

安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混 合型证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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遵规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§ 6 审计报告	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§ 8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	59
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.....	59
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.....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
8.12 投资组合报告附注.....	59
§9 基金份额持有人信息.....	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	62
§10 开放式基金份额变动.....	62
§11 重大事件揭示.....	62
11.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
11.4 基金投资策略的改变.....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
11.8 其他重大事件.....	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	67
§13 备查文件目录.....	67
13.1 备查文件目录.....	67
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	安信工业 4.0 混合	
基金主代码	004521	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 7 月 20 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7,350,029.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C
下属分级基金的交易代码	004521	004522
报告期末下属分级基金的份额总额	2,588,406.58 份	4,761,622.56 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过聚焦与工业 4.0 高度相关的优质标的，在合理控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金净资产的长期稳健增长。
投资策略	<p>本基金所称的工业 4.0 主题投资涉及的企业类型包括但不限于以下四类：人工智能算法与数据供应商、硬件设备供应商、系统集成商和智慧工厂运营商等。</p> <p>本基金通过综合考虑国内宏观经济趋势、利率变化趋势、国内股票市场估值水平、海外主要经济体经济和资本市场运行状况等因素，合理比较各大类资产风险收益比，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具及其他投资品种的投资比例。本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，结合收益率曲线变化，合理配置长、中、短期债券比例。本基金衍生品投资策略以风险控制为主。在资产支持证券投资策略上，本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金可投资于港股通标的股票，从而面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		安信基金管理有限责任公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	胡波
	联系电话	0755-82509999	021-61618888
	电子邮箱	service@essencefund.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		4008-088-088	95528
传真		0755-82799292	021-63602540
注册地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址		广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码		518026	200001
法定代表人		刘入领	郑杨

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.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C
本期	171,597.00	226,753.42	2,315,777.6	546,281.69	3,356,815.7	1,112,272.2

已实现收益			0		6	2
本期利润	43,718.84	3,312.73	1,154,472.95	126,925.44	6,368,977.37	1,906,107.74
加权平均基金份额本期利润	0.0160	0.0006	0.1492	0.0768	0.3400	0.2813
本期加权平均净值利润率	1.27%	0.05%	13.72%	6.75%	38.21%	31.96%
本期基金份额净值增长率	0.08%	-0.33%	20.25%	20.05%	42.29%	42.14%
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	664,637.43	1,170,882.50	966,268.92	266,083.48	-359,620.41	-65,755.60
期末可供分配基金份额利润	0.2568	0.2459	0.2558	0.2500	-0.0246	-0.0274
期末基金资产净值	3,253,044.01	5,932,505.06	4,743,748.79	1,330,607.24	15,267,724.14	2,496,578.19
期末基金份额	1.2568	1.2459	1.2558	1.2500	1.0443	1.0412

净值						
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	25.68%	24.59%	25.58%	25.00%	4.43%	4.12%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信工业 4.0 混合 A

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	2.23%	1.04%	0.67%	0.46%	1.56%	0.58%
过去六个月	0.57%	1.17%	-2.38%	0.60%	2.95%	0.57%
过去一年	0.08%	1.33%	0.15%	0.67%	-0.07%	0.66%
过去三年	71.25%	1.37%	33.52%	0.74%	37.73%	0.63%
自基金合同生效起至今	25.68%	1.28%	25.66%	0.73%	0.02%	0.55%

安信工业 4.0 混合 C

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	2.12%	1.04%	0.67%	0.46%	1.45%	0.58%
过去六个月	0.36%	1.17%	-2.38%	0.60%	2.74%	0.57%
过去一年	-0.33%	1.33%	0.15%	0.67%	-0.48%	0.66%
过去三年	70.09%	1.37%	33.52%	0.74%	36.57%	0.63%
自基金合同生效起至今	24.59%	1.28%	25.66%	0.73%	-1.07%	0.55%

注：根据《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×40%+恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。沪深 300 指数是中证指数有限公司编制的包含上海、深圳两个证券交易所流动性好、规模最大的 300 只 A 股为样本的成分股指数，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强、流动性好，同时公信力较好的股票指数，适合作为本基金股票投资的比较基准。本基金选择该指数作为股票（不含港股通标的股票）投资部分的业绩比较基准。恒生 AH 指数系列包括同时以 A 股形式及 H 股形式上市，市值最大及成交最活跃的中国公司为成份股。其中，恒生 AH 股 H 指数用以量度成份股在 H 股市场的表现。本基金选择该指数作为港股通标的股票投资部分的业绩比较基准。中证全债指数是中证指数有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成，中证指数公司每日计算并发布中证全债的收盘指数及相应的债券属性指标，为债券投资者提供投资分析工具和业绩评价基准。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 40%、20%、40%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

安信工业4.0混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信工业4.0混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

