

# 凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人:凯石基金管理有限公司

基金托管人:渤海银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2022年01月01日起至2022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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	71
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	71
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	71
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	71

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12 投资组合报告附注.....	71
§9 基金份额持有人信息.....	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
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.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	72
§11 重大事件揭示.....	73
11.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
11.4 基金投资策略的改变.....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
12.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§13 备查文件目录.....	75
13.1 备查文件目录.....	75
13.2 存放地点.....	75
13.3 查阅方式.....	75

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金
基金简称	凯石澜龙头经济持有期混合
基金主代码	006430
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月05日
基金管理人	凯石基金管理有限公司
基金托管人	渤海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	218,977,189.61份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于行业中具有核心竞争优势或者重点业务市场份额占比排名前列的龙头公司，在风险可控的前提下力争获取超越业绩比较基准的收益。
投资策略	基于宏观经济研判、行业研究、产业比较研究体系，进行大类资产配置。基于股、债相对预期收益率比较，并结合回撤与风险判断，积极动态调整权益资产仓位和相应的固定收益类资产比例。当股市隐含预期收益率高于长期债券到期收益率，且股市有趋势性机会的时候，我们将结合配置的行业结构和弹性积极主动提高权益股票仓位，争取超额收益；反之，当股市隐含预期收益率低于长期债券到期收益率，股市估值过高时，我们将结合配置的行业结构和弹性适度出售权益资产，降低部分仓位，控制一定回撤。资产配置策略既考虑股债收益率比较，又考虑配置的行业结构和弹性，实现稳健收益基础上的超额收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是一只混合型基，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，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	凯石基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段卓立
	联系电话	021-60431122
	电子邮箱	callcenter@vstonefund.com
客户服务电话	021-60431122	400-888-8811/95541
传真	021-80365001	022-58314791
注册地址	上海市黄浦区延安东路1号2层	天津市河东区海河东路218号
办公地址	上海市黄浦区延安东路1号2层	天津市河东区海河东路218号
邮政编码	200002	300012
法定代表人	陈继武	李伏安

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.vstonefund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区延安东路1号2层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	凯石基金管理有限公司	上海市黄浦区延安东路1号2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	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	-78,102,655.52	30,360,159.41	188,901,975.54
本期利润	-86,351,563.07	-22,883,455.12	238,469,221.01
加权平均基金份额 本期利润	-0.3825	-0.0342	0.4966
本期加权平均净值 利润率	-42.94%	-2.87%	38.17%
本期基金份额净值 增长率	-35.72%	-3.84%	45.93%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	-71,260,650.26	5,838,672.77	42,900,225.35
期末可供分配基金 份额利润	-0.3254	0.0148	0.0638
期末基金资产净值	148,345,935.46	414,470,218.61	797,856,458.02
期末基金份额净值	0.6774	1.0538	1.1869
3.1.3 累计期末指标	2022年末	2021年末	2020年末
基金份额累计净值 增长率	21.75%	89.40%	96.96%

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。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，例如基金的认购、申购、赎回费等，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	-15.03%	0.97%	1.03%	0.76%	-16.06%	0.21%
过去六个月	-28.70%	1.55%	-8.09%	0.66%	-20.61%	0.89%
过去一年	-35.72%	1.47%	-13.11%	0.77%	-22.61%	0.70%
过去三年	-9.80%	1.60%	-0.92%	0.77%	-8.88%	0.83%
自基金合同生效起至今	21.75%	1.53%	14.90%	0.76%	6.85%	0.77%

注：本基金的业绩比较基准：沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%

#### 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



### 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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021年	0.900	46,790,981.36	13,710,437.74	60,501,419.10	-
2020年	4.000	148,007,587.18	42,484,656.80	190,492,243.98	-
合计	4.900	194,798,568.54	56,195,094.54	250,993,663.08	-

## §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

凯石基金管理有限公司（简称“凯石基金”）是全国首家全自然人持股的“私转公”公募基金管理公司，于2017年5月10日正式成立。公司经营范围为公募基金管理，涉及基

金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。注册资本金1.5亿元人民币，总部设于上海外滩。

凯石基金传承私募基金优秀的合伙人创业文化，公司股东均来自国内基金行业及其他金融机构，平均金融从业经历超过17年，兼有丰富的金融及公募基金的管理经验，共同打造有利于公募基金稳定发展的公司治理平台。

凯石基金从资产管理业务的本质出发，忠诚履行受托职责，以实现投资人利益为最高目标，将自身利益置于投资人利益之下。秉承“时间见证诚信、专业创造价值”的理念，把凯石基金塑造成有责任、有能力、有追求、敢担当、受投资者尊重和信赖的资产管理机构。

#### 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		
付柏瑞	总经理助理、基金经理	2021-03-04	2022-12-08	18	中国国籍，硕士，历任华宝兴业基金管理有限公司研究员，农银汇理基金管理有限公司研究员、基金经理，前海开源基金管理有限公司联席投资总监、投资经理等职。
纪忆	基金经理助理	2021-08-16	-	2	中国国籍，硕士，历任上海胤胜资产管理有限公司研究员、上海井秀投资管理有限公司研究员、上海创芮企业管理合伙企业（有限合伙）行业研究员、凯石基金管理有限公司研究员，现任公司基金经理助理。
张俊	基金经理	2022-12-08	-	12	中国国籍，硕士，历任湘

					财证券有限责任公司研究员、平安证券有限责任公司研究员、中泰证券有限责任公司研究员、上海鼎峰明德资产管理有限公司研究总监、任国盛证券有限责任公司研究员等。
--	--	--	--	--	--

注：上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人制定了《凯石基金管理有限公司公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了全部开放式基金和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、监督检查等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

(1) 在研究环节，公司建立了统一的投研平台信息共享体系，公司内外部研究成果对所有基金经理和投资经理开放分享。同时，通过投研团队晨会、例会等投资研究交流机制来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。

(2) 在投资环节，公司针对基金、资产管理计划设立了投资决策委员会，各委员会根据议事规则召开会议，在其职责范围内独立行使投资决策权。各投资组合经理在授权范围内根据投资组合的风格和投资策略，独立制定资产配置计划和组合调整方案，并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。

(3) 在交易环节，公司实行集中交易，所有交易执行由集中交易室负责完成。投资交易系统参数设置为公平交易模式，按照“时间优先、价格优先、比例分配”的原则执行交易指令。所有场外交易执行亦由集中交易室处理，严格按照各组合事先提交的价格、数量进行分配，确保交易的公平性。

(4) 在交易监控环节, 公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式, 对投资交易全过程实施监督, 对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。

