

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资 基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	51
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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	71
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.....	71
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.....	72
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.....	72
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.....	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	73
§ 9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	75
§ 10 开放式基金份额变动.....	75
§ 11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
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.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	78
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
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.....	79
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§ 13 备查文件目录.....	79
13.1 备查文件目录.....	79
13.2 存放地点.....	80
13.3 查阅方式.....	80

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	安信量化沪深 300 增强	
基金主代码	003957	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 5 月 7 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	165,634,977.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	003957	003958
报告期末下属分级基金的份额总额	82,107,054.49 份	83,527,922.68 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求有效跟踪标的指数，控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%的基础上，结合量化方法，力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型指数基金，在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数的基础上，通过数量化模型进行投资组合优化，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金将参考标的指数成分股在指数中的权重比例构建投资组合，并通过事先设置目标跟踪误差、事中监控、事后调整等手段，严格将跟踪误差控制在规定范围内，控制与标的指数主动偏离的风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*90%+商业银行活期存款利率（税后）*10%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇
	联系电话	0755-82509999
	电子邮箱	service@essencefund.com
客户服务电话	4008-088-088	95588
传真	0755-82799292	010-66105798

注册地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518026	100140
法定代表人	刘入领	陈四清

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 5 月 7 日(基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日	
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
本期已实现收益	13,176,805.63	46,001,650.21	5,987,295.43	37,847,093.08	252,461.89	10,214,376.17
本期利润	-7,267,803.52	-8,413,280.70	16,847,747.29	96,968,061.36	377,173.96	16,501,430.14
加权平均基金	-0.1035	-0.0541	0.8756	0.6629	0.2177	0.1891

份额 本期 利润						
本期 加权 平均 净值 利润 率	-5.54%	-2.90%	53.66%	44.38%	-0.62%	16.59%
本期 基金 份额 净值 增长 率	-2.33%	-2.53%	50.30%	50.01%	18.50%	18.33%
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	52,309,044. 65	51,291,619. 63	14,892,139 .92	71,084,735. 12	366,999.91	12,771,357. 75
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.6371	0.6141	0.4092	0.3927	0.1569	0.1459
期末 基金 资产 净值	150,804,118 .07	151,360,338 .10	68,435,512 .36	336,524,271 .19	2,925,715. 84	108,458,781 .70
期末 基金 份额 净值	1.8367	1.8121	1.8806	1.8592	1.2512	1.2394
3.1. 3 累 计期 末指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金 份额	73.95%	73.01%	78.10%	77.51%	18.50%	18.33%

累计 净值 增长 率						
---------------------	--	--	--	--	--	--

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

安信量化沪深 300 增强 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	-0.30%	0.75%	1.39%	0.71%	-1.69%	0.04%
过去六个月	-4.78%	1.01%	-4.83%	0.92%	0.05%	0.09%
过去一年	-2.33%	1.16%	-4.51%	1.05%	2.18%	0.11%
自基金转型起至今	73.95%	1.21%	30.92%	1.11%	43.03%	0.10%

安信量化沪深 300 增强 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	-0.35%	0.75%	1.39%	0.71%	-1.74%	0.04%

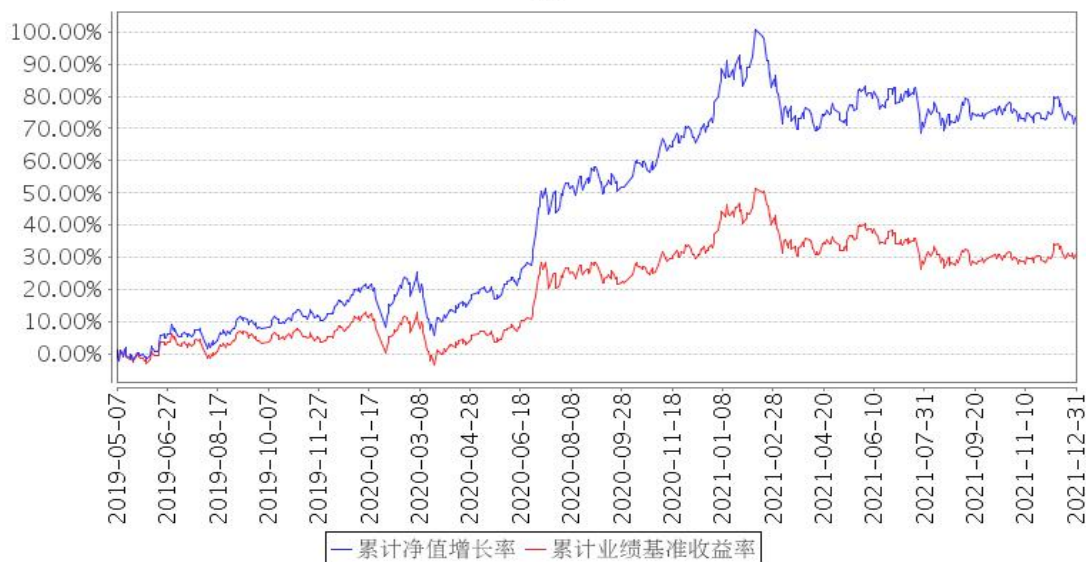
过去六个月	-4.88%	1.01%	-4.83%	0.92%	-0.05%	0.09%
过去一年	-2.53%	1.16%	-4.51%	1.05%	1.98%	0.11%
自基金转型起至今	73.01%	1.21%	30.92%	1.11%	42.09%	0.10%

注：根据《安信量化精选沪深 300 指数增强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*90%+商业银行活期存款利率（税后）*10%。由于本基金投资标的指数为沪深 300 指数，且每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%，因此，本基金的业绩比较基准以沪深 300 指数为主要组成部分。

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 90%、10%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