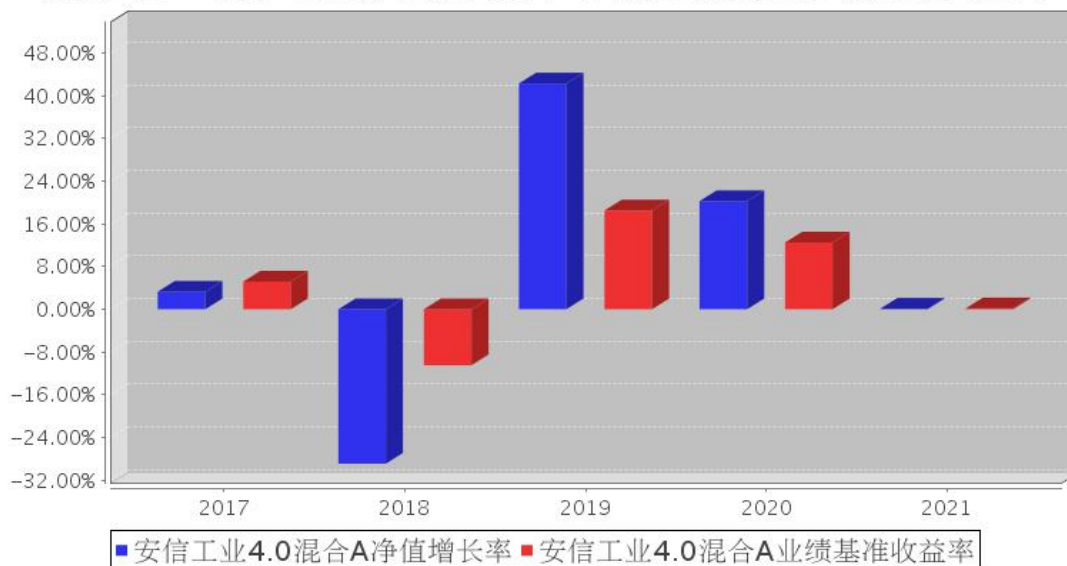


注：1、本基金基金合同生效日为 2017 年 7 月 20 日。

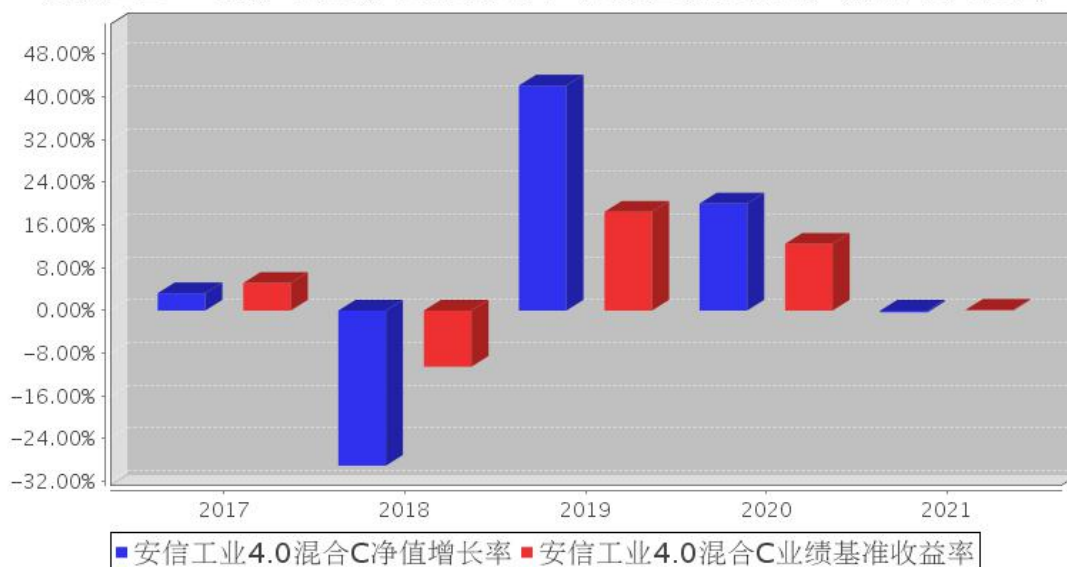
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

3.2.3 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

安信工业4.0混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信工业4.0混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 77 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、

安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谭 珺 娜	本基金的基金经理	2018 年 8 月 8 日	-	15 年	谭珺娜女士，经济学学士。历任招商证券股份有限公司国际业务部业务助理、安信证券股份有限公司证券投资部内部风险控制员、交易员，安信基金管理有限责任公司运营部交易员、特定资产管理部投资经理助理、投资银行部投资经理、研究部研究员。现任安信基金管理有限责任公司权益投资部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。现任安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金的基金经

					理助理，安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金的基金经理。
沈明辉	本基金的基金经理	2021 年 2 月 18 日	-	5 年	沈明辉先生，管理学硕士。历任广发证券发展研究中心分析师，恒大集团研究院研究员。安信基金管理有限责任公司研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司研究部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。
沈明辉	本基金的基金经理助理	2020 年 7 月 15 日	2021 年 2 月 18 日	5 年	沈明辉先生，管理学硕士。历任广发证券发展研究中心分析师，恒大集团研究院研究员。安信基金管理有限责任公司研究部研究员，现任安信基金管理有限责任公司研究部基金经理。曾任安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理；现任安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。

2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年国内经济增速呈现逐季放缓的情况，国内经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力。下半年需求端由于疫情及避险情绪影响，消费复苏乏力；供给端受大宗商品价格波动、限电等影响，供应链的稳定性面临冲击。从外部环境看，虽然全球经济整体复苏，但基础并不稳固，波动性大、脆弱性高、结构性失衡等特征凸显。

同时我们也看到，12 月中央经济工作会议确立“稳字当头、稳中求进”经济工作总基调，一定程度上提振市场信心，预期流动性依然会维持相对宽松。我们对中国经济的相对优势、优秀中国企业的长期前景保持乐观态度，因此市场不乏细分领域的投资机会。我们更多寻找结构性机会，关注数字化、智能化方向，关注基本面存在改善预期或者具备一定估值修复动力的机会，将性价比高、产业趋势确定、景气度高的优质成长股作为主要配置方向。

本报告期内，本基金聚焦在软件、互联网、电子、电力设备新能源等领域，在我们的能力圈范围内，自下而上地选择性价比较好的个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 基金份额净值为 1.2568 元,本报告期基金份额净值增长率为 0.08%;截至本报告期末本基金 C 基金份额净值为 1.2459 元,本报告期基金份额净值增长率为-0.33%;同期业绩比较基准收益率为 0.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年国内宏观经济面临需求收缩、预期转弱等压力。国内疫情此起彼伏,影响人员流动和消费;地产销售下行拐点已现,房地产降温可能开始影响工业品需求;海外消费动能减弱以及供应链恢复,使得我国出口下行压力逐渐体现。

股票市场而言,我们谨慎乐观:美联储已经开始讨论缩表的节奏,本轮缩表的节奏可能比上一轮货币政策正常化更快,历史上美联储阶段性的第一次加息对美股和 A 股可能都有负面影响。而在当前环境下,国内的流动性很难发生实质性的收缩,易松难紧成为常态,一定程度上对冲了海外缩表的影响。这样的复杂环境将会对市场节奏,甚至是风格层面产生较大影响。从公司基本盘面看,全球经济持续恢复,上市公司企业盈利将保持较快增长。我们对中国经济的相对优势,优秀中国企业的长期前景还是保持着乐观的态度。

在投资方向上,我们将重点聚焦在互联网、智能驾驶、云计算等领域布局。互联网平台公司经历 2021 年的政策监管,股价和估值处于相对低位,市场已经反映了较多悲观预期,预计 2022 年将迎来政策底和业绩底,可逢低布局互联网公司估值业绩修复带来的双击机会。汽车智能化当前仍处于起步阶段,智能化将是电动化之后下一个浪潮,由此带来软件应用、电子元器件、芯片、模组等多个领域的投资机会,能够在汽车智能化过程中卡位成功具备长期竞争力的公司更具看点,在其中寻找汽车收入占比高、国产替代、供需结构好的子领域和公司。

因此,2022 年我们仍将聚焦数字化、智能化等领域,注重业绩及性价比匹配的投资机会,努力挖掘中长期的投资机会,为持有人创造良好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定,对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。

