

汇安宜创量化精选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：汇安基金管理有限责任公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2022 年 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。

基金托管人民生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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 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.....	10
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	19
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.....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	23
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.....	23
§5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	24
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.....	24
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.....	24
§6 审计报告	25
6.1 审计报告基本信息.....	25
6.2 审计报告的基本内容.....	25
§7 年度财务报表	28
7.1 资产负债表.....	28
7.2 利润表.....	29
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	30
7.4 报表附注.....	31
§8 投资组合报告	69
8.1 期末基金资产组合情况.....	69
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	69
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.....	70
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	79
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.....	79

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	80
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	80
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	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§ 9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
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的情况	82
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品 情况	83
§ 10 开放式基金份额变动	84
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
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	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
11.8 其他重大事件	86
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	89
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	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§ 13 备查文件目录	90
13.1 备查文件目录	90
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金	
基金简称	汇安宜创量化精选混合	
场内简称	-	
基金主代码	008251	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 24 日	
基金管理人	汇安基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	195,859,129.08 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	汇安宜创量化精选混合 A	汇安宜创量化精选混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	008251	008252
报告期末下属分级基金的份额总额	78,120,269.73 份	117,738,859.35 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。	
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略合理配置资产权重，将基金资产在股票和债券之间合理配置，并依靠严格的投资纪律和风险控制，紧跟当下国民经济发展过程中各行业的成长机会和资本市场发展机遇，严格控制下行风险，力争实现基金份额净值的长期平稳增长。本基金投资策略主要包括资产配置策略、量化选股策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货和国债期货投资策略、存托凭证投资策略等。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。	
风险收益特征	本基金为混合型基金，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	
	汇安宜创量化精选混合 A	汇安宜创量化精选混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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	汇安基金管理有限责任公司	中国民生银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	郭冬青	罗菲菲
	联系电话	01056711600	010-58560666
	电子邮箱	guodq@huianfund.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		01056711690	95568
传真		01056711640	010-57093382
注册地址		上海市虹口区欧阳路 218 弄 1 号 2 楼 215 室	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层； 上海市虹口区东大名路 501 号白玉兰大厦 36 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		100007	100031
法定代表人		刘强	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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.huianfund.cn
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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	汇安基金管理有限责任公司	上海市虹口区东大名路 501 号上海白玉兰广场 36 层 02 单元

§ 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 12 月 24 日(基金合同 生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	汇安宜创量 化精选混合 A	汇安宜创量 化精选混合 C	汇安宜创量 化精选混合 A	汇安宜创量 化精选混合 C	汇安宜创量 化精选混合 A	汇安宜创量 化精选混合 C
本期 已 实 现 收 益	30,082,571. 61	12,335,430. 42	33,706,633. 64	15,145,193 .56	-25,396.10	-21,665.88
本期 利 润	17,509,221. 71	1,748,760.1 1	54,465,598. 39	27,763,205 .69	371,099.79	175,074.56
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.1615	0.0298	0.3925	0.3998	0.0019	0.0019
本 期 加 权 平	9.84%	1.81%	32.22%	32.54%	0.19%	0.19%

均 净 值 利 润 率						
本 期 基 金 份 额 净 值 增 长 率	9.09%	8.54%	52.42%	51.65%	0.19%	0.19%
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	42,467,826. 82	62,018,342. 21	33,834,899. 01	12,377,632 .33	-25,396.10	-21,665.88
期 末 可 供 分 配 基 金 份 额 利	0.5436	0.5267	0.2698	0.2627	-0.0001	-0.0002

润						
期						
末						
基	130,140,103	194,171,229	191,536,723	71,581,348	190,773,462	94,657,663
金	.77	.41	.23	.44	.20	.76
资						
产						
净						
值						
期						
末						
基	1.6659	1.6492	1.5271	1.5194	1.0019	1.0019
金						
份						
额						
净						
值						
增						
长						
率						
3.1.	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
3						
累						
计						
期						
末						
指						
标						
基	66.59%	64.92%	52.71%	51.94%	0.19%	0.19%
金						
份						
额						
累						
计						
净						
值						
增						
长						
率						

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

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余额的孰低数。

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

汇安宜创量化精选混合 A

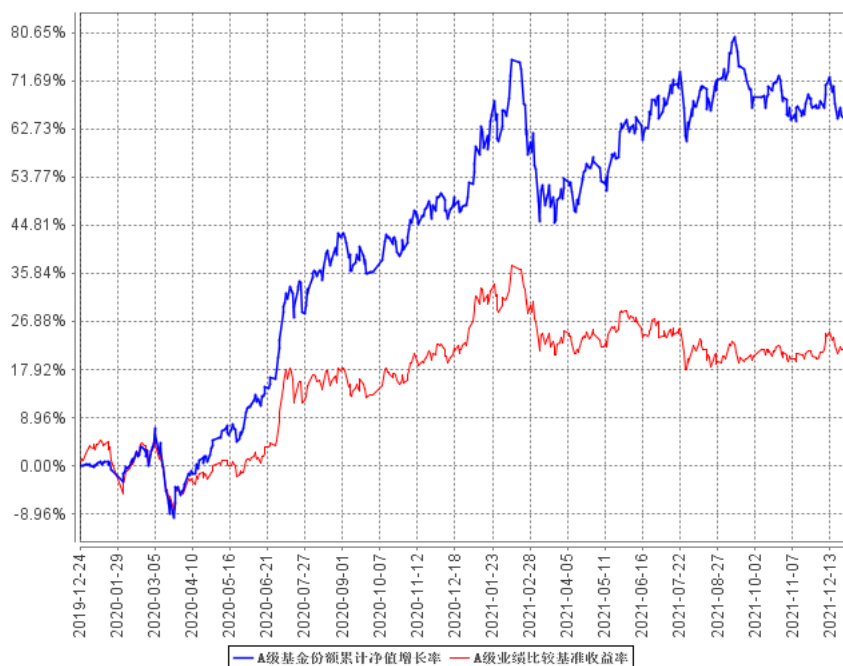
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.22%	0.81%	1.52%	0.63%	-2.74%	0.18%
过去六个月	-1.21%	1.00%	-3.65%	0.82%	2.44%	0.18%
过去一年	9.09%	1.22%	-2.86%	0.94%	11.95%	0.28%
自基金合同生效起至今	66.59%	1.21%	22.15%	1.04%	44.44%	0.17%

汇安宜创量化精选混合 C

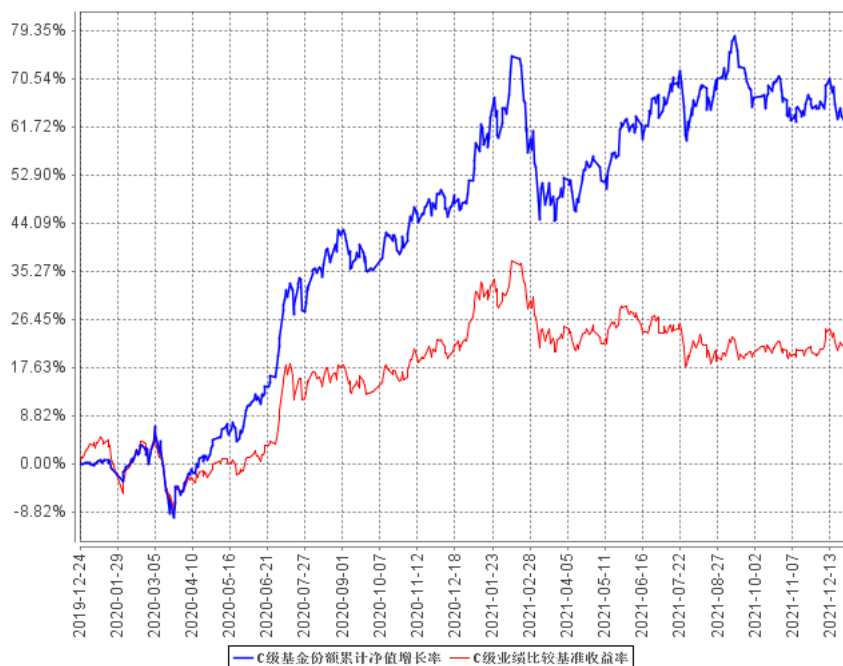
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.34%	0.81%	1.52%	0.63%	-2.86%	0.18%
过去六个月	-1.45%	1.00%	-3.65%	0.82%	2.20%	0.18%
过去一年	8.54%	1.22%	-2.86%	0.94%	11.40%	0.28%
自基金合同生效起至今	64.92%	1.21%	22.15%	1.04%	42.77%	0.17%