(5) 在报告分析方面, 公司按季度和年度编制公平交易分析报告, 并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。同时, 投资组合的定期报告还将就公平交易执行情况做专项说明。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 以及公司拟定的《凯石基金管理有限公司公平交易管理办法》, 公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职, 投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会, 建立公平交易的制度环境; 交易环节加强交易执行的内部控制, 利用恒生交易系统公平交易相关程序, 及其它的流程控制, 确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平; 公司同时不断完善和改进公平交易分析系统, 在事后加以严格的行为监控、分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好, 未发现有违背公平交易的相关情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内, 未发现本投资组合与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内, 本投资组合未出现参与交易所公开竞价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5%的情形。

### 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

2022年权益市场呈现震荡下行的局面, 上证综指、深证成指及沪深300指数涨跌幅分别为-15.13%、-25.86%、-21.63%。此外, 创业板指涨跌幅为-29.37%。各申万一级行业指数中表现相对较好的五个行业, 煤炭行业变化幅度为17.52%, 餐饮旅游行业变化幅度为6.39%, 交运行业变化幅度为2.31%, 银行业变化幅度为-5.51%, 零售行业变化幅度为-5.55%。表现相对较差的五个行业中, 电子行业变化幅度为-35.75%, 计算机行业变化幅度为-25.13%, 军工行业变化幅度为-24.85%, 传媒行业变化幅度-24.55%, 建材行业变化幅度为-24.38%。

经济方面：受疫情反复影响，2022年经济增长有限。2022年社会消费品零售总额439733亿元，比上年下降0.2%，其中除汽车以外的消费品零售额393961亿元，下降0.4%。2022年，全国规模以上工业企业实现利润总额84038.5亿元，比上年下降4.0%。规模以上工业企业实现营业收入137.91万亿元，比上年增长5.9%。2022年全年货物进出口总额420678亿元，比上年增长7.7%，其中出口额239654亿元，增长10.5%，进口额181024亿元，增长4.3%，进出口相抵，贸易顺差达到58630亿元。2022年，全国固定资产投资（不含农户）572138亿元，比上年增长5.1%，其中民间固定资产投资310145亿元，比上年增长0.9%。

分类来看，采矿业利润增速仍然表现最好。2022年，采矿业实现利润总额15573.6亿元，比上年增长48.6%；制造业实现利润总额64150.2亿元，下降13.4%；电力、热力、燃气及水生产和供应业实现利润总额4314.7亿元，增长41.8%。工业企业利润降低系多重因素导致：第一，外需下降，出口增速大幅下滑；第二，工业经济基本面下行带动企业盈利下降。重点城市散点式疫情；第三，高基数价格因素，短期来看，出口、价格因素的拖累或将延续；第四，企业设备更新改造过程中产生一定的费用支出。

业绩方面：全部A股上市公司净利润增速在2022年前三季度较为低迷，与国内GDP增速回落走势一致。2022年全部A股、主板、创业板、科创板前三季度净利润增速同比分别为1.3%、0.7%、10.6%、17.9%。截至2023年2月1日，全部A股5078家上市公司中，有84家上市公司发布了2022年业绩快报，2650家上市公司发布了业绩预告信息。从现有披露的数据来看，2022年主板利润增速预计较2021年年报大幅放缓，创业板和科创板的利润增速预计小幅放缓但仍保持在较高水平。从业绩预喜（含预增、续盈、略增、扭亏）、业绩下滑（含预减、略减）、业绩亏损（含首亏、续亏）类型占比来看，北证A股和科创板的业绩预喜类型占比最高，分别为60%和44%。在31个一级行业中，业绩预喜占比超过50%的行业有7个，其中煤炭、家用电器、有色金属行业业绩预喜占比最高，分别为72%、70%、64%。房地产及相关产业链受市场环境因素影响业绩不佳。

无风险利率方面：2022年美联储在通胀背景下持续加息、国内则维持宽松的货币政策，不断释放流动性。趋势看，当前基本面下货币政策仍将以稳中偏松为总体取向，继续维持流动性稳定，美联储加息则有望放缓，美债利率有望筑顶回落。

风险偏好方面：2022年我国面临的经济影响因素错综复杂，对市场情绪也形成冲击，随着疫情政策的调整、地产政策的放松、美联储加息预期放缓，年末市场风险偏好回升。未来在较低基数和扩大内需的政策支持下，全国经济有望稳步改善，不断改善市场风险偏好。

投资策略：综合以上分析，一季度经济开始复苏、二季度受疫情冲击遇阻、三季度重回复苏轨道、四季度再次受阻，但四季度防疫政策调整对居民活动、就业、市场主体的连续经营均发挥了积极的支撑效应，一至四季度GDP同比增速分别为4.8%、0.4%、3.9%、2.9%，全年中国经济顶住压力实现GDP实现3%同比增长；上市公司业绩净利润

增速在2022年前三季度较为低迷，与国内GDP增速回落走势一致；与此同时，美联储在通胀背景下持续加息、无风险利率持续上行，国内则维持宽松的货币政策，不断释放流动性。股市震荡调整，二季度和四季度后期有所反弹，结构性行情突出，总体主板表现优于创业板。本基金成功优选大消费、医药、新能源、科技、金融等景气较强的行业和子行业，配置其中具有核心竞争优势的公司，获取了较好的稳健基础上的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末凯石澜龙头经济一年持有期混合基金份额净值为0.6774元，本报告期内，基金份额净值增长率为-35.72%，同期业绩比较基准收益率为-13.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年中国经济预期由衰退走向复苏，中国经济逐渐“走出谷底”有望驱动2023年中国权益市场走出复苏行情。国内当前基本面下货币政策仍将以稳中偏松为总体取向，继续维持流动性稳定，2022年11月之后围绕地产和防疫相关的政策则暖风频繁出现，11月8日民企融资“第二支箭”和11月10日疫情防控政策优化，国内稳增长预期重新统一，疫情对经济修复的压制有望逐步缓解、地产对经济的拖累也有望逐步缓和。

展望未来，疫情约束未来或将逐步打开，稳地产决心坚定，在较低基数和内需政策支持下，全国经济有望逐季稳步改善，预计2023年将进入盈利回升周期。2022年，A股在美联储不断加息提升无风险利率、上市公司预期盈利受损、风险偏好显著下行的影响下杀估值，未来美联储加息未来有望放缓，美债利率有望筑顶回落，目前A股估值水平总体处于历史合意位置，仍有提升空间。

具体看，在稳增长力度与决心的彰显下，地产链信心筑底、有望企稳回升；疫情防控优化下，疫情对消费场景和消费信心的影响有望逐步趋缓，叠加扩内需政策的引导下，消费行业有望显著修复；在科技自立自强，解决外国“卡脖子”问题，扎实推进新型工业化，加快建设制造强国、质量强国的政策指引下代表国家安全观“自上而下”战略升级的信息安全/国防安全等赛道以及自主可控的科技成长赛道也值得重点关注。