安信量化沪深300增强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



安信量化沪深300增强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

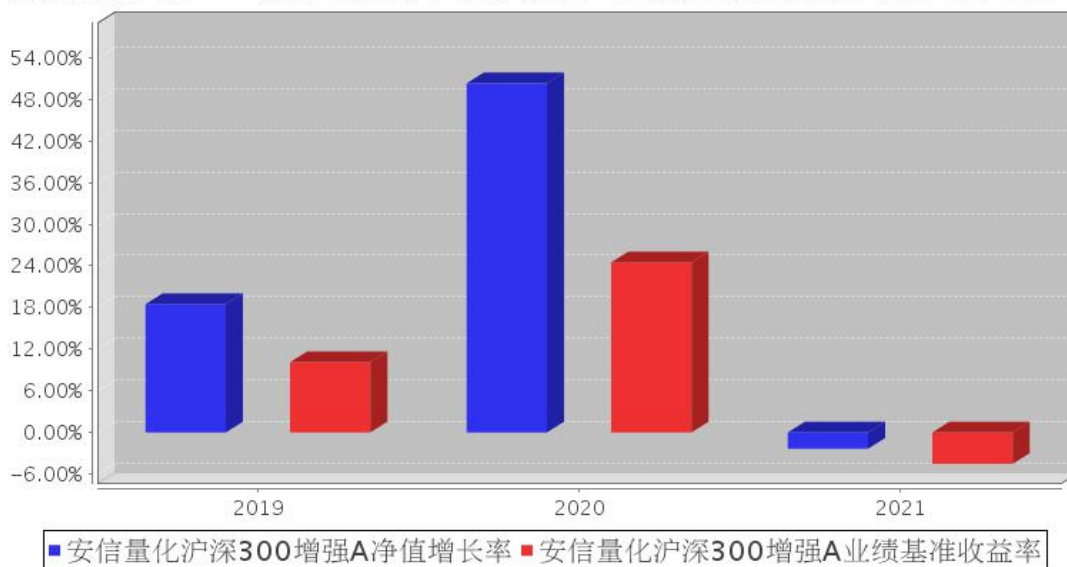


注：1、本基金2019年5月7日由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金转型而成，本基金基金合同生效日为2019年5月7日。

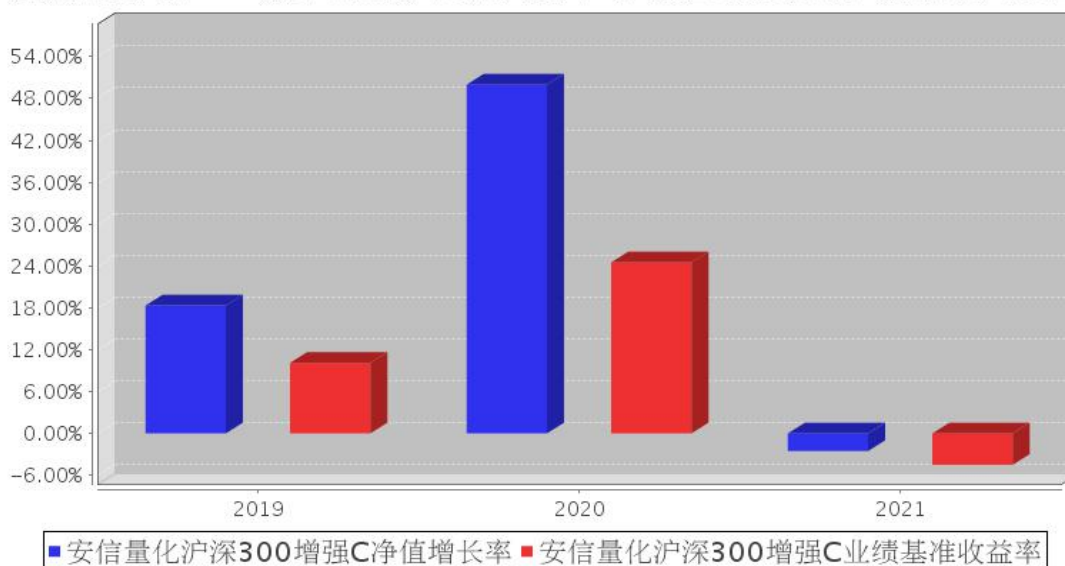
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

安信量化沪深300增强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



安信量化沪深300增强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

本基金于2019年5月7日转型，截至本报告期末尚未进行利润分配。

§ 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		
徐黄玮	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2019年5月7日	-	14年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 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）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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，在疫情持续反复下，国内经济增长呈现上半年持续复苏，下半年增长动力减弱的状况。结构上来看，消费持续低迷，制造业下半年出现冲高回落。市场流动性相对宽裕，全年来看，以新能源为首的成长类行业表现相对较佳，部分顺周期行业上半年表现亮眼。风格方面，整体看成长表现占优，这与相关行业业绩增速表现是一致的。大小盘来看，小盘股表现相对活跃，主要是大盘股过去几年估值已经打到了一定高度，小盘股凸显出了一定价值。

本基金在采用指数化被动投资以追求有效跟踪标的指数基础上，通过数量化模型进行投资组合优化。主要是运用量化多因子模型，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、分析师预期，技术特征、市场趋势、投资者情绪等多个因素构建我们认为相对基准有稳定超额收益的投资组合，精选优质、具有投资价值和合理估值的证券作为主要的投资标的，并积极把握指数分红、指数成分调整、新股，科创板新股，个股事件驱动等确定性增强机会，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信量化沪深 300 增强 A 基金份额净值为 1.8367 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.33%；安信量化沪深 300 增强 C 基金份额净值为 1.8121 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.53%；同期业绩比较基准收益率为-4.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年一季度，内外部环境将面临一定压力。国内疫情反复影响消费复苏，地产增速持续回落，对 GDP 增速形成了一定考验。所以，稳增长将是目前的主要政策方向。外部环境，目前海外生产有序复苏，国内出口相对减弱。市场方面，由于赛道股的预期已经给的比较充分，短期空间有限，面临调整。且成长在过去三年表现占优，价值股目前估值处于历史低位，在稳增长的预期下部分行业将有所表现，比如地产链相关公司，但后续还得看政策实施力度情况。整体上来看，我们认为市场今年将以震荡为主，短期大盘价值占优，中期来看将是成长主导，碳中和、科技、高端制造仍将是未来的产业升级方向，是重点关注领域。我们一直重视的公司的盈利、企业质量、估值、分析师预期，个股事件驱动等指数增强方式将会有较好的投资机会。

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，本基金本报告期末进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何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

本托管人依法对安信基金管理有限责任公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

	<p>我们认为，后附的安信量化精选沪深 300 指数增强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，公允反映了安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信量化精选沪深 300 指数增强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量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <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</p>