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

A级基金份额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



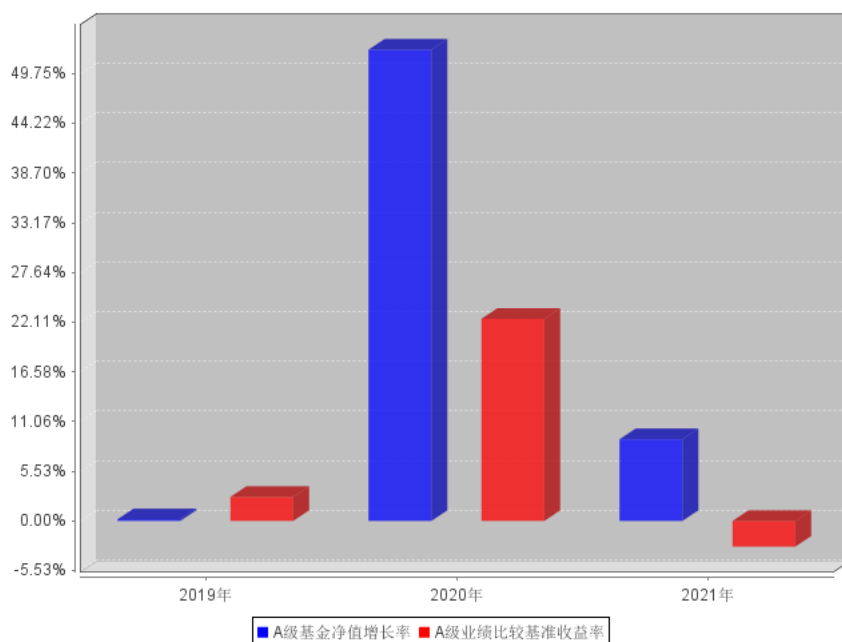
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



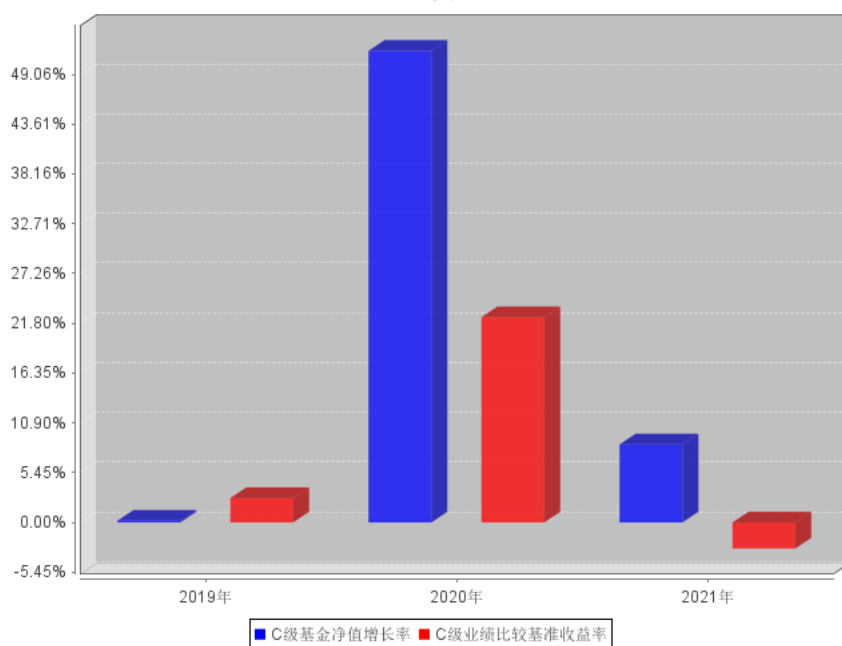
注：本报告期，本基金投资比例符合基金合同要求。

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

A级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对比图



C级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对比图



注：本基金合同生效日为 2019 年 12 月 24 日。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 其他指标

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年来未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，于 2016 年 4 月 19 日获中国证监会批复，2016 年 4 月 25 日正式成立，是业内首家全自然人、由内部核心专业人士控股的公募基金管理公司，注册资本 1 亿元人民币，注册地为上海市，设北京、上海双总部。公司目前具有公开募集证券投资基金管理、基金销售、特定客户资产管理的资格。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司旗下管理 54 只公募基金——汇安嘉汇纯债债券型证券投资基金、汇安嘉裕纯债债券型证券投资基金、汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰融灵活配置混合型证券投资基金、汇安嘉源纯债债券型证券投资基金、汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金、汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金、汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金、汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金、汇安资产轮动灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕华纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安稳裕债券型证券投资基金、汇安趋势动力股票型证券投资基金、汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金、汇安裕阳三年定期开放混合型证券投资基金、汇安短债债券型证券投资基金、汇安嘉鑫纯债债券型证券投资基金、富时中国 A50 交易型开放式指数证券投资基金、汇安核心成长混合型证券投资基金、汇安鼎利纯债债券型证券投资基金、汇安多因子混合型证券投资基金、汇安行业龙头混合型证券投资基金、汇安中短债债券型证券投资基金、汇安嘉诚债券型证券投资基金、汇安量化先锋混合型证券投资基金、汇安中债-广西壮族自治区公司信用类债券指数证券投资基金、汇安宜创量化精选混合型证券投资基金、汇安嘉盛纯债债券型证券投资基金、汇安信利债券型证券投资基金、汇安裕和纯债债券型证券投资基金、汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金、汇安嘉利混合型证券投资基金、汇安核心资产混合型证券投资基金、汇安裕鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安价值蓝筹混合型证券投资基金、汇安消费龙头混合型证券投资基金、汇安恒鑫 12 个月定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安中证 500 指数增强型证券投资基金、汇安泓阳三年持有期混合型证券投资基金、汇安恒利 39 个月定期开放纯债债券型证券投资基金、汇安盛鑫三年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、汇安嘉盈一年持有期债券型证券投资基金、汇安均衡优选混合型证券投资基金、汇安核心价值混合型证券投资基金、汇安鑫利优选混合型证券投资基金、汇安泓利一年持有期混合型证券投资基金、汇安鑫泽稳健一年持有期混合型证券投资基金、汇安裕兴 12 个月定期开放纯债债券型发起式

证券投资基金、汇安信泰稳健一年持有期混合型证券投资基金、汇安优势企业精选混合型证券投资基金。

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		
戴杰	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2019年12月24日	2021年9月3日	8年	戴杰，复旦大学数学本科、硕士，8年证券、基金行业从业经历，曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资部先后担任数量分析师和投资经理。2016年10月24日加入汇安基金管理有限公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2017年3月22日至2019年4月19日，任汇安丰恒灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年3月23日至2019年3月8日，任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月19日至2019年3月8日，任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017年7月27日至2018年8月9日，任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018年7月26日至2019年10月14日，任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019年4

					<p>月 11 日至 2020 年 4 月 13 日，任汇安丰益灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 10 月 30 日至 2021 年 2 月 2 日，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理；2019 年 12 月 24 日至 2021 年 9 月 3 日，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2017 年 1 月 17 日至今，任汇安丰泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2017 年 11 月 22 日至今，任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2018 年 2 月 13 日至今，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2019 年 4 月 30 日至今，任汇安多因子混合型证券投资基金基金经理；2020 年 8 月 11 日至今，任汇安消费龙头混合型证券投资基金基金经理；2021 年 4 月 2 日至今，任汇安鑫利优选混合型证券投资基金基金经理；2021 年 12 月 14 日至今，任汇安优势企业精选混合型证券投资基金基金经理。</p>
朱晨歌	指数与量化投资部高级经	2019年12月24日	2021年2月2日	7年	朱晨歌，复旦大学理论物理硕士，7年证券、基金行业从业经

	理、本基金的基金经理			<p>历, 曾任华安基金管理有限公司指数与量化投资事业部数量分析师、投资经理, 从事量化投资研究工作。2017 年 12 月 29 日加入汇安基金管理有限责任公司, 担任指数与量化投资部高级经理一职。2018 年 2 月 8 日至 2019 年 5 月 10 日, 任汇安丰利灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 2 月 8 日至 2020 年 7 月 27 日, 任汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 4 月 26 日至 2019 年 5 月 10 日, 任汇安丰华灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2019 年 12 月 24 日至 2021 年 2 月 2 日, 任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 8 月 9 日至今, 任汇安量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2018 年 8 月 22 日至今, 任汇安沪深 300 指数增强型证券投资基金; 2019 年 3 月 13 日至今, 任汇安丰裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理; 2019 年 6 月 14 日至今, 任富时中国 A50 交易型开放式指数证券投</p>
--	------------	--	--	--