本基金继续坚持追求稳健基础上超额收益的稳健配置策略，遵守契约规定的仓位限制要求，股、债平衡配置，继续持有大消费、大健康、科技制造行业，灵活配置新能源、金融等行业子领域，注重优中选优，选择宏观格局景气(M)好、核心竞争优势(ROE)优选、增长(G)可持续的好公司。结合经济基本面、市场风险偏好环境、细分子行业估值的综合分析，做好子行业或者公司之间动态轮动配置，做好股、债仓位适度灵活配置，获取稳健收益基础上的超额收益。

本基金将保持战略乐观，结合上年度年报及本年度第一季报预报，对预期向好的板块进行均衡配置：1) 消费板块：体验式消费、线下消费和出行将率先恢复；2) 数字经济板块：数字经济已经提高到国家战略高度；3) 医药板块：比如类刚需，关注消费医

疗场景修复下的医疗服务、医美等；4) 高端制造板块：比如自主可控、进口替代、出口供应全球；5) 油运板块：供给低迷，叠加俄乌冲突带来运距拉长，疫情后出行需求有望恢复，油轮板块或将进入顺周期新阶段。

#### 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，公司以维护基金份额持有人利益为宗旨，有效地组织开展对基金运作的内部监察稽核。督察长和监察稽核部门根据独立、客观、公正的原则，认真履行职责，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方式方法积极开展工作，强化对基金运作和公司运营的合规性监察，促进内部控制和风险管理的不断改进，并依照规定定期向监管机关、董事会报送监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察工作主要包括以下几个方面：

##### （一）制度建设与完善

2022年度，公司在已经搭建的内控管理制度框架下，随着业务的开展，为了进一步完善内控管理体系，新增及修订12部规章制度。具体制度包括《凯石基金管理有限公司远程办公管理制度》、《凯石基金管理有限公司销售奖励办法（试行）》、《凯石基金管理有限公司债券库管理细则》、《凯石基金管理有限公司逆回购质押品管理细则》、《凯石基金管理有限公司声誉风险管理制度》、《凯石基金管理有限公司廉洁从业管理制度》、《凯石基金管理有限公司薪酬绩效管理制度》、《凯石基金管理有限公司销售管理办法》、《凯石基金管理有限公司固定收益投资管理办法》、《凯石基金管理有限公司费用管理制度》、《凯石基金管理有限公司自有资金投资管理办法》、《凯石基金管理有限公司风险准备金管理制度》。

##### （二）开展定期和专项合规检查

我司每日监督公司投资、交易人员的手机等移动通讯工具在交易时间的集中管理情况，每季度对公司的监控录像、电子邮件、电话录音、即时聊天记录以及无线网卡的使用进行合规检查，每季度按照《员工个人证券投资及股权投资管理办法》规定，要求公司员工对个人证券投资情况进行申报。监察稽核部按要求进行2022年度的合规检查和合规有效性评估，评估范围覆盖公司所有部门。并且在产品募集和投资过程中进行合规检查和合规提示。

##### （三）强化培训教育，提高全员合规意识

本报告期内，监察稽核部门积极推动公司强化内部控制和风险管理的教育培训。公司及相关部门通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险意识、合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，充分维护和保障了基金份额持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉

尽责的原则管理和运用基金资产，继续加强内部控制和风险管理，进一步提高稽核监察工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

公司设立基金资产估值委员会，成员由公司总经理、投资总监、运营总监、基金会计主管、监察稽核等成员组成，同时，督察长、相关基金经理、总经理以及总经理指定的其他人员可以列席相关会议。

公司在充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和相关工作经验的基础上，由估值委员会负责研究、指导基金估值业务。金融工程相关业务人员负责估值相关数值的处理及计算，并参与公司对基金的估值方法的计算；公司总经理、基金会计主管等参与基金组合估值方法的确定，复核估值价格，并与相关托管行进行核对确认；督察长、监察稽核人员对有关估值政策、估值流程和程序、估值方法等事项的合规合法性进行审核与监督。基金经理参与估值委员会对估值的讨论，但不介入基金日常估值业务。

公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突；截止报告期末本基金管理人已于中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、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

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内，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，本基金托管人在对凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议

的有关规定，不存在任何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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人复核了本报告中的有关财务数据部分，内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 24333 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	凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“凯石澜龙头经济一年持有期混合基金”)的财务报表，包括2022年12月31日的资产负债表，2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的

	<p>有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了凯石澜龙头经济一年持有期混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于凯石澜龙头经济一年持有期混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>凯石澜龙头经济一年持有期混合基金的基金管理人凯石基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括凯石澜龙头经济一年持有期混合基金2022年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。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。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。基于我们已经执行的工作，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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层</p>

	<p>负责评估凯石澜龙头经济一年持有期混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算凯石澜龙头经济一年持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督凯石澜龙头经济一年持有期混合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。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：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对凯石澜龙头经济一年持有期混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表</p>

	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凯石澜龙头经济一年持有期混合基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	叶尔甸	朱容莹
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2023-03-28	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	23,583,554.43	142,095,337.39
结算备付金		1,001.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	125,128,514.01	305,397,693.99
其中：股票投资		125,128,514.01	304,746,398.39
基金投资		-	-
债券投资		-	651,295.60
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,977.04	70,413.88
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	24,989.03
资产总计		148,718,046.48	447,588,434.29
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	31,901,961.08
应付管理人报酬		194,166.09	971,483.13
应付托管费		12,944.41	64,765.56
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.52	5.91

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	165,000.00	180,000.00
负债合计		372,111.02	33,118,215.68
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.8	218,977,189.61	393,325,719.27
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	-70,631,254.15	21,144,499.34
净资产合计		148,345,935.46	414,470,218.61
负债和净资产总计		148,718,046.48	447,588,434.29

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.6774元，基金份额总额218,977,189.61份。

## 7.2 利润表

会计主体：凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-82,953,065.77	27,144,140.87
1.利息收入		92,602.90	312,941.15
其中：存款利息收入	7.4.7.10	92,602.90	292,706.54
债券利息收入		-	20,234.61
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-74,806,205.89	80,074,814.25
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-75,809,685.71	86,601,884.06

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	308,091.24	-5,923,357.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-2,091,520.00
股利收益	7.4.7.14	695,388.58	1,487,807.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-8,248,907.55	-53,243,614.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	9,444.77	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,398,497.30	50,027,595.99
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,031,401.87	12,009,438.60
2. 托管费	7.4.10.2.2	202,093.44	800,629.16
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		1.99	30.54
8. 其他费用	7.4.7.18	165,000.00	37,217,497.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-86,351,563.07	-22,883,455.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-86,351,563.07	-22,883,455.12