	<p>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，就可能导致对安信量化精选沪深 300 指数增强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量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	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 3 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	3,601,965.06	16,613,233.64
结算备付金		4,213,919.58	9,366,116.61
存出保证金		120,241.32	2,495,919.25
交易性金融资产	7.4.7.2	297,865,087.22	382,564,600.96
其中：股票投资		282,325,875.23	362,003,634.10
基金投资		-	-
债券投资		15,539,211.99	20,560,966.86
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	-	20,000,000.00
应收证券清算款		637,174.18	2,603,776.21

应收利息	7.4.7.5	270,455.48	414,412.74
应收股利		-	-
应收申购款		112,900.92	992,977.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		306,821,743.76	435,051,036.47
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		-	13,600,000.00
应付证券清算款		339,441.79	9,536,149.76
应付赎回款		2,220,439.14	6,133,060.66
应付管理人报酬		208,505.90	266,766.06
应付托管费		26,063.21	33,345.78
应付销售服务费		26,184.16	55,664.28
应付交易费用	7.4.7.7	1,557,295.64	128,729.43
应交税费		0.35	47,969.56
应付利息		-	14,606.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	279,357.40	274,961.33
负债合计		4,657,287.59	30,091,252.92
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	165,634,977.17	217,394,974.48
未分配利润	7.4.7.10	136,529,479.00	187,564,809.07
所有者权益合计		302,164,456.17	404,959,783.55
负债和所有者权益总计		306,821,743.76	435,051,036.47

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 165,634,977.17 份，其中安信量化沪深 300 增强 A 基金份额总额为 82,107,054.49 份，基金份额净值 1.8367 元；安信量化沪深 300 增强 C 基金份额总额为 83,527,922.68 份，基金份额净值 1.8121 元。

7.2 利润表

会计主体：安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金

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		-1,318,802.79	118,012,886.65

1. 利息收入		967,961.10	602,959.07
其中：存款利息收入	7.4.7.11	145,280.76	107,593.56
债券利息收入		569,884.74	307,070.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		252,795.60	188,294.77
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		71,956,717.99	47,139,272.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	68,281,263.21	38,033,669.87
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	187,238.72	-33,714.56
资产支持证券投资	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	-1,066,050.48	5,140,854.38
股利收益	7.4.7.17	4,554,266.54	3,998,463.23
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-74,859,540.06	69,981,420.14
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	616,058.18	289,234.52
减：二、费用		14,362,281.43	4,197,078.00
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,384,225.96	1,965,619.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	423,028.15	245,702.49
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	585,081.89	430,394.76
4. 交易费用	7.4.7.20	9,478,842.23	1,051,978.96
5. 利息支出		61,582.57	72,878.42
其中：卖出回购金融资产支出		61,582.57	72,878.42
6. 税金及附加		12,436.00	18,507.29
7. 其他费用	7.4.7.21	417,084.63	411,996.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-15,681,084.22	113,815,808.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-15,681,084.22	113,815,808.65

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金

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)	217,394,974.48	187,564,809.07	404,959,783.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-15,681,084.22	-15,681,084.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-51,759,997.31	-35,354,245.85	-87,114,243.16
其中：1. 基金申购款	292,362,858.57	264,428,640.80	556,791,499.37
2. 基金赎回款	-344,122,855.88	-299,782,886.65	-643,905,742.53
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)	165,634,977.17	136,529,479.00	302,164,456.17
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)	89,843,945.32	21,540,552.22	111,384,497.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	113,815,808.65	113,815,808.65
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)	127,551,029.16	52,208,448.20	179,759,477.36
其中：1. 基金申购款	378,870,701.78	172,144,651.02	551,015,352.80
2. 基金赎回款	-251,319,672.62	-119,936,202.82	-371,255,875.44
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)	217,394,974.48	187,564,809.07	404,959,783.55

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

安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金由安信新起点灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“安信新起点混合”）于 2019 年 5 月 7 日转型而来。基金转型事项获中国证券监督管理委员会于 2019 年 3 月 13 日下发的证监许可[2019]375 号文“关于准予安信新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复”的核准，并经安信新起点基金份额持有人大会决议通过。自 2019 年 5 月 7 日起，由《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》修订而成的《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》生效，原《安信新起点灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同日失效，原安信新起点混合基金更名为安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），为契约型开放式基金，存续期限不定。

原安信新起点混合于基金合同失效前的基金资产净值为 64,272,976.13 元，基金份额为 64,272,976.13 份，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值、基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》及《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费用、赎回费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、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；在投资人申购时不收取申购费用、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《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成分股及备选成分股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成分股（包括中小板、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、中期票据、短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券等）、资产支持证券、银行存款、同业存单、债券回购、权证、国债期货、股指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资产（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*90%+商业银行活期存款利率（税后）*10%。

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。

衍生工具收益是指持有的股指期货合约平仓和到期交割实现的收益。

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或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

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

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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 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

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

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

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

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时

代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	3,601,965.06	16,613,233.64
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	3,601,965.06	16,613,233.64

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	277,809,281.94	282,325,875.23	4,516,593.29	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	15,540,503.21	15,539,211.99	-1,291.22
	银行间市场	-	-	-
	合计	15,540,503.21	15,539,211.99	-1,291.22
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	293,349,785.15	297,865,087.22	4,515,302.07	
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	283,523,831.97	362,003,634.10	78,479,802.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	20,583,366.86	20,560,966.86	-22,400.00
	银行间市场	-	-	-

	合计	20,583,366.86	20,560,966.86	-22,400.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	304,107,198.83	382,564,600.96	78,457,402.13

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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
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	20,316,900.00	-	-	-
其中：股指期货投资	20,316,900.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	20,316,900.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的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。本报告期末本基金无衍生金融资产/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	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
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	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	731.53	1,900.65
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	2,114.69	5,177.43
应收债券利息	267,549.75	409,322.64
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-2,016.58
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	59.51	28.60
合计	270,455.48	414,412.74

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	1,557,295.64	128,729.43
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,557,295.64	128,729.43

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	57.40	5,661.33

应付证券出借违约金	-	-
应付银行间账户维护费	9,300.00	9,300.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	100,000.00	100,000.00
应付审计费	50,000.00	40,000.00
合计	279,357.40	274,961.33

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信量化沪深 300 增强 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	36,391,131.55	36,391,131.55
本期申购	81,963,995.82	81,963,995.82
本期赎回（以“-”号填列）	-36,248,072.88	-36,248,072.88
本期末	82,107,054.49	82,107,054.49