会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

本报告期内，本基金出现了连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，时间范围为 2021 年 1 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日。

自 2018 年 5 月 24 日至本报告期末，本基金出现了连续 60 个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已根据法律法规及基金合同要求拟定相关解决方案上报中国证券监督管理委员会。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对安信工业 4.0

主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，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

本报告期内，由安信基金管理有限责任公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，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。 我们认为，后附的安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金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>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，管理层负责评估安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。</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，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，就可能对安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信工业 4.0 主题沪港深精选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>

	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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	邓雯
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2022 年 03 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,018,416.07	544,290.60
结算备付金		131,142.11	386,871.56
存出保证金		12,484.00	7,754.75
交易性金融资产	7.4.7.2	7,536,538.30	5,225,071.45
其中：股票投资		7,536,538.30	5,225,071.45
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	700,000.00	-
应收证券清算款		453,375.67	64,507.36
应收利息	7.4.7.5	-233.54	305.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	6,810.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,851,722.61	6,235,611.52
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		609,917.66	-
应付赎回款		221.31	125,331.70
应付管理人报酬		12,134.95	9,137.16
应付托管费		809.01	609.14
应付销售服务费		2,097.04	525.05
应付交易费用	7.4.7.7	30,993.57	15,560.77
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	10,000.00	10,091.67
负债合计		666,173.54	161,255.49
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,350,029.14	4,842,003.63
未分配利润	7.4.7.10	1,835,519.93	1,232,352.40
所有者权益合计		9,185,549.07	6,074,356.03
负债和所有者权益总计		9,851,722.61	6,235,611.52

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 7,350,029.14 份，其中安信工业 4.0 混合 A 基金份额总额为 2,588,406.58 份，基金份额净值 1.2568 元；安信工业 4.0 混合 C 基金份额总额为 4,761,622.56 份，基金份额净值 1.2459 元。

7.2 利润表

会计主体：安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		510,241.97	1,566,131.60
1. 利息收入		14,289.13	27,901.68
其中：存款利息收入	7.4.7.11	13,476.58	27,657.55
债券利息收入		28.88	146.92
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		783.67	97.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		831,304.13	3,039,239.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	781,784.57	2,976,793.35
基金投资收益	-	-	-

债券投资收益	7.4.7.13	5,806.81	7,866.34
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	43,712.75	54,580.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-351,318.85	-1,580,660.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	15,967.56	79,650.94
减：二、费用		463,210.40	284,733.21
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	147,314.20	94,321.34
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,821.03	10,377.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	25,439.98	2,900.66
4. 交易费用	7.4.7.20	269,145.10	165,043.82
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.09	-
7. 其他费用	7.4.7.21	11,490.00	12,089.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		47,031.57	1,281,398.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		47,031.57	1,281,398.39

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,842,003.63	1,232,352.40	6,074,356.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	47,031.57	47,031.57
三、本期基金份	2,508,025.51	556,135.96	3,064,161.47

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	9,494,942.92	2,454,231.01	11,949,173.93
2. 基金赎回款	-6,986,917.41	-1,898,095.05	-8,885,012.46
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）	7,350,029.14	1,835,519.93	9,185,549.07
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	17,017,377.11	746,925.22	17,764,302.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,281,398.39	1,281,398.39
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）	-12,175,373.48	-795,971.21	-12,971,344.69
其中：1. 基金申购款	17,941,491.40	3,355,569.82	21,297,061.22
2. 基金赎回款	-30,116,864.88	-4,151,541.03	-34,268,405.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,842,003.63	1,232,352.40	6,074,356.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

刘入领	范瑛	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2015 年 7 月 13 日下发的证监许可[2015]1614 号文“关于准予安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金募集期间为 2017 年 4 月 24 日至 2017 年 7 月 14 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2017)验字 60962175_H06 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 7 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 219,751,374.82 份，其中认购资金利息折合 45,269.91 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、沪港通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、债券、债券回购、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生工具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相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资

范围。本基金的投资比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%（其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的 0%-95%）；本基金以工业 4.0 主题相关证券为主要投资对象，投资于工业 4.0 主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，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×40%+恒生 AH 股 H 指数收益率×20%+中证全债指数收益率×40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

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

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

(2) 金融负债分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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

后续计量

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

终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

金融资产转移

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信

息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为股利收益。债券投资在持有期间应取得的按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券投资在持有期间应取得的按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除在适用情况下由证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

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

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

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

7.4.6.3 增值税及附加

据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收

入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	1,018,416.07	544,290.60
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	1,018,416.07	544,290.60

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	7,360,617.72	7,536,538.30	175,920.58
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	7,360,617.72	7,536,538.30	175,920.58

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	4,697,832.02	5,225,071.45	527,239.43
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	4,697,832.02	5,225,071.45	527,239.43

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	700,000.00	-
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	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	171.98	284.97

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	84.26	16.50
应收债券利息		
应收资产支持证券利息		
应收买入返售证券利息	-495.94	
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	6.16	3.74
合计	-233.54	305.21

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	30,993.57	15,560.77
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	30,993.57	15,560.77

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	-	91.67
应付证券出借违约金	-	-
应付审计费	10,000.00	10,000.00
合计	10,000.00	10,091.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信工业 4.0 混合 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,777,479.87	3,777,479.87
本期申购	1,829,170.27	1,829,170.27
本期赎回（以“-”号填列）	-3,018,243.56	-3,018,243.56
本期末	2,588,406.58	2,588,406.58

安信工业 4.0 混合 C

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,064,523.76	1,064,523.76
本期申购	7,665,772.65	7,665,772.65
本期赎回（以“-”号填列）	-3,968,673.85	-3,968,673.85
本期末	4,761,622.56	4,761,622.56

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信工业 4.0 混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	992,362.13	-26,093.21	966,268.92
本期利润	171,597.00	-127,878.16	43,718.84
本期基金份额交易产生的变动数	-325,775.89	-19,574.44	-345,350.33
其中：基金申购款	525,833.94	-32,522.54	493,311.40
基金赎回款	-851,609.83	12,948.10	-838,661.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	838,183.24	-173,545.81	664,637.43

安信工业 4.0 混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	273,499.47	-7,415.99	266,083.48
本期利润	226,753.42	-223,440.69	3,312.73
本期基金份额交易产生的变动数	988,061.38	-86,575.09	901,486.29
其中：基金申购款	2,145,270.57	-184,350.96	1,960,919.61
基金赎回款	-1,157,209.19	97,775.87	-1,059,433.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,488,314.27	-317,431.77	1,170,882.50