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-86,351,563.07	-22,883,455.12

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	393,325,719.27	-	21,144,499.34	414,470,218.61
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	393,325,719.27	-	21,144,499.34	414,470,218.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-174,348,529.66	-	-91,775,753.49	-266,124,283.15
（一）、综合收益总额	-	-	-86,351,563.07	-86,351,563.07
（二）、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）	-174,348,529.66	-	-5,424,190.42	-179,772,720.08
其中：1.基金申	3,490,545.99	-	-236,813.59	3,253,732.40

购款				
2.基金 赎回款	-177,839,075.65	-	-5,187,376.83	-183,026,452.48
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综 合收益结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净 值)	218,977,189.61	-	-70,631,254.15	148,345,935.46
项目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净 值)	672,237,985.58	-	125,618,472.44	797,856,458.02
加: 会计政策变 更	-	-	-	-
前期差错 更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净 资产(基金净 值)	672,237,985.58	-	125,618,472.44	797,856,458.02
三、本期增减变 动额(减少以“- ”号填列)	-278,912,266.31	-	-104,473,973.10	-383,386,239.41
(一)、综合收	-	-	-22,883,455.12	-22,883,455.12

益总额				
(二)、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)	-278,912,266.31	-	-21,089,098.88	-300,001,365.19
其中: 1.基金申购款	14,213,422.97	-	1,261,103.90	15,474,526.87
2.基金赎回款	-293,125,689.28	-	-22,350,202.78	-315,475,892.06
(三)、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)	-	-	-60,501,419.10	-60,501,419.10
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	393,325,719.27	-	21,144,499.34	414,470,218.61

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:

李琛

韩璐

卢珊

-----

-----

-----

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

凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金(原名为凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金,以下简称“本基金”)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]1412号《关于准予凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金注册的批复》注册,由凯石基金管理有限公司依照《中华人民共和国

证券投资基金法》和《凯石澜龙头经济定期开放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、定期开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币205,837,669.49元，业经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)毕马威华振验字第1800295号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金基金合同》于2018年12月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为205,971,105.22份基金份额，其中认购资金利息折合133,435.73份基金份额。本基金的基金管理人为凯石基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人凯石基金管理有限公司于2022年1月25日发布的《关于凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金转型暨凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金合同生效的公告》，于2021年11月15日起至2022年12月23日以通讯方式召开的基金份额持有人大会审议通过了《关于修改凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》。经与基金托管人协商一致，基金管理人已将《凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金基金合同》修订为《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金合同》，《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金合同》自2022年1月25日起生效，原《凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金基金合同》自同一起失效。

本基金对于每份基金份额设定一年最短持有期限，基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出业务。

根据原《凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金基金合同》和原《凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于2022年1月25日前，每一年开放一次申购和赎回。封闭期内，投资者不能申购和赎回基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行或上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发行或上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产及存托凭证占基金资产的比例为50%-95%，其中，龙头经济主题相关证券比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。本基金的业绩比较基准为沪深300指数收益率×60%+中债总全价指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人凯石基金管理有限公司于2023年3月28日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度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2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量

特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前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变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所

属的类别中(该类别次于其他所有工具类别),所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征,并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同);(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外,该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征;(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额,应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具,是指根据合同约定,持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利,或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时,自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同:(1)现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响);(2)实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具,列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持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扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人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净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《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”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、应收利息和应收申购款,金额分别为142,095,337.39元、24,989.03元和70,413.88元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为142,118,352.52元、0.00元和70,413.88元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为305,397,693.99元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为305,399,667.89元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬和应付托管费,金额分别为31,901,961.08元、971,483.13元和64,765.56元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬和应付托管费,金额分别为31,901,961.08元、971,483.13元和64,765.56元。

i) 于2021年12月31日,本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日,本基金根据新金融工具准则下的计量类别,将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交

易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	305,107.55	792,076.19
等于：本金	305,038.36	792,076.19
加：应计利息	69.19	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	0.00	0.00
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	23,278,446.88	141,303,261.20
等于：本金	23,276,059.07	141,303,261.20

加：应计利息	2,387.81	-
减：坏账准备	-	-
合计	23,583,554.43	142,095,337.39

注：其他存款为本基金存放在开立于基金结算机构的证券账户内的存款。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	127,364,285.23	-	125,128,514.01	-2,235,771.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	127,364,285.23	0.00	125,128,514.01	-2,235,771.22
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	299,018,830.83	-	304,746,398.39	5,727,567.56
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	365,726.83	651,295.60	285,568.77
	银行间市场	-	-	-
	合计	365,726.83	-	651,295.60
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	299,384,557.66	-	305,397,693.99	6,013,136.33

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

#### 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未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	24,989.03
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	24,989.03

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021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	-	-
应付交易费用	-	-

其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	180,000.00
合计	165,000.00	180,000.00

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	393,325,719.27	393,325,719.27
本期申购	3,490,545.99	3,490,545.99
本期赎回（以“-”号填列）	-177,839,075.65	-177,839,075.65
本期末	218,977,189.61	218,977,189.61

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 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
本期期初	5,838,672.77	15,305,826.57	21,144,499.34
本期利润	-78,102,655.52	-8,248,907.55	-86,351,563.07
本期基金份额交易产生的变动数	1,003,332.49	-6,427,522.91	-5,424,190.42
其中：基金申购款	-317,558.90	80,745.31	-236,813.59
基金赎回款	1,320,891.39	-6,508,268.22	-5,187,376.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-71,260,650.26	629,396.11	-70,631,254.15

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年01月01日至2022年 12月31日	2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	7,043.84	21,602.09
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	85,559.06	271,104.45
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	92,602.90	292,706.54

#### 7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	3,456,282,111.05	12,382,433,663.97
减：卖出股票成本总额	3,521,787,741.28	12,295,831,779.91
减：交易费用	10,304,055.48	-
买卖股票差价收入	-75,809,685.71	86,601,884.06

#### 7.4.7.12 债券投资收益

##### 7.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	999.08	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	307,092.16	-5,923,357.70
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	308,091.24	-5,923,357.70

#### 7.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	951,199.08	108,895,424.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	641,726.83	114,595,245.42
减：应计利息总额	2,342.02	223,536.84
减：交易费用	38.07	-
买卖债券差价收入	307,092.16	-5,923,357.70

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日
期货投资	-	-2,091,520.00

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	695,388.58	1,487,807.89
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	695,388.58	1,487,807.89

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-8,248,907.55	-53,243,614.53
——股票投资	-7,963,338.78	-53,354,852.70
——债券投资	-285,568.77	111,238.17
——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	-8,248,907.55	-53,243,614.53

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
基金赎回费收入	9,444.77	-
合计	9,444.77	-