安信量化沪深 300 增强 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	181,003,842.93	181,003,842.93
本期申购	210,398,862.75	210,398,862.75
本期赎回（以“-”号填列）	-307,874,783.00	-307,874,783.00
本期末	83,527,922.68	83,527,922.68

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

安信量化沪深 300 增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,892,139.92	17,152,240.89	32,044,380.81
本期利润	13,176,805.63	-20,444,609.15	-7,267,803.52
本期基金份额交易产生的变动数	24,240,099.10	19,680,387.19	43,920,486.29
其中：基金申购款	45,549,342.96	30,896,767.86	76,446,110.82
基金赎回款	-21,309,243.86	-11,216,380.67	-32,525,624.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,309,044.65	16,388,018.93	68,697,063.58

安信量化沪深 300 增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	71,084,735.12	84,435,693.14	155,520,428.26
本期利润	46,001,650.21	-54,414,930.91	-8,413,280.70
本期基金份额交易产生的变动数	-65,794,765.70	-13,479,966.44	-79,274,732.14
其中：基金申购款	106,263,596.37	81,718,933.61	187,982,529.98
基金赎回款	-172,058,362.07	-95,198,900.05	-267,257,262.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	51,291,619.63	16,540,795.79	67,832,415.42

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	49,717.47	50,742.43
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	93,320.48	56,090.13
其他	2,242.81	761.00
合计	145,280.76	107,593.56

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	3,604,705,148.80	331,264,723.38
减：卖出股票成本总额	3,536,423,885.59	293,231,053.51
买卖股票差价收入	68,281,263.21	38,033,669.87

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	57,328,350.58	11,992,046.95
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	55,968,275.06	11,656,488.94
减：应收利息总额	1,172,836.80	369,272.57
买卖债券差价收入	187,238.72	-33,714.56

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	-1,066,050.48	5,140,854.38

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	4,554,266.54	3,998,463.23
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	4,554,266.54	3,998,463.23

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	-73,942,100.06	69,312,860.14
股票投资	-73,963,208.84	69,335,282.14
债券投资	21,108.78	-22,422.00
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-917,440.00	668,560.00
权证投资	-	-
期货	-917,440.00	668,560.00
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	-74,859,540.06	69,981,420.14

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	475,272.44	288,815.97
基金转换费收入	624.68	347.79
其他	140,161.06	70.76
合计	616,058.18	289,234.52

注：本报告期其他包含相关赔偿收入。

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	9,478,842.23	1,051,978.96
银行间市场交易费用	-	-
合计	9,478,842.23	1,051,978.96

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	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	9,884.63	5,496.92
银行间账户维护费	37,200.00	46,500.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	417,084.63	411,996.92

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	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

本基金本报告期及上年度可比期间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	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
当期发生的基金应支付的管理费	3,384,225.96	1,965,619.16
其中：支付销售机构的客户维护费	550,991.27	405,546.87

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	423,028.15	245,702.49

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

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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		
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C	合计
安信基金	-	309,434.08	309,434.08
安信证券	-	408.05	408.05
合计	-	309,842.13	309,842.13
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		
	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C	合计
安信基金	-	228,788.04	228,788.04
安信证券	-	145.39	145.39
合计	-	228,933.43	228,933.43

注：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 0.20%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.20% 年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年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
工商银行	3,601,965.06	49,717.47	16,613,233.64	50,742.43

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年02月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年01月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-

301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年01月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	507	11,174.28	28,533.96	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年02月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,054	14,295.84	25,695.54	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-

301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年02月28日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	60.64	234.74	203	12,309.92	47,652.22	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年02月28日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-

301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股锁定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年10月13日	2022年4月21日	新股锁定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定	93.09	75.34	189	17,594.01	14,239.26	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股锁定	33.16	24.67	317	10,511.72	7,820.39	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定	10.45	11.22	1,141	11,923.45	12,802.02	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定	36.50	31.31	354	12,921.00	11,083.74	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	36.31	35.52	218	7,915.58	7,743.36	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	49.85	201	11,674.08	10,019.85	-
301096	百诚	2021	2022	新股锁	79.60	78.53	95	7,562.00	7,460.35	-

	医药	年 12 月 13 日	年 6 月 20 日	定							
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-	
301099	雅创电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	新股锁定	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-	
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股锁定	27.81	31.14	318	8,843.58	9,902.52	-	
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股锁定	26.91	43.36	334	8,987.94	14,482.24	-	
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股锁定	57.27	53.71	124	7,101.48	6,660.04	-	
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新股锁定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-	
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-	
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新股锁定	12.03	17.12	1,011	12,162.33	17,308.32	-	
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-	
301149	隆华新材	2021 年 11 月 3 日	2022 年 5 月 10 日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-	
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股锁定	86.06	94.50	135	11,618.10	12,757.50	-	
301179	泽宇智能	2021 年 12	2022 年 6 月	新股锁定	43.99	50.77	182	8,006.18	9,240.14	-	

		月 1 日	8 日							
301180	万祥科技	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 16 日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股锁定	27.85	27.46	338	9,413.30	9,281.48	-
301193	家联科技	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 9 日	新股锁定	30.73	29.14	264	8,112.72	7,692.96	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301211	亨迪药业	2021 年 12 月 14 日	2022 年 6 月 22 日	新股锁定	25.80	33.65	518	13,364.40	17,430.70	-
301221	光庭信息	2021 年 12 月 15 日	2022 年 6 月 22 日	新股锁定	69.89	88.72	152	10,623.28	13,485.44	-
601728	中国电信	2021 年 8 月 11 日	2022 年 2 月 21 日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688151	华强科技	2021 年 11 月 29 日	2022 年 6 月 6 日	新股锁定	35.09	33.82	3,867	135,693.03	130,781.94	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	6.42	15.76	2,693	17,289.06	42,441.68	-
688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未上市	41.98	41.98	2,763	115,990.74	115,990.74	-

688768	容知日新	2021年7月16日	2022年1月26日	新股锁定	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688789	宏华数科	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月28日	2022年01月14日	配债未上市	100.00	100.00	80	7,999.93	7,999.93	-
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年01月14日	新债未上市	100.00	100.00	2,960	295,996.11	295,996.11	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券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之内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.11%。（2020 年 12 月 31 日：0.06%）