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	10,110.88
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	3,191.09	2,240.77
其他	174.61	159.41

合计	13,476.58	27,657.55
----	-----------	-----------

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	93,313,103.18	60,124,645.67
减：卖出股票成本总额	92,531,318.61	57,147,852.32
买卖股票差价收入	781,784.57	2,976,793.35

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	511,800.71	433,239.97
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	504,926.55	423,028.94
减：应收利息总额	1,067.35	2,344.69
买卖债券差价收入	5,806.81	7,866.34

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	43,712.75	54,580.19
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	43,712.75	54,580.19
----	-----------	-----------

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-351,318.85	-1,580,660.90
股票投资	-351,318.85	-1,580,660.90
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	-351,318.85	-1,580,660.90

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	15,849.95	78,325.42
基金转换费收入	117.61	1,325.52
合计	15,967.56	79,650.94

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	269,145.10	165,043.82
银行间市场交易费用	-	-
合计	269,145.10	165,043.82

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	10,000.00	10,000.00

信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,490.00	2,089.73
合计	11,490.00	12,089.73

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“浦发银行”）	基金托管人
安信证券股份有限公司（“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本期及上年度可比期间均无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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	147,314.20	94,321.34
其中：支付销售机构的客户维护费	23,998.04	25,643.50

注：1、基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、自 2020 年 10 月 14 日起，本基金管理费的年费率由 0.80% 变更为 1.50%。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,821.03	10,377.66

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费均按前一日的基金资产净值 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C	合计

安信基金	-	19,640.53	19,640.53
安信证券	-	201.57	201.57
合计	-	19,842.10	19,842.10
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C	合计
安信基金	-	143.31	143.31
安信证券	-	214.81	214.81
合计	-	358.12	358.12

注：1、基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

2、自 2020 年 10 月 14 日起，本基金销售服务费的年费率由 0.10% 变更为 0.40%。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金于本期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本期及上年度可比期间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

份额单位：份

安信工业 4.0 混合 C

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
安信乾盛财富管理(深圳)有限公司	3,973,931.01	54.07	-	-

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	1,018,416.07	10,110.88	544,290.60	25,257.37

注：本基金的银行存款由基金托管人浦发银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2020 年 12 月 31 日：无）。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,018,416.07	-	-	-	1,018,416.07
结算备付金	131,142.11	-	-	-	131,142.11
存出保证金	12,484.00	-	-	-	12,484.00
交易性金融资产	-	-	-	7,536,538.30	7,536,538.30
买入返售金融资产	700,000.00	-	-	-	700,000.00
应收利息	-	-	-	-233.54	-233.54
应收证券清算款	-	-	-	453,375.67	453,375.67
资产总计	1,862,042.18	-	-	7,989,680.43	9,851,722.61
负债					
应付赎回款	-	-	-	221.31	221.31
应付管理人报酬	-	-	-	12,134.95	12,134.95
应付托管费	-	-	-	809.01	809.01
应付证券清算款	-	-	-	609,917.66	609,917.66
应付销售服务费	-	-	-	2,097.04	2,097.04
应付交易费用	-	-	-	30,993.57	30,993.57
其他负债	-	-	-	10,000.00	10,000.00
负债总计	-	-	-	666,173.54	666,173.54
利率敏感度缺口	1,862,042.18	-	-	7,323,506.89	9,185,549.07
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产				
银行存款	544,290.60	-	-	544,290.60
结算备付金	386,871.56	-	-	386,871.56
存出保证金	7,754.75	-	-	7,754.75
交易性金融资产	-	-	5,225,071.45	5,225,071.45
应收利息	-	-	305.21	305.21
应收申购款	-	-	6,810.59	6,810.59
应收证券清算款	-	-	64,507.36	64,507.36
资产总计	938,916.91	-	5,296,694.61	6,235,611.52
负债				
应付赎回款	-	-	125,331.70	125,331.70
应付管理人报酬	-	-	9,137.16	9,137.16
应付托管费	-	-	609.14	609.14
应付销售服务费	-	-	525.05	525.05
应付交易费用	-	-	15,560.77	15,560.77
其他负债	-	-	10,091.67	10,091.67
负债总计	-	-	161,255.49	161,255.49
利率敏感度缺口	938,916.91	-	5,135,439.12	6,074,356.03

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

本基金于 2021 年 12 月 31 日未持有交易性债券投资，因此当利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动对年末基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				

交易性金融资产	-	2,572,576.44	-	2,572,576.44
资产合计	-	2,572,576.44	-	2,572,576.44
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,572,576.44	-	2,572,576.44
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,237,458.25	-	2,237,458.25
资产合计	-	2,237,458.25	-	2,237,458.25
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,237,458.25	-	2,237,458.25

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 所有外币相对人民币升值5%	128,628.82	111,872.91
	2. 所有外币相对人民币贬值5%	-128,628.82	-111,872.91

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为 0%-95%（其中投资于香港联合交易所上市股票的投资比例占基金资产的 0%-95%）；本基金以工业 4.0 主题相关证券为主要投资对象，投资于工业 4.0 主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；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，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、 应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,536,538.30	82.05	5,225,071.45	86.02
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,536,538.30	82.05	5,225,071.45	86.02

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月

			31 日)
1. 沪深 300 指数上升 5%		419,030.12	299,906.41
2. 沪深 300 指数下降 5%		-419,030.12	-299,906.41

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 7,536,538.30 元，无划分为第二层次及第三层次余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 5,225,071.45 元，无划分为第二层次及第三层次余额）。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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

第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日，本基金的资产净值为人民币 9,185,549.07 元，已连

续超过六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元。本基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

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

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,536,538.30	76.50
	其中:股票	7,536,538.30	76.50
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	700,000.00	7.11
	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	1,149,558.18	11.67
8	其他各项资产	465,626.13	4.73
9	合计	9,851,722.61	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 2,572,576.44 元,占净值比例 28.01%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,144,911.86	34.24
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,400,656.00	15.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	27,160.00	0.30
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	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	391,234.00	4.26
S	综合	-	-
	合计	4,963,961.86	54.04

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	287,795.20	3.13
日常消费品	124,275.20	1.35
通讯服务	1,048,324.76	11.41
信息技术	1,112,181.28	12.11
合计	2,572,576.44	28.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	1,482	553,496.89	6.03
2	002402	和而泰	20,000	548,600.00	5.97
3	300687	赛意信息	18,300	533,994.00	5.81
4	02382	舜宇光学科技	2,500	504,050.40	5.49
5	603501	韦尔股份	1,600	497,232.00	5.41