注：自2022年1月1日至2022年1月24日，本基金的赎回费率按持有期间递减，全部归入基金资产。根据《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金招募说明书(2022年第2次更新)》，自2022年1月25日起，本基金不收取赎回费。

#### 7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
审计费用	45,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	-	68,000.00
交易费用	-	36,969,497.69
合计	165,000.00	37,217,497.69

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
凯石基金管理有限公司("凯石基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司("渤海银行")	基金托管人、基金销售机构
陈继武	基金管理人的股东
李琛	基金管理人的股东
陈敏	基金管理人的股东
王振	基金管理人的股东
兰俊	基金管理人的股东
袁渊	基金管理人的股东

上海凯石财富基金销售有限公司("凯石财富")	受基金管理人的股东控制的公司、基金销售机构
------------------------	-----------------------

注：下述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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,031,401.87	12,009,438.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1,480,604.98	5,929,080.84

注：支付基金管理人凯石基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	202,093.44	800,629.16

注：支付基金托管人渤海银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内及上年度可比期间无支付给各关联方的销售服务费。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人于本基金本报告期内及上年度可比期间未运用自有资金投资本基金。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份	持有的基金份额	持有的基金份

		额占基金总份 额的比例		额占基金总份 额的比例
李琛	0.00	0.00%	825,164.33	0.21%
王振	10.13	0.000005%	0.00	0.00%

注：关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021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
渤海银行	305,107.55	7,043.84	792,076.19	21,602.09

注：本基金的银行存款由基金托管人渤海银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022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

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上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以实现“预期风险和收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会主要负责基金管理人风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。董事会下设督察长，负责对基金管理人各业务环节合法合规运作的监督检查和基金管理人内部稽核监控工作，并可向基金管理人董事会和中国证监会直接报告。经营管理层下设风险评估联席会议，进行各部门管理程序的风险确认，并对各类风险予以事先充分的评估和防范，并进行及时控制和采取应急措施；在业务操作层面监察稽核部负责基金管理人各部门的风险控制检查，定期或不定期对业务部门内部控制制度执行情况和遵循国家法律、法规及其他规定的执行情况进行检查，并适时提出修改建议；监察稽核部同时负责投资限制指标体系的设定和更新，对于违反指标体系的投资进行监查和风险评估，并负责协助各部门修正、修订内部控制作业制度，并对各部门的日常作业，依据风险管理的考评，定期或不定期对各项风险指标进行控管，并提出内控建议。本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人渤海银行，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构中信建投证券股份有限公司的证券账户内，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2022年12月31日，本基金无债券投资(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0.16%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于锁定期届满后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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人自基金合同生效日满一年起对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于2022年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2022年12月31日，本基金无流动性受限资产。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2022年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值为148,717,045.48元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款和结算备付金等。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	23,583,554.43	-	-	-	-	-	23,583,554.43
结算备付金	1,001.00	-	-	-	-	-	1,001.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	125,128,514.01	125,128,514.01
应收申购款	-	-	-	-	-	4,977.04	4,977.04
资产总计	23,584,555.43	-	-	-	-	125,133,491.05	148,718,046.48
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	194,166.09	194,166.09
应付托管费	-	-	-	-	-	12,944.41	12,944.41
应交税费	-	-	-	-	-	0.52	0.52
其他负债	-	-	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	372,111.02	372,111.02
利率敏感度缺口	23,584,555.43	-	-	-	-	124,761,380.03	148,345,935.46
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	142,095,337.39	-	-	-	-	-	142,095,337.39
交易性金融资产	-	-	-	651,295.60	-	304,746,398.39	305,397,693.99
应收利息	-	-	-	-	-	24,989.03	24,989.03

应收申购款	-	-	-	-	-	70,413.88	70,413.88
资产总计	142,095,337.39	-	-	651,295.60	-	304,841,801.30	447,588,434.29
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	31,901,961.08	31,901,961.08
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	971,483.13	971,483.13
应付托管费	-	-	-	-	-	64,765.56	64,765.56
应交税费	-	-	-	-	-	5.91	5.91
其他负债	-	-	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	33,118,215.68	33,118,215.68
利率敏感度缺口	142,095,337.39	-	-	651,295.60	-	271,723,585.62	414,470,218.61

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

于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2021年12月31日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0.16%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种

进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金总资产的50-95%，投资于龙头经济主题相关证券的资产比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期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。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(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2022年12月31日		上年度末 2021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	125,128,514.01	84.35	304,746,398.39	73.53
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	125,128,514.01	84.35	304,746,398.39	73.53

#### 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	1.沪深300指数上升5%	6,129,185.18	15,215,760.22
	2.沪深300指数下降5%	-6,129,185.18	-15,215,760.22

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	125,128,514.01	305,036,388.72
第二层次	-	5,504.49
第三层次	-	355,800.78
合计	125,128,514.01	305,397,693.99

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	355,800.78	355,800.78
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	259,427.75	259,427.75
当期利得或损失总额	-	-96,373.03	-96,373.03
其中：计入损益的利得或损失	-	-96,373.03	-96,373.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-

当期购买	-	259,427.75	259,427.75
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	96,373.03	96,373.03
其中：计入损益的利得或损失	-	96,373.03	96,373.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	355,800.78	355,800.78
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	96,373.03	96,373.03

于2022年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	125,128,514.01	84.14
	其中：股票	125,128,514.01	84.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	23,584,555.43	15.86
8	其他各项资产	4,977.04	0.00
9	合计	148,718,046.48	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	-	-
B	采矿业	4,414,372.40	2.98
C	制造业	91,830,140.27	61.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,261,960.00	2.20
G	交通运输、仓储和邮政业	11,319,031.00	7.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,727,341.34	2.51
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,631,929.00	2.45
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	814,880.00	0.55
Q	卫生和社会工作	3,184,060.00	2.15
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	2,944,800.00	1.99
	合计	125,128,514.01	84.35

### 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	688235	百济神州	38,451	5,092,834.95	3.43
2	300896	爱美客	8,600	4,870,610.00	3.28
3	600009	上海机场	74,100	4,276,311.00	2.88
4	600399	抚顺特钢	295,400	4,227,174.00	2.85
5	002352	顺丰控股	71,500	4,129,840.00	2.78
6	600079	人福医药	170,800	4,080,412.00	2.75
7	603369	今世缘	76,300	3,883,670.00	2.62
8	000596	古井贡酒	13,700	3,656,530.00	2.46
9	600138	中青旅	239,100	3,631,929.00	2.45
10	002675	东诚药业	200,000	3,312,000.00	2.23
11	002304	洋河股份	20,400	3,274,200.00	2.21
12	000963	华东医药	69,700	3,261,960.00	2.20
13	688331	荣昌生物	41,649	3,227,381.01	2.18