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	15,202,085.00	18,296,370.00
合计	15,202,085.00	18,296,370.00

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	336,144.94	219,997.11
AAA 以下	982.05	27,999.75
未评级	-	2,016,600.00
合计	337,126.99	2,264,596.86

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流

动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同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	3,601,965.06	-	-	-	3,601,965.06
结算备付金	4,213,919.58	-	-	-	4,213,919.58
存出保证金	120,241.32	-	-	-	120,241.32
交易性金融资产	15,202,085.00	-	337,126.99	282,325,875.23	297,865,087.22
应收利息	-	-	-	270,455.48	270,455.48
应收申购款	-	-	-	112,900.92	112,900.92
应收证券清算款	-	-	-	637,174.18	637,174.18
资产总计	23,138,210.96	-	337,126.99	283,346,405.81	306,821,743.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,220,439.14	2,220,439.14
应付管理人报酬	-	-	-	208,505.90	208,505.90
应付托管费	-	-	-	26,063.21	26,063.21
应付证券清算款	-	-	-	339,441.79	339,441.79
应付销售服务费	-	-	-	26,184.16	26,184.16
应付交易费用	-	-	-	1,557,295.64	1,557,295.64
应交税费	-	-	-	0.35	0.35

其他负债	-	-	-	279,357.40	279,357.40
负债总计	-	-	-	4,657,287.59	4,657,287.59
利率敏感度缺口	23,138,210.96	-	337,126.99	278,689,118.22	302,164,456.17
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	16,613,233.64	-	-	-	16,613,233.64
结算备付金	9,366,116.61	-	-	-	9,366,116.61
存出保证金	2,495,919.25	-	-	-	2,495,919.25
交易性金融资产	20,312,970.00	-	247,996.86	362,003,634.10	382,564,600.96
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收利息	-	-	-	414,412.74	414,412.74
应收申购款	-	-	-	992,977.06	992,977.06
应收证券清算款	-	-	-	2,603,776.21	2,603,776.21
资产总计	68,788,239.50	-	247,996.86	366,014,800.11	435,051,036.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,133,060.66	6,133,060.66
应付管理人报酬	-	-	-	266,766.06	266,766.06
应付托管费	-	-	-	33,345.78	33,345.78
应付证券清算款	-	-	-	9,536,149.76	9,536,149.76
卖出回购金融资产款	13,600,000.00	-	-	-	13,600,000.00
应付销售服务费	-	-	-	55,664.28	55,664.28
应付交易费用	-	-	-	128,729.43	128,729.43
应付利息	-	-	-	14,606.06	14,606.06
应交税费	-	-	-	47,969.56	47,969.56
其他负债	-	-	-	274,961.33	274,961.33
负债总计	13,600,000.00	-	-	16,491,252.92	30,091,252.92
利率敏感度缺口	55,188,239.50	-	247,996.86	349,523,547.19	404,959,783.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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. 市场利率下降 25 个基点	14,912.76	10,306.92
2. 市场利率上升	-14,814.13	-10,230.68	

	25 个基点		
--	--------	--	--

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所市场和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货和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。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	282,325,875.23	93.43	362,003,634.10	89.39
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	282,325,875.23	93.43	362,003,634.10	89.39

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%	14,880,354.14	19,452,638.32
2. 沪深 300 指数下降 5%	-14,880,354.14	-19,452,638.32	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 279,102,757.28 元，划分为第二层次的余额为人民币 18,762,329.94 元，无划分为第三层次余额（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 358,252,079.09 元，划分为第二层次的余额为人民币 24,312,521.87 元，无划分为第三层次余额）。

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) 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	282,325,875.23	92.02
	其中: 股票	282,325,875.23	92.02
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,539,211.99	5.06
	其中: 债券	15,539,211.99	5.06
	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	7,815,884.64	2.55
8	其他各项资产	1,140,771.90	0.37
9	合计	306,821,743.76	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,661,588.00	0.55
B	采矿业	4,530,037.20	1.50
C	制造业	162,778,804.34	53.87
D	电力、热力、燃气	4,706,166.00	1.56

	及水生产和供应业		
E	建筑业	4,058,742.00	1.34
F	批发和零售业	2,305,497.40	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	7,169,934.00	2.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,313,855.27	2.75
J	金融业	41,520,518.01	13.74
K	房地产业	5,654,289.00	1.87
L	租赁和商务服务业	2,838,964.00	0.94
M	科学研究和技术服务业	5,920,151.80	1.96
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	1,642,530.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	617,976.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	253,719,053.02	83.97

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	524,489.00	0.17
B	采矿业	321,851.00	0.11
C	制造业	21,454,316.75	7.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	79,573.00	0.03
E	建筑业	1,040,256.22	0.34
F	批发和零售业	753,011.35	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,116,452.78	0.37
H	住宿和餐饮业	17,580.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	580,455.80	0.19
J	金融业	1,587,046.00	0.53
K	房地产业	294,069.00	0.10
L	租赁和商务服务业	289,175.00	0.10
M	科学研究和技术服	322,120.91	0.11

	务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	38,660.03	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	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	169,603.59	0.06
S	综合	-	-
	合计	28,606,822.21	9.47

8.2.3 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

8.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	6,325	12,966,250.00	4.29
2	300750	宁德时代	14,900	8,761,200.00	2.90
3	000858	五粮液	26,900	5,989,554.00	1.98
4	600036	招商银行	106,200	5,173,002.00	1.71
5	601318	中国平安	101,300	5,106,533.00	1.69
6	601012	隆基股份	56,576	4,876,851.20	1.61
7	600690	海尔智家	126,200	3,772,118.00	1.25
8	300059	东方财富	99,279	3,684,243.69	1.22
9	600887	伊利股份	87,699	3,636,000.54	1.20
10	000333	美的集团	44,850	3,310,378.50	1.10
11	002142	宁波银行	83,170	3,183,747.60	1.05
12	600030	中信证券	117,900	3,113,739.00	1.03
13	002493	荣盛石化	170,000	3,087,200.00	1.02
14	002415	海康威视	56,800	2,971,776.00	0.98
15	002594	比亚迪	10,900	2,922,508.00	0.97
16	002129	中环股份	66,600	2,780,550.00	0.92
17	002371	北方华创	7,800	2,706,756.00	0.90
18	601888	中国中免	12,200	2,676,802.00	0.89
19	600900	长江电力	115,000	2,610,500.00	0.86
20	300347	泰格医药	20,000	2,556,000.00	0.85
21	603806	福斯特	18,400	2,402,120.00	0.79
22	600660	福耀玻璃	50,300	2,371,142.00	0.78