					<p>资基金基金经理；2019 年 10 月 30 日至今，任汇安量化先锋混合型证券投资基金基金经理；2020 年 4 月 9 日至今，任汇安上证证券交易型开放式指数证券投资基金基金经理；2020 年 6 月 16 日至今，任汇安核心资产混合型证券投资基金基金经理；2020 年 11 月 16 日至今，任汇安中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理。</p>
柳预才	指数与量化投资部高级经理、本基金的基金经理	2020 年 12 月 30 日	-	8 年	<p>柳预才先生，上海财经大学数量金融学硕士研究生，8 年证券、基金行业从业经历。曾任上海东方证券资产管理有限公司量化投资部研究助理、研究员；安信基金管理有限责任公司量化投资部研究员；农银汇理基金管理有限公司研究部研究员。2020 年 11 月加入汇安基金管理有限责任公司，担任指数与量化投资部高级经理一职。2020 年 12 月 30 日至今，任汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理；2021 年 9 月 3 日至今，任汇安成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。</p>

注：1、“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、本基金无基金经理助理。

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

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司对投资人员的绩效考核工作实行统一领导、分级分体系分段考核的原则。具体包括部门和个人两个考核层面。年终考核时，根据期初设定的投资人员绩效考核指标，以及能力素质考核项、专项合规考核等综合评定给出考核结果，并根据考核结果分配年度绩效奖金。

1、针对所有投资人员的考核，以长期业绩为考核导向，均最短以 3 年为一个周期，同时兼顾最近 1 年、2 年的业绩。管理产品不满 3 年的投资人员，当年按照考核办法同样进行考核，但当年的考核结果仅做参考。

2、针对投资人员的评分，最终会按照考核方法，以 0-100 分为一个整体区间，最终对应公司考核评级如下，该绩效考核评级是投资人员是否调级调薪（固定薪酬）的依据。

对投资人员的绩效考核指标核心关注产品业绩，同时，合规专项考核出现扣分的人员，不予调级调薪（固定薪酬），为员工职级晋升的否决项。

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法》、《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善了公司公平交易制度，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

对于场内交易，公司启用了交易系统内的公平交易程序，在指令分发及指令执行阶段，均由系统强制执行公平委托；此外，公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。对于场外交易，公司完善银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配制度，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交

易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，完善相应制度及流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保公平交易原则的实现。基金管理人公平对待旗下管理的所有投资组合，报告期内公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗口下（如：1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易开展交易价差分析。分析结果表明，本报告期内公司对各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

-

4.3.3 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。本报告期内，本基金未发现可能的异常交易情况，不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

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

回顾 2021 年，A 股市场整体震荡上行，但内部差异巨大：高景气度，业绩爆发增长的新能源及相关的上下游产业链延续了前一年的凌厉涨势，但受疫情影响的大消费板块走势较弱。板块之间的结构化差异，在 2021 年的前 10 个月愈发极致：以申万一级行业指数为例，具有代表性的新能源板块中的电力设备（+56.5%）和消费板块中的家用电器（-24.6%），两者相差超过 80%。而进入年底，随着翌年疫情的边际影响降低，盈利改善预期的不断强化，消费板块回暖；而前期涨幅较大的新能源产业链，由于各个环节迅速扩产，投资者开始担忧未来的竞争格局愈发激烈进而影响盈利水平，叠加估值提升过快，开启阶段性的调整。两类代表性板块的股票回报在不同的阶段此消彼长，使得全年看似表面平静的市场，由于投资的侧重点不同，公募基金的投资回报呈现出剧烈的波动。

2021 年全年的投资主线相对而言较为清晰，自上而下的宏观经济分析和自下而上的量化选股策略，都较为一致地集中在新能源产业链，这也正是全年具有较高收益的板块。但展望 2022 年，

市场情况和宏观环境愈发复杂多样：一方面，从宏观层面分析，政策友好的稳增长、大基建、低估值板块有望迎来阶段性复苏，行业需求触底回升；但另一方面，自下而上从全市场上市公司的盈利变动趋势看，并没有哪一个行业处于盈利的集中爆发期，各个行业内部都存在较大分化。这种宏观和微观的不一致，在投资上对组合构建提出了更高的要求。

本基金采取的投资逻辑略偏成长，旨在精选估值与增速相匹配，资产质量好，投资性价比高的标的构建组合，但这样的长期投资逻辑，会阶段性地面临愈发激烈的波动和考验。近年来愈来愈剧烈的结构分化和股价波动，使我们产生了困惑：股价对长期基本面的趋势变动愈发免疫，而对短期的情绪波动和资金的博弈行为愈发敏感；上市公司的基本面出现短期的波动时（有时甚至是噪音），市场能将这种变化快速外推到长期维度，股价也在短期内充分反应（或提前透支）。诚然，市场的自身运行规律需要被尊重，但目前这样的市场状态和交易行为，是否具有长期可持续性？长此以往，影响股价长期运行的内在驱动力和投资逻辑到底是什么？面对日新月异的权益市场，我们需要厘清思路，到底是亦步亦趋跟随市场，还是在一定程度上坚守相对正确的投资策略，这需要在投资决策的内在一致性和投资回报之间做出取舍。目前我们适度增加了投资策略的灵活性，但中长期投资逻辑的本质——分享上市公司 EPS 的内生增长——并未发生根本改变。

本基金长期坚持锚定沪深 300 指数的增强策略，行业配置均衡，持股较为分散。有机结合定性与定量手段，在严格风控的前提下，力争挖掘出更为丰富的超额收益来源，为持有人创造长期稳健的超额收益。2021 年的四季度未能战胜沪深 300 指数，源于投资组合中持有的一部分高景气板块的标的（如新能源车，化工，CXO 等），基于事先难以预判的因素，盈利预测和市场偏好发生了较大程度的转变，短期内股价回撤幅度较大。结合逐渐披露的 2021 年度业绩和股价调整的幅度，从 PEG 的角度看，持仓中的一些优质标的已经具有相当的性价比，当前的回撤也是未来的潜在收益空间。针对目前的回撤，我们也在不断地反思和总结，希望能在投资策略层面更好地把握机会，为持有人贡献收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末汇安宜创量化精选混合 A 基金份额净值为 1.6659 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.09%，同期业绩比较基准收益率为-2.86%；截至本报告期末汇安宜创量化精选混合 C 基金份额净值为 1.6492 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.54%，同期业绩比较基准收益率为-2.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，结合宏观政策和中观的行业盈利趋势，中长线关注以下几个配置方向：首先，在我国的双碳“1+N”政策引导下，符合政策方向和清洁能源需求、供需两端均放量的绿电板块，正处于历史上行业发展的最好阶段。其次，“稳中求进”的顶层基调下，市场对较为积极的货币政策和流动性大环境形成了较强的预期，使得大基建板块成为经济增长的重要驱动。第三，重点关注能推动产业进步和科技发展的硬科技板块，如具有投资性价比，国产替代逻辑强的半导体行业；以及在中国制造业由大转强的关键阶段，众多细分制造领域中具有海内外竞争优势和先进技术的“隐形冠军”优质企业，值得进一步挖掘。第四，有望受益于消费政策提振、竞争格局改善的子板块。尤其是其中具备估值修复动能，叠加提价带来的量价双升拐点的食品饮料板块，以及渗透率快速提升的新兴消费品类。

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，本基金管理人依照法律法规和公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的完善，积极推动主动合规管理；全面加强风险控制，不断提高风险控制水平；有计划地开展监察稽核工作，推动公司内控体系和制度措施的落实，强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性管理。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展情况，坚持从保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的合规风控部不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，并通过实时监控、定期检查、专项检查等方式深入开展监察稽核工作，包括对基金投资运作、基金投资交易、基金销售与宣传、投资者适当性管理、客户服务、产品开发、信息披露、反洗钱工作、信息系统与信息安全、基金运营等方面进行监察稽核，及时发现上述业务开展中的相关问题，提出改进建议并跟踪改进落实情况。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金份额持有人的利益。

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《企业会计准则》、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，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要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司运营总监担任估值委员会主席，投资部门、合规风控部和运营部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和

监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未发生利润分配情况。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 25760 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	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了汇安宜创量化精选混合型证券投资基金(以下简称“汇安宜创量化精选混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>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”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了汇安宜创量化精选混合基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于汇安宜创量化精选混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	不适用
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>汇安宜创量化精选混合基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司(以下简称“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。</p>

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估汇安宜创量化精选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汇安宜创量化精选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督汇安宜创量化精选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。</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>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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,就可能导致对汇安宜创量化精选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</p>