6	01024	快手-W	8,400	494,827.87	5.39
7	01347	华虹半导体	13,000	457,038.40	4.98
8	603613	国联股份	3,000	322,500.00	3.51
9	603986	兆易创新	1,800	316,530.00	3.45
10	300496	中科创达	2,200	304,524.00	3.32
11	002739	万达电影	19,300	298,764.00	3.25
12	002881	美格智能	6,300	270,144.00	2.94
13	000977	浪潮信息	7,500	268,725.00	2.93
14	002624	完美世界	11,200	227,472.00	2.48
15	688408	中信博	1,250	220,637.50	2.40
16	300984	金沃股份	3,500	215,775.00	2.35
17	688668	鼎通科技	2,632	185,503.36	2.02
18	03690	美团-W	1,000	184,287.04	2.01
19	300095	华伍股份	8,700	164,256.00	1.79
20	300648	星云股份	2,700	162,513.00	1.77
21	02018	瑞声科技	6,000	151,092.48	1.64
22	300850	新强联	800	142,808.00	1.55
23	03331	维达国际	8,000	124,275.20	1.35
24	00839	中教控股	10,000	103,508.16	1.13
25	603103	横店影视	7,000	92,470.00	1.01
26	300351	永贵电器	5,800	86,072.00	0.94
27	301129	瑞纳智能	700	59,276.00	0.65
28	300416	苏试试验	800	27,160.00	0.30
29	600845	宝信软件	200	12,166.00	0.13
30	002415	海康威视	100	5,232.00	0.06
31	603997	继峰股份	100	1,608.00	0.02

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	002402	和而泰	2,174,031.00	35.79
2	603613	国联股份	1,944,617.00	32.01
3	002624	完美世界	1,686,605.00	27.77
4	03690	美团-W	1,504,976.63	24.78
5	600570	恒生电子	1,471,826.00	24.23
6	00700	腾讯控股	1,421,397.71	23.40
7	01810	小米集团-W	1,368,078.82	22.52
8	000977	浪潮信息	1,351,075.00	22.24
9	002415	海康威视	1,336,261.00	22.00
10	300687	赛意信息	1,299,289.00	21.39

11	002027	分众传媒	1,256,009.00	20.68
12	688006	杭可科技	1,239,872.28	20.41
13	002459	晶澳科技	1,205,916.00	19.85
14	00285	比亚迪电子	1,200,586.64	19.76
15	600884	杉杉股份	1,169,899.00	19.26
16	000625	长安汽车	1,139,157.00	18.75
17	002906	华阳集团	1,122,718.00	18.48
18	600089	特变电工	1,103,797.00	18.17
19	002353	杰瑞股份	1,048,055.00	17.25
20	00268	金蝶国际	1,041,471.46	17.15
21	600438	通威股份	1,032,151.00	16.99
22	002920	德赛西威	1,021,247.54	16.81
23	300014	亿纬锂能	991,215.00	16.32
24	00763	中兴通讯	945,522.27	15.57
25	300496	中科创达	940,763.00	15.49
26	002230	科大讯飞	935,506.00	15.40
27	300073	当升科技	927,903.00	15.28
28	00868	信义玻璃	913,900.47	15.05
29	01919	中远海控	873,507.25	14.38
30	603185	上机数控	866,092.00	14.26
31	00981	中芯国际	860,185.94	14.16
32	300253	卫宁健康	848,603.00	13.97
33	002176	江特电机	840,853.00	13.84
34	002555	三七互娱	833,572.00	13.72
35	600845	宝信软件	830,421.00	13.67
36	06169	宇华教育	821,804.79	13.53
37	688388	嘉元科技	814,707.26	13.41
38	002833	弘亚数控	797,704.00	13.13
39	603501	韦尔股份	791,427.00	13.03
40	600110	诺德股份	789,766.00	13.00
41	01024	快手-W	781,662.09	12.87
42	000938	紫光股份	772,553.00	12.72
43	00941	中国移动	771,633.59	12.70
44	300271	华宇软件	759,550.00	12.50
45	002129	中环股份	754,676.00	12.42
46	603986	兆易创新	748,104.00	12.32
47	601615	明阳智能	727,886.00	11.98
48	002594	比亚迪	670,312.00	11.04
49	688005	容百科技	654,424.19	10.77
50	300451	创业慧康	649,149.60	10.69
51	000400	许继电气	619,807.00	10.20
52	300413	芒果超媒	615,661.00	10.14

53	300035	中科电气	606,416.00	9.98
54	002074	国轩高科	604,686.00	9.95
55	000725	京东方 A	604,296.00	9.95
56	300432	富临精工	582,833.00	9.59
57	688599	天合光能	574,680.82	9.46
58	09992	泡泡玛特	567,818.88	9.35
59	688518	联赢激光	559,919.49	9.22
60	002745	木林森	551,930.00	9.09
61	688667	菱电电控	548,326.64	9.03
62	002291	星期六	540,077.00	8.89
63	300627	华测导航	535,043.00	8.81
64	600699	均胜电子	526,939.00	8.67
65	600295	鄂尔多斯	515,407.00	8.48
66	300390	天华超净	507,796.00	8.36
67	601601	中国太保	505,513.00	8.32
68	300825	阿尔特	501,944.00	8.26
69	601012	隆基股份	483,497.00	7.96
70	002439	启明星辰	477,543.00	7.86
71	603659	璞泰来	476,812.00	7.85
72	688122	西部超导	467,387.25	7.69
73	600131	国网信通	465,888.00	7.67
74	300674	宇信科技	464,220.00	7.64
75	601222	林洋能源	457,851.00	7.54
76	002739	万达电影	452,316.00	7.45
77	01772	赣锋锂业	450,899.97	7.42
78	002508	老板电器	441,822.00	7.27
79	002245	蔚蓝锂芯	419,494.00	6.91
80	300953	震裕科技	419,491.00	6.91
81	300421	力星股份	418,882.00	6.90
82	603888	新华网	410,294.56	6.75
83	000100	TCL 科技	404,432.00	6.66
84	688696	极米科技	400,893.60	6.60
85	000526	学大教育	393,278.00	6.47
86	300033	同花顺	390,758.00	6.43
87	300984	金沃股份	382,838.00	6.30
88	601877	正泰电器	370,961.00	6.11
89	000039	中集集团	370,702.00	6.10
90	300770	新媒股份	353,470.00	5.82
91	000591	太阳能	350,493.00	5.77
92	002049	紫光国微	349,104.00	5.75
93	000651	格力电器	348,856.00	5.74
94	300274	阳光电源	344,018.00	5.66