14	688212	澳华内镜	49,146	3,218,571.54	2.17
15	301239	普瑞眼科	45,100	3,184,060.00	2.15
16	002612	朗姿股份	110,100	3,056,376.00	2.06
17	002430	杭氧股份	76,000	2,991,360.00	2.02
18	601899	紫金矿业	298,900	2,989,000.00	2.01
19	600150	中国船舶	133,300	2,969,924.00	2.00
20	300573	兴齐眼药	23,700	2,964,396.00	2.00
21	600603	广汇物流	360,000	2,944,800.00	1.99
22	301035	润丰股份	33,800	2,943,980.00	1.98
23	603170	宝立食品	103,300	2,926,489.00	1.97
24	601111	中国国航	274,800	2,912,880.00	1.96
25	002594	比亚迪	11,300	2,903,761.00	1.96
26	603306	华懋科技	77,200	2,888,052.00	1.95
27	688161	威高骨科	53,394	2,786,632.86	1.88
28	688381	帝奥微	67,115	2,665,807.80	1.80
29	688561	奇安信	36,606	2,407,576.62	1.62
30	688766	普冉股份	15,618	2,373,155.10	1.60
31	603986	兆易创新	22,900	2,346,563.00	1.58
32	002371	北方华创	9,500	2,140,350.00	1.44
33	688029	南微医学	25,185	2,068,444.05	1.39
34	605499	东鹏饮料	11,600	2,063,640.00	1.39
35	688408	中信博	17,663	1,738,039.20	1.17
36	601058	赛轮轮胎	158,000	1,583,160.00	1.07
37	001215	千味央厨	23,500	1,540,660.00	1.04
38	300661	圣邦股份	8,600	1,484,360.00	1.00
39	688122	西部超导	15,164	1,435,879.16	0.97
40	600988	赤峰黄金	78,968	1,425,372.40	0.96
41	603919	金徽酒	53,100	1,420,425.00	0.96
42	688536	思瑞浦	4,792	1,319,764.72	0.89
43	600690	海尔智家	52,700	1,289,042.00	0.87
44	688123	聚辰股份	10,838	1,096,805.60	0.74

45	002607	中公教育	176,000	814,880.00	0.55
46	688041	海光信息	19,000	762,280.00	0.51
47	000768	中航西飞	21,500	547,175.00	0.37

## 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	600048	保利发展	44,803,356.00	10.81
2	603348	文灿股份	43,827,556.00	10.57
3	688556	高测股份	40,220,465.40	9.70
4	605117	德业股份	37,626,784.47	9.08
5	688063	派能科技	36,576,405.15	8.82
6	688326	经纬恒润	36,139,444.79	8.72
7	002487	大金重工	34,981,951.00	8.44
8	300438	鹏辉能源	34,322,894.15	8.28
9	000069	华侨城 A	30,935,429.00	7.46
10	000596	古井贡酒	29,981,194.91	7.23
11	001979	招商蛇口	29,509,691.52	7.12
12	603876	鼎胜新材	29,389,176.45	7.09
13	300820	英杰电气	27,532,553.38	6.64
14	002805	丰元股份	27,318,375.00	6.59
15	000002	万科 A	26,680,984.00	6.44
16	600153	建发股份	26,376,738.00	6.36
17	002865	钧达股份	26,236,492.00	6.33
18	601155	新城控股	24,757,457.21	5.97
19	688559	海目星	24,324,298.08	5.87
20	300750	宁德时代	23,561,205.00	5.68
21	002531	天顺风能	22,898,071.41	5.52
22	600809	山西汾酒	21,921,140.55	5.29

23	688111	金山办公	21,463,448.69	5.18
24	600522	中天科技	21,268,016.00	5.13
25	603198	迎驾贡酒	20,856,315.56	5.03
26	002304	洋河股份	20,540,424.46	4.96
27	600383	金地集团	20,172,877.00	4.87
28	688032	禾迈股份	20,130,716.78	4.86
29	600325	华发股份	20,094,264.00	4.85
30	300769	德方纳米	20,064,176.00	4.84
31	688408	中信博	19,357,266.85	4.67
32	002937	兴瑞科技	18,835,292.60	4.54
33	300260	新莱应材	18,641,068.65	4.50
34	688122	西部超导	18,063,496.76	4.36
35	002006	精功科技	17,939,823.00	4.33
36	002335	科华数据	17,645,758.30	4.26
37	003031	中瓷电子	17,532,607.00	4.23
38	688048	长光华芯	17,512,123.29	4.23
39	000887	中鼎股份	17,434,217.98	4.21
40	600519	贵州茅台	17,298,097.80	4.17
41	002897	意华股份	17,238,465.00	4.16
42	300457	赢合科技	17,110,879.12	4.13
43	688667	菱电电控	16,776,400.56	4.05
44	002851	麦格米特	16,417,151.00	3.96
45	300428	立中集团	15,719,867.09	3.79
46	002508	老板电器	15,564,786.00	3.76
47	000933	神火股份	15,549,444.00	3.75
48	002965	祥鑫科技	15,317,834.00	3.70
49	002101	广东鸿图	15,295,723.00	3.69
50	600141	兴发集团	15,195,245.90	3.67
51	688071	华依科技	15,158,458.92	3.66
52	688248	南网科技	15,089,460.04	3.64
53	688072	拓荆科技	14,995,666.81	3.62

54	603688	石英股份	14,980,075.12	3.61
55	688390	固德威	14,978,046.60	3.61
56	002518	科士达	14,919,804.82	3.60
57	300763	锦浪科技	14,857,188.00	3.58
58	300014	亿纬锂能	14,752,027.74	3.56
59	688017	绿的谐波	14,606,797.86	3.52
60	301071	力量钻石	14,359,768.00	3.46
61	688560	明冠新材	14,249,810.12	3.44
62	301155	海力风电	14,151,359.00	3.41
63	600256	广汇能源	14,127,525.00	3.41
64	600801	华新水泥	13,921,585.00	3.36
65	000736	中交地产	13,780,303.86	3.32
66	688700	东威科技	13,676,909.33	3.30
67	002885	京泉华	13,494,680.00	3.26
68	000983	山西焦煤	13,372,624.00	3.23
69	603596	伯特利	12,920,990.00	3.12
70	002475	立讯精密	12,909,279.00	3.11
71	000858	五粮液	12,888,292.80	3.11
72	002241	歌尔股份	12,883,291.00	3.11
73	688262	国芯科技	12,779,858.36	3.08
74	002623	亚玛顿	12,728,221.00	3.07
75	600875	东方电气	12,597,969.00	3.04
76	688301	奕瑞科技	12,553,908.30	3.03
77	603306	华懋科技	12,483,678.00	3.01
78	688337	普源精电	12,422,355.77	3.00
79	002866	传艺科技	12,349,100.00	2.98
80	300207	欣旺达	12,288,129.00	2.96
81	688677	海泰新光	12,066,646.24	2.91
82	002895	川恒股份	11,981,417.00	2.89
83	300724	捷佳伟创	11,850,792.00	2.86
84	601666	平煤股份	11,740,438.00	2.83