	<p>导致汇安宜创量化精选混合基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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。</p>
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	沈兆杰 陶文欣
会计师事务所的地址	中国上海市
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇安宜创量化精选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	31,078,520.75	18,135,204.00
结算备付金		4,068,326.49	4,219.94
存出保证金		2,026,489.20	-
交易性金融资产	7.4.7.2	292,451,213.46	248,620,393.80
其中：股票投资		291,696,213.46	248,620,393.80
基金投资		-	-
债券投资		755,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	6,556.91	4,558.88
应收股利		-	-
应收申购款		66,283.14	716,473.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		329,697,389.95	267,480,850.00
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		-	-
应付赎回款		4,613,131.11	3,655,331.63
应付管理人报酬		425,364.50	411,472.79
应付托管费		70,894.12	68,578.79
应付销售服务费		82,438.22	40,428.31
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		14,228.82	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	180,000.00	186,966.81
负债合计		5,386,056.77	4,362,778.33
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	195,859,129.08	172,534,443.31
未分配利润	7.4.7.10	128,452,204.10	90,583,628.36
所有者权益合计		324,311,333.18	263,118,071.67
负债和所有者权益总计		329,697,389.95	267,480,850.00

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 195,859,129.08 份，其中汇安宜创量化精选混合 A 基金份额净值 1.6659 元，份额总额 78,120,269.73 份；汇安宜创量化精选混合 C 基金份额净值 1.6492 元，份额总额 117,738,859.35 份。

7.2 利润表

会计主体：汇安宜创量化精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		27,402,830.93	88,521,607.66
1.利息收入		106,058.73	231,079.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	106,020.61	164,067.18
债券利息收入		38.12	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	67,011.84
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		50,112,307.18	53,810,648.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	46,694,374.12	50,768,761.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	46,638.09	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	454,969.90	-
股利收益	7.4.7.16	2,916,325.07	3,041,887.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-23,160,020.21	33,376,976.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	344,485.23	1,102,903.02

列)			
减：二、费用		8,144,849.11	6,292,803.58
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,123,646.25	3,830,608.58
2. 托管费	7.4.10.2.2	687,274.39	638,434.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	480,451.01	428,742.16
4. 交易费用	7.4.7.19	2,666,977.13	1,201,662.25
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,665.40	-
7. 其他费用	7.4.7.20	184,834.93	193,355.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,257,981.82	82,228,804.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,257,981.82	82,228,804.08

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汇安宜创量化精选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）	172,534,443.31	90,583,628.36	263,118,071.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,257,981.82	19,257,981.82
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）	23,324,685.77	18,610,593.92	41,935,279.69
其中：1. 基金申购款	233,100,867.49	153,376,503.40	386,477,370.89
2. 基金赎回款	-209,776,181.72	-134,765,909.48	-344,542,091.20
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	195,859,129.08	128,452,204.10	324,311,333.18

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
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	284,884,951.61	546,174.35	285,431,125.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,228,804.08	82,228,804.08
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-112,350,508.30	7,808,649.93	-104,541,858.37
其中：1. 基金申购款	344,170,284.70	117,148,273.88	461,318,558.58
2. 基金赎回款	-456,520,793.00	-109,339,623.95	-565,860,416.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	172,534,443.31	90,583,628.36	263,118,071.67

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：

刘强

王嘉浩

江士

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

汇安宜创量化精选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”)证监许可[2019]2090号《关于准予汇安宜创量化精选混合型证券投资基金注册的批复》注册,由汇安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《汇安宜创量化精选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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币284,772,412.88元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0765号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金合同》于2019年12月24日正式

生效，基金合同生效日的基金份额总额为 284,884,951.61 份基金份额，其中认购资金利息折合 112,538.73 份基金份额。本基金的基金管理人为汇安基金管理有限责任公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金合同》和《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费/申购费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。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，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，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，并在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、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、资产支持证券、股指期货、国债期货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。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例为基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5%的现金或者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、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中证全债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人汇安基金管理有限责任公司于 2022 年 3 月 29 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《汇安宜创量化精选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 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值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

(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

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。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基金净值比例计算的金额。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

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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的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所有者权益转出。

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、可交换债券和私募债券除外)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、可交换债券和私募债券除外),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14号—收入》,本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用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

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,628,843.09	3,924,677.14
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	29,449,677.66	14,210,526.86
合计：	31,078,520.75	18,135,204.00

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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	281,508,420.46	291,696,213.46	10,187,793.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	755,000.00	-
	银行间市场	-	-
	合计	755,000.00	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	282,263,420.46	292,451,213.46	10,187,793.00
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	214,650,180.59	248,620,393.80	33,970,213.21
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	214,650,180.59	248,620,393.80	33,970,213.21
----	----------------	----------------	---------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	12,600,100.00	-	-	
股指期货	12,600,100.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	12,600,100.00	-	-	
项目	上年度末 2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	-	-	-	

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货情况：持有买入 IC2203 指数期货 6 合约，市值 8,766,960.00 元(2020 年 12 月 31 日:无)，公允价值变动 657,560.00 元(2020 年度:无)，持有买入 IF2203 指数期货 3 合约，市值 4,455,540.00 元(2020 年 12 月 31 日:无)，公允价值变动 -35,160.00 元(2020 年度:无)衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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

注：无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

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	100.45	2,854.19
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	2,865.62	1,704.37
应收结算备付金利息	3,574.38	0.32
应收债券利息	16.46	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	-
合计	6,556.91	4,558.88

7.4.7.6 其他资产

注：无。

7.4.7.7 应付交易费用

注：无。

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	-	966.81
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	186,000.00
合计	180,000.00	186,966.81

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

汇安宜创量化精选混合 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	125,421,736.04	125,421,736.04
本期申购	92,762,969.31	92,762,969.31
本期赎回（以“-”号填列）	-140,064,435.62	-140,064,435.62
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	78,120,269.73	78,120,269.73

金额单位：人民币元

汇安宜创量化精选混合 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	47,112,707.27	47,112,707.27
本期申购	140,337,898.18	140,337,898.18
本期赎回（以“-”号填列）	-69,711,746.10	-69,711,746.10
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	117,738,859.35	117,738,859.35

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

汇安宜创量化精选混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	33,834,899.01	32,280,088.18	66,114,987.19
本期利润	30,082,571.61	-12,573,349.90	17,509,221.71
本期基金份额交易产生的变动数	-21,449,643.80	-10,154,731.06	-31,604,374.86
其中：基金申购款	44,140,499.06	15,670,791.66	59,811,290.72
基金赎回款	-65,590,142.86	-25,825,522.72	-91,415,665.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,467,826.82	9,552,007.22	52,019,834.04

单位：人民币元

汇安宜创量化精选混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	12,377,632.33	12,091,008.84	24,468,641.17

本期利润	12,335,430.42	-10,586,670.31	1,748,760.11
本期基金份额交易产生的变动数	37,305,279.46	12,909,689.32	50,214,968.78
其中：基金申购款	69,041,287.35	24,523,925.33	93,565,212.68
基金赎回款	-31,736,007.89	-11,614,236.01	-43,350,243.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,018,342.21	14,414,027.85	76,432,370.06

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	11,917.66	48,813.18
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	89,043.03	111,033.74
结算备付金利息收入	5,059.92	4,220.26
其他	-	-
合计	106,020.61	164,067.18

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021 年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	943,689,465.18	374,948,703.09
减：卖出股票成本总额	896,995,091.06	324,179,941.46
买卖股票差价收入	46,694,374.12	50,768,761.63

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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
债券投资收益——买卖债券（、债	46,638.09	-

转股及债券到期兑付) 差价收入		
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	46,638.09	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	262,160.07	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	215,500.00	-
减：应收利息总额	21.98	-
买卖债券差价收入	46,638.09	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

7.4.7.15.2 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	上年度可比期间收益金额
	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
国债期货投资收益	-	-
股指期货-投资收益	454,969.90	-

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,916,325.07	3,041,887.11
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	2,916,325.07	3,041,887.11

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-23,782,420.21	33,376,976.88
——股票投资	-23,782,420.21	33,376,976.88
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	622,400.00	-
——权证投资	-	-
股指期货投资	622,400.00	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增	-	-

增值税		
合计	-23,160,020.21	33,376,976.88

7.4.7.18 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	344,485.23	1,102,903.02
合计	344,485.23	1,102,903.02

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 50% 归入基金资产。

7.4.7.19 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	2,666,977.13	1,201,662.25
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	2,666,977.13	1,201,662.25