95	02013	微盟集团	342,050.20	5.63
96	003021	兆威机电	339,169.00	5.58
97	00909	明源云	338,923.19	5.58
98	00772	阅文集团	328,234.72	5.40
99	003022	联泓新科	322,608.89	5.31
100	002236	大华股份	321,315.00	5.29
101	600273	嘉化能源	319,920.00	5.27
102	002130	沃尔核材	316,952.00	5.22
103	01378	中国宏桥	314,377.46	5.18
104	000762	西藏矿业	311,038.00	5.12
105	300850	新强联	309,398.00	5.09
106	300207	欣旺达	306,877.00	5.05
107	300628	亿联网络	305,228.00	5.02
108	002011	盾安环境	298,752.00	4.92
109	300088	长信科技	289,785.00	4.77
110	002371	北方华创	286,315.00	4.71
111	605098	行动教育	284,034.00	4.68
112	002881	美格智能	283,237.00	4.66
113	300769	德方纳米	280,577.00	4.62
114	600338	西藏珠峰	279,864.00	4.61
115	300095	华伍股份	279,718.00	4.60
116	600808	马钢股份	278,188.00	4.58
117	002667	鞍重股份	277,649.00	4.57
118	300726	宏达电子	276,349.00	4.55
119	002079	苏州固锝	271,950.00	4.48
120	002097	山河智能	270,976.00	4.46
121	02039	中集集团	270,738.09	4.46
122	603000	人民网	268,982.00	4.43
123	300115	长盈精密	263,417.00	4.34
124	300990	同飞股份	261,272.00	4.30
125	002028	思源电气	257,940.00	4.25
126	00883	中国海洋石油	248,486.84	4.09
127	300470	中密控股	244,286.00	4.02
128	300369	绿盟科技	243,916.00	4.02
129	600739	辽宁成大	232,672.00	3.83
130	688408	中信博	230,871.35	3.80
131	03331	维达国际	225,701.10	3.72
132	300841	康华生物	219,096.00	3.61
133	00992	联想集团	218,741.25	3.60
134	605020	永和股份	216,964.56	3.57
135	002312	川发龙麟	216,600.00	3.57
136	603067	振华股份	216,050.00	3.56

137	688127	蓝特光学	214,371.20	3.53
138	300316	晶盛机电	213,640.00	3.52
139	02020	安踏体育	212,272.93	3.49
140	002273	水晶光电	211,640.00	3.48
141	600926	杭州银行	210,840.00	3.47
142	000733	振华科技	207,200.00	3.41
143	002705	新宝股份	204,404.00	3.37
144	002032	苏泊尔	203,282.00	3.35
145	01951	锦欣生殖	199,218.87	3.28
146	000066	中国长城	198,468.00	3.27
147	601016	节能风电	197,098.00	3.24
148	300750	宁德时代	195,010.00	3.21
149	603859	能科科技	193,110.00	3.18
150	300763	锦浪科技	192,629.00	3.17
151	688088	虹软科技	192,111.42	3.16
152	601688	华泰证券	190,452.00	3.14
153	601126	四方股份	189,485.00	3.12
154	300785	值得买	189,346.00	3.12
155	688383	新益昌	189,305.19	3.12
156	002409	雅克科技	186,599.00	3.07
157	300752	隆利科技	186,097.00	3.06
158	300799	左江科技	185,430.00	3.05
159	688668	鼎通科技	183,754.65	3.03
160	002425	凯撒文化	182,515.00	3.00
161	000959	首钢股份	182,424.00	3.00
162	603678	火炬电子	181,459.00	2.99
163	002636	金安国纪	179,820.00	2.96
164	300502	新易盛	179,509.00	2.96
165	06618	京东健康	164,444.99	2.71
166	300860	锋尚文化	159,784.00	2.63
167	300648	星云股份	158,592.00	2.61
168	603444	吉比特	157,030.00	2.59
169	601899	紫金矿业	155,379.00	2.56
170	300593	新雷能	154,140.00	2.54
171	002649	博彦科技	154,050.00	2.54
172	02018	瑞声科技	153,210.59	2.52
173	300457	赢合科技	150,026.00	2.47
174	01347	华虹半导体	144,141.48	2.37
175	000807	云铝股份	140,400.00	2.31
176	603533	掌阅科技	140,160.00	2.31
177	03888	金山软件	139,976.88	2.30
178	300124	汇川技术	138,360.00	2.28

179	688560	明冠新材	137,886.30	2.27
180	03898	时代电气	136,690.36	2.25
181	002967	广电计量	132,681.00	2.18
182	603396	金辰股份	131,104.00	2.16
183	688303	大全能源	124,695.98	2.05

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

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	002415	海康威视	1,906,139.00	31.38
2	603613	国联股份	1,727,457.13	28.44
3	002402	和而泰	1,699,003.00	27.97
4	002624	完美世界	1,698,085.00	27.95
5	03690	美团-W	1,556,948.35	25.63
6	600570	恒生电子	1,513,938.00	24.92
7	002027	分众传媒	1,511,165.00	24.88
8	00700	腾讯控股	1,428,024.03	23.51
9	688006	杭可科技	1,284,253.89	21.14
10	600884	杉杉股份	1,244,271.00	20.48
11	002459	晶澳科技	1,216,943.00	20.03
12	01810	小米集团-W	1,210,155.18	19.92
13	600089	特变电工	1,188,272.00	19.56
14	00285	比亚迪电子	1,184,848.60	19.51
15	002906	华阳集团	1,163,092.00	19.15
16	000625	长安汽车	1,101,649.20	18.14
17	002353	杰瑞股份	1,085,918.00	17.88
18	000977	浪潮信息	1,085,698.00	17.87
19	002920	德赛西威	1,062,604.00	17.49
20	300253	卫宁健康	1,048,044.00	17.25
21	000725	京东方 A	1,015,422.00	16.72
22	600438	通威股份	1,014,351.00	16.70
23	00268	金蝶国际	1,012,090.74	16.66
24	603185	上机数控	1,006,148.00	16.56
25	300073	当升科技	956,146.00	15.74
26	600845	宝信软件	954,912.00	15.72
27	00763	中兴通讯	953,311.38	15.69
28	300014	亿纬锂能	942,191.00	15.51
29	002176	江特电机	931,178.00	15.33
30	002230	科大讯飞	928,984.00	15.29

