛制药	6,628,192.00	2.47
23	600272	开开实业	6,573,810.56	2.45
24	002103	广博股份	6,475,912.00	2.41
25	002388	新亚制程	6,464,495.00	2.40
26	002682	龙洲股份	6,401,274.75	2.38
27	002116	中国海诚	6,387,855.18	2.38
28	002790	瑞尔特	6,362,355.67	2.37
29	002725	跃岭股份	6,269,344.40	2.33
30	000548	湖南投资	5,682,928.00	2.11
31	002264	新华都	5,563,196.00	2.07
32	600828	茂业商业	5,445,857.98	2.03
33	000605	渤海股份	5,396,005.60	2.01

## 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600617	国新能源	10,868,203.00	4.04
2	600272	开开实业	9,722,210.18	3.62
3	002357	富临运业	9,716,376.00	3.61
4	002790	瑞尔特	9,551,401.82	3.55
5	002671	龙泉股份	8,911,705.72	3.32
6	002682	龙洲股份	8,651,779.00	3.22

7	000632	三木集团	8,521,482.00	3.17
8	603058	永吉股份	8,423,572.00	3.13
9	600202	哈空调	8,349,186.80	3.11
10	600706	曲江文旅	7,943,182.60	2.95
11	002691	冀凯股份	7,688,151.44	2.86
12	601199	江南水务	7,687,469.00	2.86
13	300466	赛摩智能	7,416,509.58	2.76
14	600843	上工申贝	7,389,118.00	2.75
15	002725	跃岭股份	7,372,481.20	2.74
16	603998	方盛制药	7,323,719.00	2.72
17	600853	龙建股份	7,290,976.48	2.71
18	000533	顺钠股份	7,186,925.00	2.67
19	002265	西仪股份	7,176,923.79	2.67
20	002059	云南旅游	7,175,251.00	2.67
21	000419	通程控股	7,065,812.00	2.63
22	603366	日出东方	6,939,736.00	2.58
23	603843	正平股份	6,841,533.50	2.55
24	600683	京投发展	6,570,334.35	2.44
25	603117	万林物流	6,254,382.20	2.33
26	601518	吉林高速	6,182,497.28	2.30
27	300164	通源石油	6,132,248.56	2.28
28	603335	迪生力	6,048,118.20	2.25
29	002264	新华都	5,988,035.00	2.23
30	000852	石化机械	5,810,866.30	2.16
31	600361	华联综超	5,745,410.16	2.14
32	600099	林海股份	5,669,570.00	2.11
33	600463	空港股份	5,640,470.30	2.10
34	601798	蓝科高新	5,543,853.00	2.06



## 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	840,163,311.94
卖出股票收入（成交）总额	801,015,382.87

## 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	25,991,600.00	5.20
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	453,000.00	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,444,600.00	5.29

## 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	019654	21国债06	170,000	17,005,100.00	3.40

2	019658	21国债10	90,000	8,986,500.00	1.80
3	113052	兴业转债	4,530	453,000.00	0.09
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 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

本基金本报告期内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投资贵金属。

### 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投资权证。

### 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投资股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 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投资国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、国统股份(002205.SZ)

新疆国统管道股份有限公司(以下简称“公司”或“国统股份”)于2021年7月13日收到中国证券监督管理委员会新疆监管局下发的《关于对新疆国统管道股份有限公司采取出具警示函措施的决定》((2021)第12号)(以下简称“《警示函》(一)”)、《关于对徐永平采取出具警示函措施的决定》((2021)第13号)(以下简称“《警示函》(二)”)、《关于对卢兆东采取出具警示函措施的决定》((2021)第14号)(以下简称“《警示函》(三)”),具体内容如下:

一、《警示函》(一)、《警示函》(二)、《警示函》(三)主要内容:

(一) 经查,公司存在以下违规事项:

2017年7月27日,你公司子公司中材天河(北京)投资有限公司(以下简称“中材天河”)投资设立子公司江西贡江建设管理有限公司,注册资本1.14亿元;2017年8月22日,中材天河注册资本从3亿元增至10亿元;2018年10月25日,你公司投资设立子公司海南国源水务有限公司,注册资本2.31亿。上述投资行为属于《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第40号)第三十条规定的重大事件,公司未履行审议程序及信息披露义务。