7.4.7.20 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	60,000.00	66,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	4,834.93	6,955.90
证券账户开户费	-	400.00
合计	184,834.93	193,355.90

7.4.7.21 分部报告

-

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇安基金管理有限责任公司（“汇安基金”）	基金管理人、基金登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
何斌	基金管理人的股东
秦军	基金管理人的股东
郭小峰	基金管理人的股东
戴新华	基金管理人的股东
刘强	基金管理人的股东
郭兆强	基金管理人的股东
尹喜杰	基金管理人的股东
王福德	基金管理人的股东

注：

1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
2. 本基金管理人原股东戴新华已将其所持有的汇安基金全部股权转让给任建辉。截至 2022 年 1 月 7 日，本基金管理人已正式完成工商变更登记。

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

注：无。

7.4.10.1.2 债券交易

注：无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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	4,123,646.25	3,830,608.58
其中：支付销售机构的客户维护费	594,178.50	919,041.86

注：支付基金管理人汇安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 × 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 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	687,274.39	638,434.69

注：支付基金托管人中国民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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		
	汇安宜创量化精选混合 A	汇安宜创量化精选混合 C	合计
汇安基金	-	167,590.14	167,590.14
中国民生银行	-	30,283.87	30,283.87
合计	-	197,874.01	197,874.01
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		
	汇安宜创量化精选混合 A	汇安宜创量化精选混合 C	合计
汇安基金	-	126,043.19	126,043.19
中国民生银行	-	79,542.66	79,542.66
合计	-	205,585.85	205,585.85

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给汇安基金，再由汇安基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	1,628,843.09	11,917.66	3,924,677.14	48,813.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，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

注：无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：无。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2022年1月5日	新股流通受限	11.48	67.46	4,926	56,550.48	332,307.96	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年7月7日	新股上市	22.98	22.98	12,211	280,608.78	280,608.78	-
688778	厦钨新能	2021年7月29日	2022年2月	新股流通	24.50	100.74	2,697	66,076.50	271,695.78	-

		日	月	7	受限							
688711	宏微科技	2021年8月25日	2022年3月1日	31	新股流通受限	27.51	116.52	1,865	51,306.15	217,309.80	-	
688728	格科微	2021年8月11日	2022年2月18日	218	新股流通受限	14.38	29.31	6,564	94,390.32	192,390.84	-	
688190	云路股份	2021年11月18日	2022年5月26日	526	新股流通受限	46.63	92.51	1,836	85,612.68	169,848.36	-	
688257	新锐股份	2021年10月19日	2022年4月27日	427	新股流通受限	62.30	61.10	2,561	159,550.30	156,477.10	-	
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	39	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-	
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	328	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-	
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	524	新股流通受限	60.66	96.75	234	14,194.44	22,639.50	-	
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	510	新股流通受限	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-	
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	630	新股流通受限	12.03	17.12	1,155	13,894.65	19,773.60	-	
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	214	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-	
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月	6	新股流通	25.80	33.65	547	14,112.60	18,406.55	-	

		日	月 22	受限							
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-	
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	319	7,030.76	17,953.32	-	
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股流通受限	26.91	43.36	367	9,875.97	15,913.12	-	
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	209	19,455.81	15,746.06	-	
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	172	12,021.08	15,259.84	-	
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-	
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股流通受限	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-	
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	1,187	8,261.52	14,849.37	-	
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	1,297	13,553.65	14,552.34	-	
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月	新股流通	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-	

		日	月 17	受限							
301111	粤万 年青	2021年 11月30 日	2022 年 6 月 7 日	新股 流通 受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-	
301017	漱玉 平民	2021年 6月23 日	2022 年 1 月 5 日	新股 流通 受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-	
301020	密封 科技	2021年 6月28 日	2022 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-	
301138	华研 精机	2021年 12月8 日	2022 年 6 月 15 日	新股 流通 受限	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-	
301126	达嘉 维康	2021年 11月30 日	2022 年 6 月 7 日	新股 流通 受限	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-	
301166	优宁 维	2021年 12月21 日	2022 年 6 月 28 日	新股 流通 受限	86.06	94.50	131	11,273.86	12,379.50	-	
301185	鸥玛 软件	2021年 11月11 日	2022 年 5 月 19 日	新股 流通 受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	
301021	英诺 激光	2021年 6月28 日	2022 年 1 月 6 日	新股 流通 受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-	
301189	奥尼 电子	2021年 12月21 日	2022 年 6 月 28 日	新股 流通 受限	66.18	56.62	198	13,103.64	11,210.76	-	
301048	金鹰 重工	2021年 8月11 日	2022 年 2 月 28 日	新股 流通 受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
301100	风光 股份	2021年 12月10 日	2022 年 6 月 10 日	新股 流通 受限	27.81	31.14	348	9,677.88	10,836.72	-	

		日	月 17	受限							
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股流通受限	27.85	27.46	369	10,276.65	10,132.74	-	
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-	
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	303	8,871.84	9,696.00	-	
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-	
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-	
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-	
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股流通受限	58.08	49.85	180	10,454.40	8,973.00	-	
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股流通受限	33.16	24.67	352	11,672.32	8,683.84	-	
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	288	8,850.24	8,392.32	-	
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月	新股流通	43.99	50.77	164	7,214.36	8,326.28	-	

		日	月	8	受限							
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	6	新股流通受限	79.60	78.53	102	8,119.20	8,010.06	-	
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	3	新股流通受限	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-	
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	2	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-	
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	5	新股流通受限	36.31	35.52	218	7,915.58	7,743.36	-	
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	3	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-	
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	5	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-	
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	6	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	1	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-	
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	4	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-	
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	6	新股流通受限	57.27	53.71	126	7,216.02	6,767.46	-	
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月1日	1	新股流通	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-	

		日	月 26	受限						
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月	新股流通	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

		日	月 19	受限						
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股上市	41.98	41.98	2,844	119,391.12	119,391.12	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年1月11日	新股上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052.SH	兴业转债	2021年12月29日	2022年1月14日	新债未上市	100.00	100.00	7,130	713,000.00	713,000.00	-
113638.SH	台	2021年	2022	新债	100.00	100.00	420	42,000.00	42,000.00	-

	21 转债	12月 29日	年1 月21 日	未上 市						
--	----------	------------	----------------	---------	--	--	--	--	--	--

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

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

本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过管理及信息系统持续监控上述各类风险。

公司建立董事会领导下的风险管理体系，包括董事会的下设的风险控制委员会、总经理下设的风险管理委员会、督察长、合规风控部以及各个业务部门组成。

公司致力于实行全面、系统的风险管理，通过制定系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。公司奉行分工明确、相互协作、彼此牵制的风险管理组织结构，构建由四大防线共同筑成的风险管理体系：第一道防线由各个业务部门构成，各业务部门总监作为风险责任人；第二道监控防线由合规风控部构成，对公司运营过程中产生的或潜在的各项风险进行有效管理，并就内部控制及风险管理制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；第三道防线是由总经理及其下设的风险管理委员会构成，总经理负责公司日常经营管理中的风险管理工作。总经理下设风险管理委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控；第四道监控防线由董事会及其下设公司风险控制委员会构成。董事会负责公司整体风险的预防和控制，审核、监督公司风险管理制度的有效执行。董事会下设公司风险控制委员会，协助董事会确立公司风险取向，风险总量、风险限额，制定和调整公司风险管理战略、原则、政策和指导方针，并确保其得到有效执行。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国民生银行，其他存款存放在开立于本基金的结算机构第一创业证券股

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 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 0.23% (2020 年 12 月 31 日：本基金无债券投资)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

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每日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 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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(所有者权益)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 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：无。

7.4.13.3.2 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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上市公司发行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，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 1.30%。

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 2021 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、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	31,078,520.75	-	-	-	31,078,520.75
结算备付金	4,068,326.49	-	-	-	4,068,326.49
存出保证金	-	-	-	2,026,489.20	2,026,489.20
交易性金融资产	755,000.00	-	-	291,696,213.46	292,451,213.46
应收利息	-	-	-	6,556.91	6,556.91
应收申购款	-	-	-	66,283.14	66,283.14
资产总计	35,901,847.24	-	-	293,795,542.71	329,697,389.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,613,131.11	4,613,131.11
应付管理人报酬	-	-	-	425,364.50	425,364.50