23	601877	正泰电器	43,700	2,354,993.00	0.78
24	002049	紫光国微	10,400	2,340,000.00	0.77
25	002812	恩捷股份	9,200	2,303,680.00	0.76
26	002475	立讯精密	46,000	2,263,200.00	0.75
27	000568	泸州老窖	8,800	2,234,056.00	0.74
28	600760	中航沈飞	32,800	2,231,712.00	0.74
29	002050	三花智控	87,400	2,211,220.00	0.73
30	600438	通威股份	49,100	2,207,536.00	0.73
31	603259	药明康德	18,260	2,165,270.80	0.72
32	601688	华泰证券	118,711	2,108,307.36	0.70
33	601166	兴业银行	108,481	2,065,478.24	0.68
34	002460	赣锋锂业	13,400	1,914,190.00	0.63
35	603659	璞泰来	11,900	1,911,259.00	0.63
36	600809	山西汾酒	5,940	1,875,733.20	0.62
37	600111	北方稀土	40,600	1,859,480.00	0.62
38	300014	亿纬锂能	15,700	1,855,426.00	0.61
39	000725	京东方 A	365,500	1,845,775.00	0.61
40	300122	智飞生物	14,800	1,844,080.00	0.61
41	002352	顺丰控股	26,700	1,840,164.00	0.61
42	603799	华友钴业	16,500	1,820,115.00	0.60
43	600018	上港集团	323,600	1,773,328.00	0.59
44	601728	中国电信	414,011	1,769,026.97	0.59
45	300274	阳光电源	11,800	1,720,440.00	0.57
46	300628	亿联网络	20,400	1,661,580.00	0.55
47	002241	歌尔股份	29,800	1,612,180.00	0.53
48	601766	中国中车	263,300	1,603,497.00	0.53
49	600048	保利发展	101,900	1,592,697.00	0.53
50	601919	中远海控	84,600	1,581,174.00	0.52
51	600019	宝钢股份	219,200	1,569,472.00	0.52
52	601633	长城汽车	32,300	1,567,842.00	0.52
53	601668	中国建筑	312,600	1,563,000.00	0.52
54	603833	欧派家居	10,500	1,548,750.00	0.51
55	300760	迈瑞医疗	4,000	1,523,200.00	0.50
56	000661	长春高新	5,600	1,519,840.00	0.50
57	600132	重庆啤酒	10,000	1,513,200.00	0.50
58	002821	凯莱英	3,400	1,479,000.00	0.49
59	600183	生益科技	62,100	1,462,455.00	0.48
60	002736	国信证券	126,100	1,447,628.00	0.48
61	600309	万华化学	14,200	1,434,200.00	0.47
62	601601	中国太保	51,426	1,394,673.12	0.46
63	300124	汇川技术	20,200	1,385,720.00	0.46
64	000651	格力电器	35,900	1,329,377.00	0.44

65	600436	片仔癀	3,000	1,311,450.00	0.43
66	002916	深南电路	10,500	1,279,110.00	0.42
67	603369	今世缘	23,200	1,262,080.00	0.42
68	002555	三七互娱	46,700	1,261,834.00	0.42
69	000002	万科A	63,200	1,248,832.00	0.41
70	002252	上海莱士	182,700	1,246,014.00	0.41
71	688012	中微公司	9,700	1,228,020.00	0.41
72	603517	绝味食品	17,900	1,223,107.00	0.40
73	300450	先导智能	16,100	1,197,357.00	0.40
74	000938	紫光股份	52,300	1,195,055.00	0.40
75	300759	康龙化成	8,300	1,172,541.00	0.39
76	300558	贝达药业	14,400	1,149,552.00	0.38
77	600570	恒生电子	18,262	1,134,983.30	0.38
78	600845	宝信软件	18,300	1,113,189.00	0.37
79	601211	国泰君安	61,000	1,091,290.00	0.36
80	002271	东方雨虹	20,400	1,074,672.00	0.36
81	603501	韦尔股份	3,300	1,025,541.00	0.34
82	000776	广发证券	40,100	986,059.00	0.33
83	600893	航发动力	15,400	977,284.00	0.32
84	601899	紫金矿业	98,100	951,570.00	0.31
85	002001	新和成	30,000	933,600.00	0.31
86	000063	中兴通讯	26,541	889,123.50	0.29
87	600585	海螺水泥	22,000	886,600.00	0.29
88	002304	洋河股份	5,300	873,069.00	0.29
89	000100	TCL科技	136,200	840,354.00	0.28
90	601138	工业富联	69,100	823,672.00	0.27
91	603288	海天味业	7,800	819,858.00	0.27
92	603260	合盛硅业	6,100	805,017.00	0.27
93	600426	华鲁恒升	25,700	804,410.00	0.27
94	601377	兴业证券	79,200	782,496.00	0.26
95	601808	中海油服	52,100	781,500.00	0.26
96	601111	中国国航	84,600	772,398.00	0.26
97	601658	邮储银行	149,800	763,980.00	0.25
98	601838	成都银行	63,400	760,800.00	0.25
99	001979	招商蛇口	56,000	747,040.00	0.25
100	601989	中国重工	175,800	741,876.00	0.25
101	601600	中国铝业	121,400	739,326.00	0.24
102	002230	科大讯飞	13,800	724,638.00	0.24
103	600919	江苏银行	122,800	715,924.00	0.24
104	300316	晶盛机电	10,300	715,850.00	0.24
105	601881	中国银河	63,400	709,446.00	0.23
106	603882	金域医学	6,300	701,631.00	0.23