2017年5月,中材天河与中太建设集团股份有限公司(以下简称“中太建设”)签订《赣州市章江新区农民返迁房项目K22地块投资建设项目投资合作协议》,工程总投资5.7亿元,后续中材天河和中太建设与业主方赣州城投工程管理有限公司(以下简称“赣州城投”)订立了《赣州市章江新区农民返迁房项目第四标段K22地块投资建设三方协议》,之后中太建设又退出项目、陕西省三和建设工程有限公司(以下简称“陕西三和建设”)加入项目,最后中材天河和陕西三和建设被业主方赣州城投清退。上述订立合同相关事项属于《上市公司信息披露管理办法》(证监会令第40号)第三十条规定的重大事件,公司未履行信息披露义务。

2018年9月28日,你公司公告称中标海南临高县供水工程PPP项目。2019年3月11日,公司与业主方临高县项目管理中心,以及合作方广东省水利水电建设有限公司、福建世锦水务股份有限公司签订《临高县供水工程PPP项目PPP协议(草签版)》(以下简称“临高PPP草签协议”),工程总投资11.98亿元。2019年5月27日,公司与安徽松柏林实业投资有限公司签订《代持股权协议》,国统股份代持安徽松柏林实业投资有限公司在公司子公司海南国源水务有限公司98%的股权,对应出资2.3471亿元。2019年7月9日,公司子公司海南国源水务有限公司与临高县项目管理中心签订《临高县供水工程PPP项目PPP协议(正式版)》,工程总投资11.98亿元。公司后续签订的《临高PPP草签协议》、

《代持股权协议》、《临高县供水工程 PPP 项目 PPP 协议（正式版）》，属于已披露的重大事项发生进展或变化，公司未履行信息披露义务。

2016 年 12 月 27 日，你公司公告称与业主方六盘水大河经济开发区管理委员会、合作方核工业华东建设工程集团公司等三家公司签订了《六盘水高中教育城配套基础设施建设项目投资协议》，项目总投资 7.21 亿元。但 2017 年 4 月 27 日，你公司又与上述业主方、合作方签订了《关于解除〈六盘水高中教育城配套基础设施建设项目投资勘察设计施工总承包合同〉的协议》。2017 年 10 月 21 日，公司公告称收到业主方土默特左旗城发投资经营有限责任公司发来的土默特左旗哈素海新村建设一期工程 PPP 项目中标通知书，确定公司与合作方中交隧道工程局有限公司为该项目的成交中标人，中标金额 20.5 亿元。但 2019 年，你公司又与上述业主方、合作方签订了《解除项目协议书》，解除土默特左旗哈素海旅游新村建设 PPP 项目中标合作关系。上述项目的解除属于已披露的重大事项发生进展或变化，公司未履行信息披露义务。

2019 年 5 月 28 日，你公司向中国农业发展银行桐城市支行出具《关于确保按期还本付息的函》，为控股子公司安徽中材立源投资有限公司向中国农业发展银行桐城市支行申请的 4 亿元项目贷款承担连带还款责任，上述担保行为属于《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号）第三十条规定的重大事件，公司未履行审议程序及信息披露义务。

## （二）针对国统股份

你公司上述重大投资行为和对外担保未履行审议程序及信息披露义务、订立重要合同和已披露的重大事项发生进展或变化未履行信息披露义务，违反了《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号）第二条、第三十条、第三十二条、第三十三条，以及《关于规范上市公司对外担保行为的通知》第一条、第四条有关规定。

鉴于你公司已对上述事项予以补充披露并制定了明确的整改方案，根据《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号）第五十九条规定，我局决定对你公司采取出具警示函的行政监管措施，并计入证券期货市场诚信档案。你公司应当充分吸取教训，督促相关董事、监事、高级管理人员加强法律法规学习，提高规范运作水平，忠实、勤勉地履行职责，依法真实、准确、完整、及时、公平地履行信息披露义务，采取有效措施切实整改，切实维护上市公司和中小投资者合法权益。你公司应于收到本决定书之日起 10 日内向我局报送书面报告。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请；也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