应付托管费	-	-	-	70,894.12	70,894.12
应付销售服务费	-	-	-	82,438.22	82,438.22
应交税费	-	-	-	14,228.82	14,228.82
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	5,386,056.77	5,386,056.77
利率敏感度缺口	35,901,847.24	-	-	-288,409,485.94	324,311,333.18
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	18,135,204.00	-	-	-	18,135,204.00
结算备付金	4,219.94	-	-	-	4,219.94
交易性金融资产	-	-	-	-248,620,393.80	248,620,393.80
应收利息	-	-	-	4,558.88	4,558.88
应收申购款	-	-	-	716,473.38	716,473.38
资产总计	18,139,423.94	-	-	-249,341,426.06	267,480,850.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,655,331.63	3,655,331.63
应付管理人报酬	-	-	-	411,472.79	411,472.79
应付托管费	-	-	-	68,578.79	68,578.79
应付销售服务费	-	-	-	40,428.31	40,428.31
其他负债	-	-	-	186,966.81	186,966.81
负债总计	-	-	-	4,362,778.33	4,362,778.33
利率敏感度缺口	18,139,423.94	-	-	-244,978,647.73	263,118,071.67

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

注：于 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 0.23% (2020 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020 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，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资产投资比例为基金资产的 60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或者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；股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	291,696,213.46	89.94	248,620,393.80	94.49
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	755,000.00	0.23	-	-
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	292,451,213.46	90.17	248,620,393.80	94.49

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外其他变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	15,560,059.45	11,972,623.74
	沪深 300 指数下降 5%	-15,560,059.45	-11,972,623.74

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险**7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 287,469,954.53 元，属于第二层次的余额为 1,235,953.83 元，属于第三层次的余额为 3,745,305.10 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 244,216,369.59 元，第二层次 4,404,024.21 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 3,745,305.10 元(2020 年 12 月 31 日：无)。本期净增加 3,745,305.10 元。于 2021 年 12 月 31 日仍持有的第三层次金融工具计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动金额(公允价值变动损益)为 1,043,988.37 元(2020 年度：无)。

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融工具均为证券交易所上市但尚在限售期内的股票投资，公允价值为 3,745,305.10 元，根据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《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—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具

准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

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

§ 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	291,696,213.46	88.47
	其中：股票	291,696,213.46	88.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	755,000.00	0.23
	其中：债券	755,000.00	0.23
	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	35,146,847.24	10.66
8	其他各项资产	2,099,329.25	0.64
9	合计	329,697,389.95	100.00

8.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	538,936.00	0.17
B	采矿业	12,197,272.00	3.76
C	制造业	203,724,333.62	62.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,424,150.00	1.36
E	建筑业	1,177,599.80	0.36
F	批发和零售业	262,100.44	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	764,460.00	0.24
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,519,874.07	2.63
J	金融业	49,488,175.00	15.26
K	房地产业	4,349,140.00	1.34
L	租赁和商务服务业	1,841,142.00	0.57
M	科学研究和技术服务业	2,734,240.32	0.84

N	水利、环境和公共设施管理业	31,765.79	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,630,001.78	0.50
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	291,696,213.46	89.94

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：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	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	269,000	13,102,990.00	4.04
2	600519	贵州茅台	6,333	12,982,650.00	4.00
3	300750	宁德时代	17,200	10,113,600.00	3.12
4	300059	东方财富	269,500	10,001,145.00	3.08
5	600030	中信证券	266,800	7,046,188.00	2.17
6	601899	紫金矿业	673,600	6,533,920.00	2.01
7	600690	海尔智家	210,000	6,276,900.00	1.94
8	600176	中国巨石	324,000	5,896,800.00	1.82
9	002129	中环股份	137,000	5,719,750.00	1.76
10	600809	山西汾酒	18,000	5,684,040.00	1.75
11	601166	兴业银行	270,200	5,144,608.00	1.59
12	603260	合盛硅业	35,500	4,684,935.00	1.44
13	000725	京东方 A	876,000	4,423,800.00	1.36
14	600309	万华化学	39,000	3,939,000.00	1.21
15	601233	桐昆股份	184,300	3,903,474.00	1.20
16	600183	生益科技	162,900	3,836,295.00	1.18
17	601318	中国平安	76,000	3,831,160.00	1.18
18	000858	五粮液	17,172	3,823,517.52	1.18
19	601601	中国太保	132,500	3,593,400.00	1.11
20	605499	东鹏饮料	19,600	3,564,064.00	1.10
21	300122	智飞生物	28,500	3,551,100.00	1.09
22	002241	歌尔股份	63,500	3,435,350.00	1.06
23	601088	中国神华	142,600	3,211,352.00	0.99
24	002648	卫星化学	79,800	3,194,394.00	0.98

25	000733	振华科技	25,200	3,131,856.00	0.97
26	688200	华峰测控	6,100	3,122,590.00	0.96
27	600089	特变电工	141,000	2,984,970.00	0.92
28	300760	迈瑞医疗	7,700	2,932,160.00	0.90
29	601636	旗滨集团	171,300	2,929,230.00	0.90
30	002460	赣锋锂业	20,200	2,885,570.00	0.89
31	603486	科沃斯	19,100	2,883,145.00	0.89
32	601012	隆基股份	33,300	2,870,460.00	0.89
33	000100	TCL 科技	433,900	2,677,163.00	0.83
34	000333	美的集团	34,000	2,509,540.00	0.77
35	600900	长江电力	110,000	2,497,000.00	0.77
36	300672	国科微	13,100	2,430,050.00	0.75
37	002812	恩捷股份	9,600	2,403,840.00	0.74
38	000988	华工科技	81,000	2,256,660.00	0.70
39	300726	宏达电子	22,500	2,251,350.00	0.69
40	300450	先导智能	30,100	2,238,537.00	0.69
41	688303	大全能源	35,839	2,220,584.44	0.68
42	688536	思瑞浦	2,610	2,004,480.00	0.62
43	601225	陕西煤业	161,800	1,973,960.00	0.61
44	601995	中金公司	40,000	1,961,200.00	0.60
45	600660	福耀玻璃	39,000	1,838,460.00	0.57
46	688598	金博股份	5,100	1,810,704.00	0.56
47	300014	亿纬锂能	15,300	1,808,154.00	0.56
48	300896	爱美客	3,300	1,769,163.00	0.55
49	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.52
50	603259	药明康德	14,000	1,660,120.00	0.51
51	000001	平安银行	99,012	1,631,717.76	0.50
52	002304	洋河股份	9,700	1,597,881.00	0.49
53	600702	舍得酒业	7,000	1,591,100.00	0.49
54	601689	拓普集团	30,000	1,590,000.00	0.49
55	000657	中钨高新	98,000	1,575,840.00	0.49
56	600887	伊利股份	37,300	1,546,458.00	0.48
57	600905	三峡能源	205,000	1,539,550.00	0.47
58	000568	泸州老窖	6,000	1,523,220.00	0.47
59	002415	海康威视	28,900	1,512,048.00	0.47
60	600426	华鲁恒升	47,000	1,471,100.00	0.45
61	603392	万泰生物	6,600	1,461,900.00	0.45
62	000877	天山股份	94,200	1,442,202.00	0.44
63	603666	亿嘉和	19,000	1,427,280.00	0.44

64	300316	晶盛机电	19,600	1,362,200.00	0.42
65	000002	万科 A	68,000	1,343,680.00	0.41
66	601888	中国中免	6,000	1,316,460.00	0.41
67	600763	通策医疗	6,400	1,273,600.00	0.39
68	300633	开立医疗	39,800	1,270,814.00	0.39
69	002371	北方华创	3,600	1,249,272.00	0.39
70	600438	通威股份	27,300	1,227,408.00	0.38
71	601155	新城控股	42,000	1,223,460.00	0.38
72	300260	新莱应材	25,000	1,179,250.00	0.36
73	601800	中国交建	136,700	1,172,886.00	0.36
74	688357	建龙微纳	6,000	1,151,640.00	0.36
75	688301	奕瑞科技	2,300	1,142,870.00	0.35
76	002049	紫光国微	5,000	1,125,000.00	0.35
77	000887	中鼎股份	50,000	1,090,500.00	0.34
78	688066	航天宏图	14,500	1,054,150.00	0.33
79	002555	三七互娱	39,000	1,053,780.00	0.32
80	300390	天华超净	13,000	1,053,000.00	0.32
81	603055	台华新材	65,000	1,044,550.00	0.32
82	603986	兆易创新	5,900	1,037,515.00	0.32
83	600079	人福医药	46,000	1,035,920.00	0.32
84	002938	鹏鼎控股	24,000	1,018,320.00	0.31
85	688083	中望软件	2,886	1,009,609.38	0.31
86	001979	招商蛇口	75,000	1,000,500.00	0.31
87	601377	兴业证券	100,000	988,000.00	0.30
88	600779	水井坊	7,908	948,880.92	0.29
89	300887	谱尼测试	13,900	941,030.00	0.29
90	601688	华泰证券	52,774	937,266.24	0.29
91	600741	华域汽车	33,000	933,900.00	0.29
92	000012	南玻 A	92,000	913,560.00	0.28
93	000799	酒鬼酒	4,200	892,500.00	0.28
94	300124	汇川技术	13,000	891,800.00	0.27
95	000301	东方盛虹	46,000	889,640.00	0.27
96	002594	比亚迪	3,200	857,984.00	0.26
97	300685	艾德生物	11,200	845,712.00	0.26
98	688665	四方光电	4,700	842,334.00	0.26
99	600019	宝钢股份	110,500	791,180.00	0.24
100	300327	中颖电子	11,600	787,640.00	0.24
101	600048	保利发展	50,000	781,500.00	0.24
102	002466	天齐锂业	7,300	781,100.00	0.24