107	601328	交通银行	150,500	693,805.00	0.23
108	002714	牧原股份	13,000	693,680.00	0.23
109	002410	广联达	10,800	690,984.00	0.23
110	601985	中国核电	83,200	690,560.00	0.23
111	601088	中国神华	30,400	684,608.00	0.23
112	601066	中信建投	23,400	684,450.00	0.23
113	601916	浙商银行	195,400	683,900.00	0.23
114	601009	南京银行	75,700	678,272.00	0.22
115	600795	国电电力	213,000	675,210.00	0.22
116	002311	海大集团	9,200	674,360.00	0.22
117	600332	白云山	19,700	673,740.00	0.22
118	600383	金地集团	51,300	665,361.00	0.22
119	603899	晨光文具	10,300	664,453.00	0.22
120	601669	中国电建	81,800	660,944.00	0.22
121	002568	百润股份	11,000	658,130.00	0.22
122	000069	华侨城 A	92,800	653,312.00	0.22
123	601898	中煤能源	100,800	634,032.00	0.21
124	601857	中国石油	129,000	633,390.00	0.21
125	601238	广汽集团	41,600	631,904.00	0.21
126	600999	招商证券	35,800	631,870.00	0.21
127	002466	天齐锂业	5,900	631,300.00	0.21
128	601006	大秦铁路	98,600	631,040.00	0.21
129	300498	温氏股份	32,600	627,876.00	0.21
130	000338	潍柴动力	35,000	626,150.00	0.21
131	000166	申万宏源	121,900	624,128.00	0.21
132	601901	方正证券	79,600	624,064.00	0.21
133	600600	青岛啤酒	6,300	623,700.00	0.21
134	600050	中国联通	158,500	622,905.00	0.21
135	300408	三环集团	13,944	621,902.40	0.21
136	300413	芒果超媒	10,800	617,976.00	0.20
137	000538	云南白药	5,900	617,435.00	0.20
138	600926	杭州银行	48,000	615,360.00	0.20
139	000895	双汇发展	19,500	615,225.00	0.20
140	300595	欧普康视	10,700	613,859.00	0.20
141	603233	大参林	14,540	612,279.40	0.20
142	601155	新城控股	21,000	611,730.00	0.20
143	000596	古井贡酒	2,500	610,000.00	0.20
144	601868	中国能建	222,700	607,971.00	0.20
145	300015	爱尔眼科	14,300	604,604.00	0.20
146	601319	中国人保	126,700	595,490.00	0.20
147	600958	东方证券	40,200	592,548.00	0.20
148	000876	新希望	38,100	579,501.00	0.19

149	601390	中国中铁	98,500	570,315.00	0.19
150	300433	蓝思科技	24,400	560,712.00	0.19
151	601236	红塔证券	46,000	548,320.00	0.18
152	603486	科沃斯	3,600	543,420.00	0.18
153	601225	陕西煤业	44,100	538,020.00	0.18
154	601939	建设银行	88,300	517,438.00	0.17
155	688396	华润微	7,900	510,340.00	0.17
156	000768	中航西飞	13,100	478,150.00	0.16
157	688008	澜起科技	5,700	478,059.00	0.16
158	002624	完美世界	23,400	475,254.00	0.16
159	000963	华东医药	11,600	466,320.00	0.15
160	688599	天合光能	5,900	465,510.00	0.15
161	600872	中炬高新	11,700	444,249.00	0.15
162	600085	同仁堂	9,600	431,808.00	0.14
163	000800	一汽解放	41,400	426,006.00	0.14
164	002841	视源股份	5,100	415,140.00	0.14
165	601865	福莱特	7,000	405,580.00	0.13
166	601607	上海医药	19,800	393,426.00	0.13
167	002179	中航光电	3,600	362,016.00	0.12
168	002459	晶澳科技	3,900	361,530.00	0.12
169	000786	北新建材	9,700	347,551.00	0.12
170	600161	天坛生物	12,000	347,520.00	0.12
171	002157	正邦科技	35,200	340,032.00	0.11
172	600011	华能国际	34,600	335,274.00	0.11
173	002600	领益智造	43,800	322,368.00	0.11
174	300896	爱美客	600	321,666.00	0.11
175	002120	韵达股份	15,700	321,222.00	0.11
176	603986	兆易创新	1,800	316,530.00	0.10
177	603939	益丰药房	5,700	314,127.00	0.10
178	601995	中金公司	6,400	313,792.00	0.10
179	601800	中国交建	36,300	311,454.00	0.10
180	002791	坚朗五金	1,700	308,703.00	0.10
181	600905	三峡能源	40,700	305,657.00	0.10
182	601933	永辉超市	73,300	296,865.00	0.10
183	600406	国电南瑞	7,300	292,219.00	0.10
184	600745	闻泰科技	2,100	271,530.00	0.09
185	002064	华峰化学	26,000	271,440.00	0.09
186	600176	中国巨石	14,400	262,080.00	0.09
187	002044	美年健康	32,700	256,695.00	0.08
188	002202	金风科技	14,200	233,874.00	0.08
189	600276	恒瑞医药	3,800	192,698.00	0.06
190	601816	京沪高铁	39,600	191,268.00	0.06

191	600547	山东黄金	10,000	188,200.00	0.06
192	601618	中国中冶	47,800	183,074.00	0.06
193	601231	环旭电子	11,100	178,266.00	0.06
194	002027	分众传媒	19,800	162,162.00	0.05
195	002601	龙佰集团	5,600	160,104.00	0.05
196	300601	康泰生物	1,600	157,664.00	0.05
197	600655	豫园股份	14,200	146,260.00	0.05
198	600741	华域汽车	4,800	135,840.00	0.04
199	600848	上海临港	9,100	135,317.00	0.04
200	603392	万泰生物	600	132,900.00	0.04
201	600837	海通证券	9,800	120,148.00	0.04
202	000783	长江证券	15,400	116,116.00	0.04
203	600584	长电科技	3,700	114,774.00	0.04
204	000977	浪潮信息	2,900	103,907.00	0.03
205	002709	天赐材料	900	103,185.00	0.03
206	601186	中国铁建	13,200	102,960.00	0.03
207	601799	星宇股份	500	102,125.00	0.03
208	000001	平安银行	5,900	97,232.00	0.03
209	688169	石头科技	118	95,934.00	0.03
210	603087	甘李药业	1,300	91,442.00	0.03
211	601878	浙商证券	6,800	89,624.00	0.03
212	600025	华能水电	13,500	88,965.00	0.03
213	603195	公牛集团	500	83,650.00	0.03
214	600763	通策医疗	400	79,600.00	0.03
215	002938	鹏鼎控股	1,800	76,374.00	0.03
216	600028	中国石化	18,040	76,309.20	0.03
217	601698	中国卫通	5,300	76,267.00	0.03
218	002024	苏宁易购	18,500	76,220.00	0.03
219	601100	恒立液压	800	65,440.00	0.02
220	300782	卓胜微	200	65,360.00	0.02
221	300529	健帆生物	1,200	63,960.00	0.02
222	601818	光大银行	18,400	61,088.00	0.02
223	600588	用友网络	1,700	60,996.00	0.02
224	600115	中国东航	11,500	59,340.00	0.02
225	600606	绿地控股	13,600	59,024.00	0.02
226	300033	同花顺	400	57,832.00	0.02
227	002236	大华股份	2,400	56,352.00	0.02
228	688111	金山办公	200	53,000.00	0.02
229	600346	恒力石化	2,200	50,534.00	0.02
230	002032	苏泊尔	800	49,792.00	0.02
231	603338	浙江鼎力	600	48,156.00	0.02
232	603993	洛阳钼业	7,600	42,408.00	0.01