## （二）针对相关负责人

1. 徐永平：你于 2008 年 3 月 16 日至 2019 年 10 月 15 日期间担任国统股份董事长，于 2017 年 8 月 16 日至 2019 年 10 月 15 日期间担任国统股份代董事会秘书，未按照《上市公司信息披露管理办法》第三条的规定履行勤勉尽责义务，对国统股份上述违规事项负有主要责任。根据《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号）第五十九条规定，我局决定对你采取出具警示函的行政监管措施，并计入证券期货市场诚信档案。你应于收到本决定书之日起 10 日内向我局报送书面报告。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请；也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

2. 卢兆东：你于 2013 年 6 月 6 日至 2019 年 10 月 20 日期间担任国统股份总经理，于 2016 年 12 月 2 日至 2019 年 1 月 15 日期间担任国统股份代财务总监，未按照《上市公司信息披露管理办法》第三条的规定履行勤勉尽责义务，对国统股份上述违规事项负有主要责任。根据《上市公司信息披露管理办法》（证监会令第 40 号）第五十九条规定，我局决定对你采取出具警示函的行政监管措施，并计入证券期货市场诚信档案。你应于收到本决定书之日起 10 日内向我局报送书面报告。

如果对本监督管理措施不服，可以在收到本决定书之日起 60 日内向中国证券监督管理委员会提出行政复议申请；也可以在收到本决定书之日起 6 个月内向有管辖权的人民法院提起诉讼。复议与诉讼期间，上述监督管理措施不停止执行。

#### **本基金管理人做出说明如下：**

(1) 投资决策程序：综合考虑宏观经济环境和大类资产配置策略，并精选价值低估的公司构建投资组合，个股权重较为分散。通过对公司的基本面进行分析，认为公司基本面和经营状况非常稳定，经营环境逐步好转，估值水平较低；

(2) 公司历史上因为重大投资行为和对外担保未履行审议程序及信息披露义务、订立重要合同和已披露的重大事项发生进展或变化未履行信息披露义务，中国证券监督管理委员会新疆监管局对公司及相关责任人采取出具警示函的措施。经过分析，公司已对上述事项予以补充披露并制定了明确的整改方案，我们认为该事项对公司的业务经营影响可控，因此继续持有该公司股票。

#### **8.12.2 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。**

#### **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	106,895.83

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	332,064.93
5	应收申购款	7,339,060.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,778,020.92

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

#### 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

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

## §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
24,062	8,018.06	62,964,935.70	32.64%	129,965,582.85	67.36%

## 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	14,695,189.05	7.62%

## 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	>100

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年11月14日）基金份额总额	200,112,777.30
本报告期期初基金份额总额	144,959,649.81
本报告期基金总申购份额	249,518,011.48
减：本报告期基金总赎回份额	201,547,142.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	192,930,518.55



## §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

#### 1、基金管理人的重大人事变动

(1) 本基金管理人于 2021 年 01 月 13 日公告，增聘苏利华先生担任金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理；

(2) 本基金管理人于 2021 年 03 月 04 日公告，郭建新先生不再担任金元顺安金通宝货币市场基金的基金经理；

(3) 本基金管理人于 2021 年 07 月 17 日公告，张博先生不再担任金元顺安沅泉债券型证券投资基金的基金经理；

(4) 本基金管理人于 2021 年 07 月 22 日公告，增聘闵杭担任金元顺安桉盛债券型证券投资基金的基金经理；

(5) 本基金管理人于 2021 年 07 月 30 日公告，《金元顺安医疗健康混合型证券投资基金基金合同》正式生效，贾丽杰女士担任该基金的基金经理。

(6) 本基金管理人于 2021 年 12 月 31 日公告，增聘贾丽杰女士担任金元顺安丰利债券型证券投资基金的基金经理。

#### 2、基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2021 年 11 月 19 日公告，根据工作需要，任命崔岩女士担任本公司资产托管部总经理，负责资产托管部相关工作。

### 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，未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金的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**

本报告期内，未发生改聘会计师事务所的情况。

**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，中国证监会上海监管局对公司及相关高级管理人员采取责令改正、警示函、监管谈话等监管措施，公司高度重视，已按照监管要求完成整改。

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

**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	
东方证券	1	804,311,750.55	49.66%	157,450.19	40.19%	-
中泰证券	1	815,426,674.58	50.34%	234,289.51	59.81%	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-