103	600018	上港集团	139,500	764,460.00	0.24
104	300661	圣邦股份	2,400	741,600.00	0.23
105	601658	邮储银行	144,600	737,460.00	0.23
106	002212	天融信	38,000	728,460.00	0.22
107	002202	金风科技	44,000	724,680.00	0.22
108	605111	新洁能	4,000	712,400.00	0.22
109	688686	奥普特	2,496	704,296.32	0.22
110	688099	晶晨股份	5,200	677,040.00	0.21
111	002402	和而泰	23,500	644,605.00	0.20
112	000338	潍柴动力	36,000	644,040.00	0.20
113	601633	长城汽车	13,000	631,020.00	0.19
114	688518	联赢激光	12,500	615,875.00	0.19
115	002472	双环传动	22,000	606,760.00	0.19
116	603799	华友钴业	5,500	606,705.00	0.19
117	000513	丽珠集团	15,000	603,150.00	0.19
118	000739	普洛药业	17,000	596,530.00	0.18
119	002568	百润股份	9,600	574,368.00	0.18
120	300274	阳光电源	3,800	554,040.00	0.17
121	000661	长春高新	2,000	542,800.00	0.17
122	688389	普门科技	23,500	540,500.00	0.17
123	002714	牧原股份	10,100	538,936.00	0.17
124	603659	璞泰来	3,300	530,013.00	0.16
125	600111	北方稀土	11,500	526,700.00	0.16
126	600057	厦门象屿	61,800	524,682.00	0.16
127	300915	海融科技	9,000	514,890.00	0.16
128	600919	江苏银行	88,000	513,040.00	0.16
129	600276	恒瑞医药	9,600	486,816.00	0.15
130	688002	睿创微纳	6,158	483,834.06	0.15
131	600378	昊华科技	10,000	482,000.00	0.15
132	601898	中煤能源	76,000	478,040.00	0.15
133	600884	杉杉股份	14,400	471,888.00	0.15
134	301071	力量钻石	1,600	458,720.00	0.14
135	000893	亚钾国际	17,000	453,050.00	0.14
136	600487	亨通光电	29,800	450,576.00	0.14
137	002214	大立科技	21,300	420,462.00	0.13
138	300286	安科瑞	12,000	398,160.00	0.12
139	002709	天赐材料	3,400	389,810.00	0.12
140	002407	多氟多	8,658	389,523.42	0.12
141	600011	华能国际	40,000	387,600.00	0.12

142	002985	北摩高科	3,200	385,472.00	0.12
143	688390	固德威	788	362,149.04	0.11
144	600862	中航高科	10,000	357,600.00	0.11
145	603678	火炬电子	4,700	355,555.00	0.11
146	600872	中炬高新	9,300	353,121.00	0.11
147	300015	爱尔眼科	8,000	338,240.00	0.10
148	300593	新雷能	6,200	337,156.00	0.10
149	688239	航宇科技	4,926	332,307.96	0.10
150	002841	视源股份	4,000	325,600.00	0.10
151	002850	科达利	2,000	320,680.00	0.10
152	300343	联创股份	18,000	306,360.00	0.09
153	603650	彤程新材	5,600	281,792.00	0.09
154	688176	亚虹医药	12,211	280,608.78	0.09
155	603501	韦尔股份	900	279,693.00	0.09
156	688667	菱电电控	1,600	275,440.00	0.08
157	688330	宏力达	2,400	272,784.00	0.08
158	688778	厦钨新能	2,697	271,695.78	0.08
159	300034	钢研高纳	4,500	259,200.00	0.08
160	603517	绝味食品	3,700	252,821.00	0.08
161	688122	西部超导	2,500	242,350.00	0.07
162	688776	国光电气	1,181	230,802.83	0.07
163	300037	新宙邦	2,000	226,000.00	0.07
164	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.07
165	603338	浙江鼎力	2,600	208,676.00	0.06
166	002556	辉隆股份	16,000	205,920.00	0.06
167	300408	三环集团	4,600	205,160.00	0.06
168	300223	北京君正	1,500	201,000.00	0.06
169	300395	菲利华	3,000	197,220.00	0.06
170	688728	格科微	6,564	192,390.84	0.06
171	603290	斯达半导	500	190,500.00	0.06
172	605377	华旺科技	10,000	179,400.00	0.06
173	688190	云路股份	1,836	169,848.36	0.05
174	688257	新锐股份	2,561	156,477.10	0.05
175	688521	芯原股份	2,000	154,720.00	0.05
176	002465	海格通信	12,000	131,040.00	0.04
177	000063	中兴通讯	3,800	127,300.00	0.04
178	688262	国芯科技	2,844	119,391.12	0.04
179	603806	福斯特	900	117,495.00	0.04
180	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02

181	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
182	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
183	301155	海力风电	234	22,639.50	0.01
184	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
185	301127	天源环保	1,155	19,773.60	0.01
186	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
187	301211	亨迪药业	547	18,406.55	0.01
188	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
189	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
190	301035	润丰股份	319	17,953.32	0.01
191	301101	明月镜片	367	15,913.12	0.00
192	301087	可孚医疗	209	15,746.06	0.00
193	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
194	301221	光庭信息	172	15,259.84	0.00
195	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
196	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
197	301039	中集车辆	1,187	14,849.37	0.00
198	301090	华润材料	1,297	14,552.34	0.00
199	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
200	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
201	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
202	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
203	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
204	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
205	301166	优宁维	131	12,379.50	0.00
206	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
207	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
208	301189	奥尼电子	198	11,210.76	0.00
209	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
210	301100	风光股份	348	10,836.72	0.00
211	301190	善水科技	369	10,132.74	0.00
212	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
213	301199	迈赫股份	303	9,696.00	0.00
214	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
215	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
216	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
217	301093	华兰股份	180	8,973.00	0.00
218	301088	戎美股份	352	8,683.84	0.00
219	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00

220	301193	家联科技	288	8,392.32	0.00
221	301179	泽宇智能	164	8,326.28	0.00
222	301096	百诚医药	102	8,010.06	0.00
223	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
224	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
225	301092	争光股份	218	7,743.36	0.00
226	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
227	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
228	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
229	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
230	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
231	301108	洁雅股份	126	6,767.46	0.00
232	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
233	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
234	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
235	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
236	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
237	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
238	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
239	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
240	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
241	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
242	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
243	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
244	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
245	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
246	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
247	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
248	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
249	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
250	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	12,216,392.00	4.64

2	000333	美的集团	11,390,703.48	4.33
3	603259	药明康德	10,424,987.00	3.96
4	601899	紫金矿业	10,403,396.00	3.95
5	300059	东方财富	10,203,893.00	3.88
6	002415	海康威视	9,682,793.00	3.68
7	603501	韦尔股份	9,611,352.64	3.65
8	300750	宁德时代	9,567,629.00	3.64
9	000725	京东方 A	9,232,342.00	3.51
10	600438	通威股份	8,753,332.74	3.33
11	601233	桐昆股份	8,378,373.00	3.18
12	603882	金域医学	8,148,734.20	3.10
13	600176	中国巨石	7,971,567.00	3.03
14	600809	山西汾酒	7,863,796.60	2.99
15	002594	比亚迪	7,654,748.00	2.91
16	300122	智飞生物	7,566,297.55	2.88
17	600309	万华化学	7,526,171.00	2.86
18	000858	五粮液	7,322,245.08	2.78
19	000568	泸州老窖	7,251,305.00	2.76
20	601166	兴业银行	7,147,415.00	2.72
21	300896	爱美客	7,097,178.00	2.70
22	601636	旗滨集团	7,034,970.00	2.67
23	600030	中信证券	6,646,120.00	2.53
24	600519	贵州茅台	6,589,160.00	2.50
25	603486	科沃斯	6,568,996.00	2.50
26	600031	三一重工	6,495,911.00	2.47
27	601225	陕西煤业	6,483,885.00	2.46
28	002049	紫光国微	6,480,543.68	2.46
29	002493	荣盛石化	6,422,040.00	2.44
30	600690	海尔智家	6,349,457.00	2.41
31	601211	国泰君安	6,330,798.98	2.41
32	600183	生益科技	6,320,714.00	2.40
33	600426	华鲁恒升	6,177,667.00	2.35
34	603799	华友钴业	6,133,864.00	2.33
35	300782	卓胜微	5,992,274.00	2.28
36	002129	中环股份	5,931,385.85	2.25
37	600104	上汽集团	5,731,227.00	2.18