85	002384	东山精密	11,546,837.20	2.79
86	000656	金科股份	11,493,663.00	2.77
87	300496	中科创达	11,463,449.00	2.77
88	601689	拓普集团	11,426,434.00	2.76
89	002068	黑猫股份	11,318,228.03	2.73
90	301268	铭利达	11,290,888.98	2.72
91	688516	奥特维	11,238,664.00	2.71
92	300842	帝科股份	11,187,243.00	2.70
93	603997	继峰股份	11,127,657.00	2.68
94	301168	通灵股份	11,081,229.57	2.67
95	600988	赤峰黄金	11,022,449.72	2.66
96	300982	苏文电能	10,990,678.16	2.65
97	605123	派克新材	10,950,221.00	2.64
98	600348	华阳股份	10,822,477.00	2.61
99	601166	兴业银行	10,676,516.00	2.58
100	600009	上海机场	10,637,161.00	2.57
101	300517	海波重科	10,571,929.60	2.55
102	600188	兖矿能源	10,558,352.00	2.55
103	002906	华阳集团	10,548,717.00	2.55
104	688499	利元亨	10,528,503.69	2.54
105	688518	联赢激光	10,502,796.21	2.53
106	603063	禾望电气	10,451,056.00	2.52
107	601208	东材科技	10,438,088.40	2.52
108	603138	海量数据	10,251,286.00	2.47
109	002920	德赛西威	10,165,743.00	2.45
110	002594	比亚迪	10,162,628.00	2.45
111	300203	聚光科技	10,084,577.00	2.43
112	605133	嵘泰股份	10,074,469.00	2.43
113	300498	温氏股份	10,016,001.00	2.42
114	300745	欣锐科技	10,004,826.00	2.41
115	603363	傲农生物	10,001,949.00	2.41

116	300068	南都电源	9,923,999.00	2.39
117	688268	华特气体	9,902,783.94	2.39
118	600533	栖霞建设	9,850,828.00	2.38
119	600699	均胜电子	9,761,050.92	2.36
120	000625	长安汽车	9,683,764.34	2.34
121	688131	皓元医药	9,568,499.42	2.31
122	600641	万业企业	9,566,171.00	2.31
123	002768	国恩股份	9,432,423.00	2.28
124	300373	扬杰科技	9,419,993.00	2.27
125	301018	申菱环境	9,282,081.00	2.24
126	000963	华东医药	9,266,188.40	2.24
127	688116	天奈科技	9,144,909.11	2.21
128	300617	安靠智电	9,121,556.00	2.20
129	600985	淮北矿业	9,068,114.00	2.19
130	600603	广汇物流	8,930,522.00	2.15
131	601669	中国电建	8,902,212.00	2.15
132	300450	先导智能	8,886,680.79	2.14
133	600481	双良节能	8,785,467.42	2.12
134	688348	昱能科技	8,740,661.90	2.11
135	002466	天齐锂业	8,705,252.84	2.10
136	002011	盾安环境	8,669,456.00	2.09
137	688005	容百科技	8,563,835.06	2.07
138	002262	恩华药业	8,464,266.86	2.04
139	600491	龙元建设	8,394,857.00	2.03
140	688202	美迪西	8,368,224.89	2.02

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

#### 8.4.2 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	600048	保利发展	58,343,049.05	14.08
2	600519	贵州茅台	51,930,983.06	12.53
3	600383	金地集团	47,398,102.00	11.44
4	603348	文灿股份	46,068,408.60	11.12
5	603198	迎驾贡酒	41,662,959.07	10.05
6	688556	高测股份	40,937,668.31	9.88
7	000568	泸州老窖	40,551,246.00	9.78
8	688063	派能科技	39,609,429.53	9.56
9	605117	德业股份	38,137,529.40	9.20
10	688326	经纬恒润	37,008,109.01	8.93
11	002487	大金重工	35,607,609.07	8.59
12	300438	鹏辉能源	35,547,642.42	8.58
13	000858	五粮液	33,722,781.61	8.14
14	001914	招商积余	33,540,339.99	8.09
15	603876	鼎胜新材	31,641,937.00	7.63
16	600559	老白干酒	31,326,496.55	7.56
17	600702	舍得酒业	30,324,267.00	7.32
18	000069	华侨城 A	29,022,662.00	7.00
19	001979	招商蛇口	28,834,069.00	6.96
20	000596	古井贡酒	27,078,739.00	6.53
21	002805	丰元股份	26,987,207.06	6.51
22	002865	钧达股份	26,655,391.00	6.43
23	000002	万科 A	26,603,537.04	6.42
24	300820	英杰电气	25,964,513.45	6.26
25	600153	建发股份	25,905,014.76	6.25
26	688559	海目星	25,319,614.40	6.11
27	300750	宁德时代	23,960,556.00	5.78
28	601155	新城控股	23,760,142.00	5.73
29	002531	天顺风能	22,619,889.00	5.46
30	600809	山西汾酒	21,150,033.00	5.10

31	300769	德方纳米	20,725,430.00	5.00
32	688111	金山办公	20,133,752.39	4.86
33	688032	禾迈股份	19,974,592.68	4.82
34	600325	华发股份	19,757,244.00	4.77
35	002304	洋河股份	19,145,733.00	4.62
36	002937	兴瑞科技	19,119,171.80	4.61
37	300457	赢合科技	18,656,667.62	4.50
38	600522	中天科技	18,625,682.11	4.49
39	000729	燕京啤酒	18,002,140.28	4.34
40	003031	中瓷电子	17,789,459.15	4.29
41	000887	中鼎股份	17,671,903.00	4.26
42	300260	新莱应材	17,595,083.00	4.25
43	002006	精功科技	17,098,681.00	4.13
44	002101	广东鸿图	17,075,288.00	4.12
45	688048	长光华芯	17,044,813.81	4.11
46	002335	科华数据	16,892,579.46	4.08
47	002897	意华股份	16,683,893.00	4.03
48	688667	菱电电控	16,515,548.71	3.98
49	688390	固德威	16,397,411.63	3.96
50	300428	立中集团	16,295,209.52	3.93
51	002851	麦格米特	16,178,645.00	3.90
52	688248	南网科技	16,055,436.46	3.87
53	688408	中信博	15,975,982.01	3.85
54	688122	西部超导	15,764,203.00	3.80
55	002965	祥鑫科技	15,753,199.52	3.80
56	002518	科士达	15,686,354.00	3.78
57	688017	绿的谐波	14,995,011.45	3.62
58	002508	老板电器	14,801,227.00	3.57
59	002866	传艺科技	14,695,859.00	3.55
60	688071	华依科技	14,520,031.97	3.50
61	301071	力量钻石	14,491,195.30	3.50