31	00868	信义玻璃	904,021.36	14.88
32	300687	赛意信息	902,936.00	14.86
33	000938	紫光股份	874,629.50	14.40
34	002833	弘亚数控	869,254.20	14.31
35	002555	三七互娱	865,306.00	14.25
36	00981	中芯国际	844,731.32	13.91
37	300271	华宇软件	842,966.83	13.88
38	300432	富临精工	816,418.00	13.44
39	06169	宇华教育	803,458.89	13.23
40	01919	中远海控	788,057.06	12.97
41	600110	诺德股份	780,225.00	12.84
42	00941	中国移动	766,802.48	12.62
43	002594	比亚迪	753,039.00	12.40
44	688388	嘉元科技	746,702.91	12.29
45	002129	中环股份	726,093.00	11.95
46	300035	中科电气	716,692.69	11.80
47	601615	明阳智能	708,111.00	11.66
48	300496	中科创达	685,146.00	11.28
49	300451	创业慧康	635,874.00	10.47
50	688518	联赢激光	622,186.13	10.24
51	688599	天合光能	608,677.56	10.02
52	688005	容百科技	586,863.18	9.66
53	000400	许继电气	584,588.00	9.62
54	688667	菱电电控	577,875.48	9.51
55	300413	芒果超媒	574,628.00	9.46
56	002745	木林森	566,417.00	9.32
57	300627	华测导航	563,590.00	9.28
58	002074	国轩高科	560,666.00	9.23
59	600295	鄂尔多斯	554,033.00	9.12
60	688122	西部超导	540,465.52	8.90
61	300825	阿尔特	538,013.00	8.86
62	09992	泡泡玛特	534,665.22	8.80
63	002475	立讯精密	525,959.70	8.66
64	002291	星期六	524,119.00	8.63
65	01772	赣锋锂业	521,770.60	8.59
66	300390	天华超净	519,118.00	8.55
67	300674	宇信科技	499,127.00	8.22
68	002245	蔚蓝锂芯	483,807.00	7.96
69	002439	启明星辰	474,105.00	7.81
70	603659	璞泰来	457,216.00	7.53
71	601601	中国太保	454,480.00	7.48
72	600699	均胜电子	447,277.00	7.36

73	601222	林洋能源	446,484.00	7.35
74	601012	隆基股份	436,262.60	7.18
75	603986	兆易创新	427,080.00	7.03
76	300088	长信科技	424,668.00	6.99
77	300421	力星股份	420,716.00	6.93
78	002508	老板电器	417,522.00	6.87
79	003021	兆威机电	410,539.00	6.76
80	600131	国网信通	407,262.00	6.70
81	002011	盾安环境	395,190.00	6.51
82	000100	TCL 科技	394,362.00	6.49
83	300953	震裕科技	392,610.00	6.46
84	603888	新华网	378,179.00	6.23
85	688696	极米科技	377,964.60	6.22
86	003022	联泓新科	376,450.00	6.20
87	000591	太阳能	364,830.00	6.01
88	300033	同花顺	358,253.00	5.90
89	002236	大华股份	352,328.00	5.80
90	601877	正泰电器	349,340.00	5.75
91	000526	学大教育	348,500.00	5.74
92	600273	嘉化能源	346,789.00	5.71
93	000039	中集集团	346,756.00	5.71
94	000651	格力电器	338,336.00	5.57
95	02013	微盟集团	336,056.62	5.53
96	002739	万达电影	330,880.00	5.45
97	01378	中国宏桥	329,728.68	5.43
98	300770	新媒股份	322,876.00	5.32
99	002049	紫光国微	315,096.00	5.19
100	603501	韦尔股份	314,848.00	5.18
101	300274	阳光电源	312,680.00	5.15
102	00772	阅文集团	310,714.06	5.12
103	00909	明源云	308,667.69	5.08
104	300726	宏达电子	299,082.00	4.92
105	300207	欣旺达	296,589.00	4.88
106	002130	沃尔核材	295,416.00	4.86
107	605098	行动教育	291,955.00	4.81
108	000762	西藏矿业	291,745.00	4.80
109	300769	德方纳米	289,372.00	4.76
110	002097	山河智能	287,861.00	4.74
111	300628	亿联网络	287,080.00	4.73
112	00883	中国海洋石油	275,791.00	4.54
113	300115	长盈精密	274,737.43	4.52
114	300369	绿盟科技	267,627.00	4.41

115	600338	西藏珠峰	267,346.00	4.40
116	02039	中集集团	267,320.27	4.40
117	600808	马钢股份	261,468.00	4.30
118	002667	鞍重股份	258,010.00	4.25
119	002371	北方华创	255,420.00	4.20
120	000066	中国长城	253,331.00	4.17
121	603000	人民网	253,110.00	4.17
122	002312	川发龙蟒	252,890.00	4.16
123	300990	同飞股份	248,422.00	4.09
124	300470	中密控股	247,151.00	4.07
125	002079	苏州固锟	246,029.00	4.05
126	688383	新益昌	233,977.10	3.85
127	300841	康华生物	229,752.00	3.78
128	600739	辽宁成大	226,554.15	3.73
129	605020	永和股份	224,422.40	3.69
130	002028	思源电气	221,500.00	3.65
131	300984	金沃股份	216,939.00	3.57
132	00241	阿里健康	215,880.65	3.55
133	603067	振华股份	215,200.00	3.54
134	002032	苏泊尔	207,196.00	3.41
135	300785	值得买	205,083.00	3.38
136	600926	杭州银行	199,220.00	3.28
137	688127	蓝特光学	198,976.36	3.28
138	300316	晶盛机电	197,819.00	3.26
139	00992	联想集团	196,004.12	3.23
140	002273	水晶光电	195,910.00	3.23
141	601126	四方股份	193,878.00	3.19
142	300750	宁德时代	193,010.00	3.18
143	601688	华泰证券	191,042.00	3.15
144	601016	节能风电	190,162.00	3.13
145	300752	隆利科技	189,684.84	3.12
146	01951	锦欣生殖	189,398.36	3.12
147	688088	虹软科技	187,875.83	3.09
148	300502	新易盛	186,500.00	3.07
149	000733	振华科技	185,386.00	3.05
150	603678	火炬电子	185,305.00	3.05
151	603859	能科科技	185,176.00	3.05
152	002409	雅克科技	183,636.00	3.02
153	300457	赢合科技	183,545.00	3.02
154	02018	瑞声科技	181,236.99	2.98
155	000959	首钢股份	180,153.00	2.97
156	002705	新宝股份	179,186.00	2.95