38	000001	平安银行	5,723,389.76	2.18
39	000100	TCL 科技	5,695,573.00	2.16
40	601601	中国太保	5,561,153.00	2.11
41	600999	招商证券	5,465,838.00	2.08
42	603260	合盛硅业	5,365,091.65	2.04
43	002241	歌尔股份	5,294,455.82	2.01

注：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。

8.4.2 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	603259	药明康德	12,477,808.00	4.74
2	002415	海康威视	11,296,680.00	4.29
3	000001	平安银行	10,536,188.73	4.00
4	000333	美的集团	9,888,763.00	3.76
5	600887	伊利股份	9,652,360.00	3.67
6	600519	贵州茅台	9,318,199.00	3.54
7	600438	通威股份	8,986,619.60	3.42
8	002142	宁波银行	8,942,587.52	3.40
9	000002	万科 A	8,855,712.00	3.37
10	600048	保利发展	8,792,590.21	3.34
11	603501	韦尔股份	8,625,560.00	3.28
12	600031	三一重工	8,582,616.28	3.26
13	601318	中国平安	8,548,614.00	3.25
14	000858	五粮液	8,418,773.00	3.20
15	603882	金域医学	7,991,085.70	3.04
16	601166	兴业银行	7,502,692.00	2.85
17	600104	上汽集团	7,215,646.00	2.74
18	002594	比亚迪	6,981,196.00	2.65
19	600309	万华化学	6,838,422.80	2.60
20	600346	恒力石化	6,788,837.00	2.58
21	600905	三峡能源	6,711,210.07	2.55
22	601888	中国中免	6,423,767.00	2.44
23	300896	爱美客	6,413,000.00	2.44
24	000651	格力电器	6,317,224.12	2.40
25	601211	国泰君安	6,102,395.80	2.32

26	300124	汇川技术	6,009,524.00	2.28
27	000568	泸州老窖	5,985,156.00	2.27
28	002493	荣盛石化	5,953,044.00	2.26
29	300782	卓胜微	5,850,417.51	2.22
30	600171	上海贝岭	5,738,123.79	2.18
31	601225	陕西煤业	5,628,333.00	2.14
32	603799	华友钴业	5,425,805.00	2.06

注：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。

8.4.3 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	963,853,330.93
卖出股票收入（成交）总额	943,689,465.18

注：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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	755,000.00	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	755,000.00	0.23

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	7,130	713,000.00	0.22
2	113638	台 21 转债	420	42,000.00	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述 2 只债券。

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

注：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

注：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

注：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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2203	IC2203	6	8,766,960.00	657,560.00	-
IF2203	IF2203	3	4,455,540.00	-35,160.00	-
公允价值变动总额合计（元）					622,400.00
股指期货投资本期收益（元）					454,969.90
股指期货投资本期公允价值变动（元）					622,400.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于股指期货仅为占比低的辅助投资手段，并严格遵循基金合同和套保要求。投资股指期货时以套期保值为目的，在投资组合管理中谨慎持有少量流动性好、交易活跃的股指期货合约，以提升组合的投资效率和流动性，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受

到中国银行保险监督管理委员会（银保监罚决字〔2021〕16号）处罚。

基于对上述主体发行的相关证券的投资决策流程均符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本报告期内没有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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	2,026,489.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,556.91
5	应收申购款	66,283.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,099,329.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§ 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
汇安宜创量化精选混合 A	923	84,637.35	52,765,535.88	67.54%	25,354,733.85	32.46%
汇安宜创量化精选混合 C	780	150,947.26	99,674,319.42	84.66%	18,064,539.93	15.34%
合计	1,703	115,008.30	152,439,855.30	77.83%	43,419,273.78	22.17%

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	汇安宜创量化精选混合 A	0.00	0.0000%
	汇安宜创量化精选混合 C	305.42	0.0003%
	合计	305.42	0.0002%

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的情况

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	汇安宜创量化精选混合 A	0
	汇安宜创量化精选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	汇安宜创量化精选混合 A	0

	汇安宜创量化精选混 合 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：无

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇安宜创量化精选 混合 A	汇安宜创量化精选 混合 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 24 日）基金份额总额	190,402,362.41	94,482,589.20
本报告期期初基金份额总额	125,421,736.04	47,112,707.27
本报告期基金总申购份额	92,762,969.31	140,337,898.18
减:本报告期基金总赎回份额	140,064,435.62	69,711,746.10
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	78,120,269.73	117,738,859.35

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本基金管理人 2021 年 1 月 5 日发布公告，邹唯先生任公司副总经理；

本基金管理人 2021 年 11 月 17 日发布公告，冯家诚先生任公司首席信息官。

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

本基金在报告期内基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日（2019 年 12 月 24 日）起至今聘任普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用陆万元整。

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
一创证券	2	1,884,965,901.51	100.00%	1,508,925.41	100.00%	-

注：（1）基金管理人负责选择证券经纪商，使用其经纪服务席位作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准如下：

1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算的需要;

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平, 包括但不限于: 券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面。

(2) 基金交易单元的选择程序如下:

1) 本基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构;

2) 本基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议。

(3) 交易单元变更情况

本基金本报告期内无交易单元变更。

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
一创证券	262,160.07	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	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金招募说明书(更新)	规定报刊和/或公司网站	2021年1月4日
2	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金产品资料概要(更新)	规定报刊和/或公司网站	2021年1月4日
3	汇安基金管理有限责任公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊和/或公司网站	2021年1月5日
4	汇安基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金投资范围、增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	规定报刊和/或公司网站	2021年1月15日
5	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金托管协议(更新)	规定报刊和/或公司网站	2021年1月15日
6	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金合同(更新)	规定报刊和/或公司网站	2021年1月15日

7	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 1 月 20 日
8	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 1 月 20 日
9	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 1 月 22 日
10	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 2 月 4 日
11	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 2 月 5 日
12	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 2 月 5 日
13	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 3 月 31 日
14	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 4 月 22 日
15	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金（2021 年第 1 号）招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 5 月 18 日
16	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 5 月 18 日
17	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 7 月 21 日
18	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 8 月 31 日
19	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 9 月 4 日
20	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 9 月 7 日
21	汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	规定报刊和/或公司网站	2021 年 9 月 7 日
22	汇安宜创量化精选混合型证	规定报刊和/或公司	2021 年 10 月 27 日

	券投资基金 2021 年第 3 季度报告	网站	
23	汇安基金管理有限责任公司关于变更高级管理人员的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 11 月 17 日
24	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 11 月 30 日
25	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 12 月 6 日
26	关于汇安基金管理有限责任公司旗下基金增加销售机构的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 12 月 29 日
27	汇安基金管理有限责任公司关于江苏分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 12 月 29 日
28	汇安基金管理有限责任公司关于海南分公司成立的公告	规定报刊和/或公司网站	2021 年 12 月 31 日

§ 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	20211108-20211109	-	37,868,999.61	9,000,000.00	28,868,999.61	14.74%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金本报告期内存在单一基金份额持有人持有基金份额比例超过 20%的情况，投资人在投资本基金时，可能面临本基金因持有人集中度较高而产生的相应风险，具体包括：巨额赎回风险、流动性风险、基金资产净值持续低于 5000 万元的风险、基金份额净值大幅波动风险以及基金收益水平波动风险。本基金管理人将在基金运作中对以上风险进行严格的监控和管理，保护中小投资者利益。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

-

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准汇安宜创量化精选混合型证券投资基金募集的文件；
- (2) 《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《汇安宜创量化精选混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内基金管理人在规定报刊及规定网站上披露的各项公告；

13.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 13 层

上海市虹口区东大名路 501 白玉兰大厦 36 层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人汇安基金管理有限责任公司，客户服务中心电话 010-56711690。

公司网站：<http://www.huianfund.cn>

汇安基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 31 日