62	000933	神火股份	14,471,971.00	3.49
63	300014	亿纬锂能	14,418,474.71	3.48
64	600141	兴发集团	14,415,456.00	3.48
65	002068	黑猫股份	14,345,431.36	3.46
66	688072	拓荆科技	14,300,848.38	3.45
67	603688	石英股份	14,215,125.00	3.43
68	300763	锦浪科技	14,192,120.00	3.42
69	688560	明冠新材	14,018,045.10	3.38
70	301155	海力风电	13,471,086.02	3.25
71	688700	东威科技	13,324,547.32	3.21
72	600875	东方电气	13,279,607.60	3.20
73	688677	海泰新光	13,259,909.02	3.20
74	600801	华新水泥	13,162,146.00	3.18
75	600256	广汇能源	13,066,536.74	3.15
76	688262	国芯科技	12,901,875.33	3.11
77	002791	坚朗五金	12,899,156.00	3.11
78	688337	普源精电	12,806,371.96	3.09
79	000736	中交地产	12,800,843.90	3.09
80	300737	科顺股份	12,782,974.20	3.08
81	002885	京泉华	12,714,589.00	3.07
82	000983	山西焦煤	12,542,316.00	3.03
83	002475	立讯精密	12,289,639.00	2.97
84	002623	亚玛顿	12,283,368.00	2.96
85	300517	海波重科	12,128,685.90	2.93
86	300496	中科创达	12,021,258.00	2.90
87	000656	金科股份	11,942,620.00	2.88
88	688301	奕瑞科技	11,855,622.79	2.86
89	300207	欣旺达	11,761,258.61	2.84
90	002906	华阳集团	11,708,528.00	2.82
91	601666	平煤股份	11,685,585.00	2.82
92	603596	伯特利	11,510,507.85	2.78

93	601689	拓普集团	11,468,320.75	2.77
94	600188	兖矿能源	11,323,420.00	2.73
95	002241	歌尔股份	11,242,244.00	2.71
96	301268	铭利达	11,202,927.19	2.70
97	603997	继峰股份	11,007,358.00	2.66
98	300724	捷佳伟创	10,990,256.00	2.65
99	688518	联赢激光	10,949,288.91	2.64
100	601166	兴业银行	10,910,336.00	2.63
101	002895	川恒股份	10,793,374.00	2.60
102	002384	东山精密	10,617,666.20	2.56
103	002920	德赛西威	10,572,674.00	2.55
104	301168	通灵股份	10,557,111.00	2.55
105	688499	利元亨	10,455,131.62	2.52
106	601208	东材科技	10,393,560.80	2.51
107	688516	奥特维	10,360,436.71	2.50
108	600348	华阳股份	10,251,377.00	2.47
109	300842	帝科股份	10,207,237.00	2.46
110	300203	聚光科技	10,072,871.00	2.43
111	600988	赤峰黄金	10,054,280.00	2.43
112	000625	长安汽车	9,963,613.30	2.40
113	300982	苏文电能	9,927,732.90	2.40
114	603306	华懋科技	9,895,265.00	2.39
115	688116	天奈科技	9,700,505.83	2.34
116	603063	禾望电气	9,513,725.00	2.30
117	603138	海量数据	9,502,879.23	2.29
118	300450	先导智能	9,434,705.15	2.28
119	688268	华特气体	9,412,621.80	2.27
120	605123	派克新材	9,355,715.00	2.26
121	002824	和胜股份	9,286,713.00	2.24
122	605133	嵘泰股份	9,279,764.00	2.24
123	600533	栖霞建设	9,230,214.00	2.23

124	600699	均胜电子	9,193,473.48	2.22
125	300745	欣锐科技	9,115,927.00	2.20
126	002011	盾安环境	9,096,165.00	2.19
127	002768	国恩股份	8,978,334.00	2.17
128	688348	昱能科技	8,872,906.60	2.14
129	300068	南都电源	8,801,714.00	2.12
130	300617	安靠智电	8,799,753.44	2.12
131	301018	申菱环境	8,607,422.00	2.08
132	688131	皓元医药	8,584,376.46	2.07
133	300373	扬杰科技	8,479,593.00	2.05
134	600985	淮北矿业	8,448,181.00	2.04
135	688005	容百科技	8,411,143.50	2.03
136	002262	恩华药业	8,390,738.54	2.02
137	300498	温氏股份	8,386,080.00	2.02
138	002466	天齐锂业	8,346,751.00	2.01
139	600481	双良节能	8,330,097.90	2.01
140	601669	中国电建	8,303,912.00	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,350,133,195.68
卖出股票收入（成交）总额	3,456,282,111.05

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

**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 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**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未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。**

**8.12.2 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。**

**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	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,977.04
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,977.04

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §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
6,172	35,479.13	0.00	0.00%	218,977,189.61	100.00%

#### 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	3,864.19	0.0017%

#### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年12月05日)基金份额总额	205,971,105.22
本报告期期初基金份额总额	393,325,719.27
本报告期基金总申购份额	3,490,545.99
减：本报告期基金总赎回份额	177,839,075.65
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	218,977,189.61

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务份额。

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开过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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专业基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内基金管理人、基金财产未涉及诉讼，本报告期内无对基金托管业务产生重大影响的重大诉讼和仲裁事项。

### 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变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘任的为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自2018年起为本基金提供审计服务至今，本报告期内支付审计费45000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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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	
中信建投证券	2	6,806,264,654.36	100.00%	6,296,710.73	100.00%	-

### 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
中信建投证券	951,199.08	100.00%	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于凯石澜龙头经济定期开放混合型证券投资基金转型暨凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效的公告	中国证券报、公司官网	2022-01-25
2	凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金招募说明书及产品资料概要更新	中国证券报、公司官网	2022-01-25
3	凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金经	中国证券报、公司官网	2022-12-10

	理变更公告		
4	凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金招募说明书及产品资料概要更新-2022年第2次更新	中国证券报、公司官网	2022-12-13

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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、中国证监会批准设立凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金的文件
- 2、《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、凯石基金管理有限公司的业务资格批件、营业执照和公司章程
- 6、报告期内凯石澜龙头经济一年持有期混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区延安东路1号2层

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人营业时间免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60431122，公司网址：[www.vstonefund.com](http://www.vstonefund.com)。

凯石基金管理有限公司  
二〇二三年三月三十日