157	02020	安踏体育	178,764.52	2.94
158	300850	新强联	175,400.00	2.89
159	300763	锦浪科技	174,711.00	2.88
160	300799	左江科技	173,880.00	2.86
161	002636	金安国纪	170,645.00	2.81
162	002649	博彦科技	167,663.00	2.76
163	002425	凯撒文化	165,424.00	2.72
164	688560	明冠新材	162,755.05	2.68
165	002990	盛视科技	161,150.00	2.65
166	601899	紫金矿业	159,495.00	2.63
167	300124	汇川技术	158,684.00	2.61
168	300593	新雷能	154,980.00	2.55
169	000807	云铝股份	151,984.00	2.50
170	603444	吉比特	149,700.00	2.46
171	300860	锋尚文化	148,018.00	2.44
172	09990	祖龙娱乐	145,322.28	2.39
173	688303	大全能源	141,322.00	2.33
174	002967	广电计量	139,113.00	2.29
175	01024	快手-W	137,400.86	2.26
176	03898	时代电气	135,378.27	2.23
177	603396	金辰股份	126,313.00	2.08
178	603606	东方电缆	124,903.00	2.06
179	300095	华伍股份	124,108.00	2.04
180	600141	兴发集团	123,200.00	2.03

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	95,194,104.31
卖出股票收入（成交）总额	93,313,103.18

注：买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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。

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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，以风险对冲、套期保值为主要目的，将选择流动性好、交易活跃的期货合约，结合股指期货的估值定价模型，与需要作风险对冲的现货资产进行严格匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，实现基金资产增值保值。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除腾讯控股（股票代码：00700 HK）、韦尔股份（股票代码：603501 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 3 月 12 日，腾讯控股有限公司因价格垄断被市场监管总局罚款 50 万元【国市监处（2021）13 号】。

2021 年 3 月 19 日，腾讯控股有限公司因未依法履行职责被国家互联网信息办公室诫勉谈话，通知整改。

2021 年 4 月 30 日，腾讯控股有限公司在易车、途虎股权收购交易中因涉嫌违反法律法规，被国家市场监督管理总局分别各处以罚款 50 万元【国市监处（2021）30 号、国市监处（2021）31 号】。

2021 年 7 月 7 日，腾讯控股有限公司在小红书、猎豹移动、蘑菇街、搜狗股权收购交易中因涉嫌违反法律法规，被国家市场监督管理总局分别各处以罚款 50 万元【国市监处（2021）59 号、国市监处（2021）60 号、国市监处（2021）61 号、国市监处（2021）65 号】。

2021 年 7 月 8 日，腾讯控股有限公司因违规经营被工业和信息化部通知整改。

2021 年 7 月 24 日，腾讯控股有限公司因价格垄断被市场监管总局通知整改，罚款 50 万元【国市监处（2021）67 号】。

2021 年 11 月 20 日，腾讯控股有限公司因违规经营被国家市场监督管理总局罚款 450 万元【国市监处罚（2021）117 号、国市监处罚（2021）90 号、国市监处罚（2021）82 号、国市监处罚（2021）111 号、国市监处罚（2021）103 号、国市监处罚（2021）85 号、国市监处罚（2021）100 号、国市监处罚（2021）93 号、国市监处罚（2021）77 号】。

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,484.00
2	应收证券清算款	453,375.67
3	应收股利	-
4	应收利息	-233.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	465,626.13

注：应收利息为负由买入返售金融资产计提规则所致。

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

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
安信工业 4.0 混合 A	814	3,179.86	0.00	0.00	2,588,406.58	100.00
安信工业 4.0 混合 C	634	7,510.45	3,973,931.01	83.46	787,691.55	16.54
合计	1,390	5,287.79	3,973,931.01	54.07	3,376,098.13	45.93

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	安信工业 4.0 混合 A	79.98	0.00
	安信工业 4.0 混合 C	7.99	0.00
	合计	87.97	0.00

注：管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	份额级别	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	安信工业 4.0 混合 A	0
	安信工业 4.0 混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信工业 4.0 混合 A	0
	安信工业 4.0 混合 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信工业 4.0 混合 A	安信工业 4.0 混合 C
基金合同生效日（2017 年 7 月 20 日）基金份额总额	116,111,252.40	103,640,122.42
本报告期期初基金份额总额	3,777,479.87	1,064,523.76
本报告期基金总申购份额	1,829,170.27	7,665,772.65
减：本报告期基金总赎回份额	3,018,243.56	3,968,673.85
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,588,406.58	4,761,622.56

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金的基金托管人的基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 10,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	2	184,839,757.71	98.16%	133,195.93	97.86%	-
华创证券	2	3,636,209.78	1.84%	2,908.94	2.14%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	1,017,764.89	100.00%	8,000,000.00	100.00%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-22
2	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
3	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
4	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年春节期间旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
5	2021 年度 安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证券报	2021-02-19
6	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-19
7	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-23
8	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-29
9	安信基金管理有限责任公司关于 2021	中国证券报、证券日报、	2021-03-31

	年香港耶稣受难节、清明节、香港复活节期间旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	证券时报、上海证券报	
10	关于安信目标收益债券型证券投资基金等 35 只基金新增中国中金财富证券有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-06
11	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-21
12	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年劳动节期间旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-27
13	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年香港佛诞日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-05-17
14	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-05-20
15	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-06-26
16	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年香港特别行政区成立纪念日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-06-29
17	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华融证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-15
18	安信基金管理有限责任公司旗下 66 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-20
19	安信基金管理有限责任公司旗下 69 只基中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-08-27
20	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-03
21	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年中秋节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-15
22	安信基金管理有限责任公司关于新增	中国证券报、证券日报、	2021-09-22

	基金直销账户信息的公告	证券时报、上海证券报	
23	安信基金管理有限责任公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-22
24	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年国庆节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-27
25	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年香港重阳节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-10-12
26	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年 10 月 13 日旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-10-14
27	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-10-26
28	安信基金管理有限责任公司关于 2021 年香港圣诞节和 2022 年元旦节旗下部分基金非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-12-23

§ 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	20210105-20211231	-	3,973,931.01	-	3,973,931.01	54.07
产品特有风险							

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

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上

(含本数)发生巨额赎回,基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请,对剩余投资者的赎回办理造成影响;

(2)基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要,则可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作和收益水平;

(3)因基金净值精度计算问题,或因赎回费收入归基金资产,导致基金净值出现较大波动;

(4)基金资产规模过小,可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续的条件,基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
- 2、《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
- 3、《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
- 4、《安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话: 4008-088-088

网址: <http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日