注：

#### 1、专用交易单元的选择标准和程序

根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29 号）和《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48 号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司专用交易单元的选择标准和程序：

##### （1）选择标准。

1) 公司具有较强的研究实力，能够出具高质量的各种研究报告。研究及投资建议质量较高、报告出具及时、能及时地交流和对需求做出反应，有较广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

2) 公司资信状况较好，无重大不良记录。

3) 公司经营规范，能满足基金运作的合法、合规需求。

4) 能够对持有人提供较高质量的服务。能够向持有人提供咨询、查询等服务；可以向投资人提供及时、主动的信息以及其它增值服务，无被持有人投诉的记录。

##### （2）选择流程。

公司投研和市场部门定期对券商服务质量根据选择标准进行量化评比，并根据评比的结果选择交易单元。

2、截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金新租用东吴证券股份有限公司 1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元，五矿证券有限公司 1 个上海交易单元、1 个深圳交易单元，中信建投证券股份有限公司 1 个深圳交易单元，长江证券股份有限公司 1 个深圳交易单元；无退租交易单元。

#### 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		基金交易	
	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	成交 金额	占当期 基金成 交总额 的比例

东方证券	83,272,793.60	66.94%	12,999,800,000.00	99.98%	-	-	-	-
中泰证券	41,120,738.02	33.06%	3,000,000.00	0.02%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2020 年第四季度的报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-01-22
2	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加众惠基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-03
3	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金在盈米基金销售有限公司开展转换费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-09
4	金元顺安基金管理有限公司关于旗下部分基金开通东方财富证券股份有限公司基金定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-17

5	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-23
6	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2020 年度报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-03-31
7	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-07
8	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加天风证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-12
9	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-13
10	金元顺安基金管理有限公司关于修改旗下部分基金的基金合同及托管协议的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-21
11	金元顺安旗下证券投资基金 2021 年第一季度报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-22
12	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新[2021 年 04 月 26 日更新]	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-26
13	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 [2021 年 04 月 26 日更新]	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-04-26
14	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-05-19
15	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加诺亚正行基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-04
16	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加上海长量基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-16
17	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源西部证券有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-24

18	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源证券有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-06-24
19	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-07-12
20	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金第二季度报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-07-21
21	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加中信证券华南股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-08-24
22	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2021 年中期报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-08-31
23	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加大河财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-09-06
24	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加大河财富基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-09-06
25	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加青岛意才基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-09-10
26	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加海银基金销售有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-10-12
27	金元顺安基金管理有限公司旗下证券投资基金 2021 年第三季度报告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-10-27
28	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-11-04
29	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新[2021 年 11 月 05 日更新]	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-11-05
30	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金招募说明书[2021 年 11 月 05 日更新]	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-11-05

31	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加西部证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-11-18
32	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金参加国信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-11-26
33	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务限额的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-12-15
34	金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金调整大额申购（含转换转入、定期定额投资）业务限额的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-12-22
35	金元顺安基金管理有限公司旗下部分基金增加奕丰基金销售有限公司为销售机构并参与费率优惠的公告	《证券时报》和 www.jysa99.com	2021-12-27

## §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	2021 年 01 月 01 日 -2021 年 09 月 14 日;  2021 年 11 月 17 日 -2021 年 11 月 22 日;  2021 年 12 月 02 日 -2021 年 12 月 28 日	49,734,000.00	0.00	12,300,000.00	37,434,000.00	19.40%

#### 产品特有风险

- 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。
- 基金净值大幅波动的风险  
高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。
- 基金规模较小导致的风险  
高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。



## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》；
- 4、《金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册金元顺安元启灵活配置混合型证券投资基金的法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

金元顺安基金管理有限公司

中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 3608 室

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间至办公地点进行查询，或登录本基金管理人网站 [www.jysa99.com](http://www.jysa99.com) 查阅。投资者对本报告书存有疑问，可咨询本基金管理人金元顺安基金管理有限公司，本公司客服电话 400-666-0666、021-68881898。

金元顺安基金管理有限公司

二〇二二年三月三十一日