233	300142	沃森生物	700	39,340.00	0.01
234	600196	复星医药	700	34,258.00	0.01
235	603658	安图生物	600	33,036.00	0.01
236	000301	东方盛虹	1,700	32,878.00	0.01
237	002008	大族激光	600	32,400.00	0.01
238	601336	新华保险	800	31,104.00	0.01
239	601788	光大证券	2,000	29,860.00	0.01
240	600989	宝丰能源	1,700	29,512.00	0.01
241	002414	高德红外	1,200	29,052.00	0.01
242	300677	英科医疗	500	28,920.00	0.01
243	601162	天风证券	6,600	26,730.00	0.01
244	300676	华大基因	300	26,340.00	0.01
245	002007	华兰生物	900	26,226.00	0.01
246	002602	世纪华通	2,500	20,975.00	0.01
247	000425	徐工机械	3,500	20,965.00	0.01
248	688561	奇安信	200	17,584.00	0.01
249	000625	长安汽车	1,100	16,709.00	0.01

8.3.2 期末积极投资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	603915	国茂股份	36,100	1,404,290.00	0.46
2	300294	博雅生物	36,000	1,380,600.00	0.46
3	600521	华海药业	59,100	1,280,106.00	0.42
4	600705	中航产融	217,000	861,490.00	0.29
5	600862	中航高科	19,300	690,168.00	0.23
6	002727	一心堂	17,800	685,478.00	0.23
7	300596	利安隆	13,600	608,736.00	0.20
8	300630	普利制药	10,800	594,432.00	0.20
9	600779	水井坊	4,900	587,951.00	0.19
10	300432	富临精工	19,800	582,120.00	0.19
11	603456	九洲药业	10,100	568,226.00	0.19
12	600499	科达制造	21,700	538,594.00	0.18
13	600482	中国动力	26,900	529,930.00	0.18
14	003021	兆威机电	6,600	527,010.00	0.17
15	002299	圣农发展	21,700	524,489.00	0.17
16	603077	和邦生物	153,400	523,094.00	0.17
17	600662	外服控股	73,000	522,680.00	0.17
18	600377	宁沪高速	60,369	520,380.78	0.17
19	002500	山西证券	78,800	520,080.00	0.17
20	603185	上机数控	3,100	517,638.00	0.17
21	601611	中国核建	49,100	489,527.00	0.16

22	603606	东方电缆	9,200	470,672.00	0.16
23	300382	斯莱克	19,300	444,672.00	0.15
24	300680	隆盛科技	12,500	390,000.00	0.13
25	600596	新安股份	15,300	382,347.00	0.13
26	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.12
27	688007	光峰科技	10,000	343,500.00	0.11
28	300394	天孚通信	9,200	336,720.00	0.11
29	002918	蒙娜丽莎	11,500	329,245.00	0.11
30	603816	顾家家居	4,200	324,072.00	0.11
31	300777	中简科技	5,200	321,776.00	0.11
32	300737	科顺股份	19,700	320,125.00	0.11
33	603997	继峰股份	19,900	319,992.00	0.11
34	002508	老板电器	8,700	313,374.00	0.10
35	600933	爱柯迪	16,100	310,408.00	0.10
36	002507	涪陵榨菜	8,200	309,960.00	0.10
37	300657	弘信电子	18,600	307,086.00	0.10
38	000739	普洛药业	8,700	305,283.00	0.10
39	600399	抚顺特钢	12,200	302,194.00	0.10
40	002968	新大正	8,300	294,069.00	0.10
41	688087	英科再生	3,100	292,826.00	0.10
42	600801	华新水泥	15,000	289,500.00	0.10
43	603300	华铁应急	21,500	289,175.00	0.10
44	603712	七一二	6,600	285,780.00	0.09
45	002541	鸿路钢构	5,300	283,762.00	0.09
46	601666	平煤股份	33,900	283,743.00	0.09
47	001215	千味央厨	4,800	279,408.00	0.09
48	300973	立高食品	2,100	277,368.00	0.09
49	688019	安集科技	1,000	273,200.00	0.09
50	000498	山东路桥	44,100	272,538.00	0.09
51	603127	昭衍新药	2,200	253,946.00	0.08
52	600703	三安光电	6,000	225,360.00	0.07
53	300982	苏文电能	3,017	222,021.03	0.07
54	603938	三孚股份	4,100	150,839.00	0.05
55	603613	国联股份	1,400	150,500.00	0.05
56	600563	法拉电子	600	139,440.00	0.05
57	688151	华强科技	3,867	130,781.94	0.04
58	002867	周大生	6,900	122,682.00	0.04
59	002558	巨人网络	10,000	119,700.00	0.04
60	002518	科士达	4,700	117,970.00	0.04
61	688262	国芯科技	2,763	115,990.74	0.04
62	600460	士兰微	2,000	108,400.00	0.04
63	000799	酒鬼酒	500	106,250.00	0.04
64	688005	容百科技	900	104,022.00	0.03
65	688768	容知日新	907	98,445.78	0.03

66	002739	万达电影	5,800	89,784.00	0.03
67	600089	特变电工	3,500	74,095.00	0.02
68	600233	圆通速递	4,400	73,392.00	0.02
69	688083	中望软件	200	69,966.00	0.02
70	300573	兴齐眼药	500	68,400.00	0.02
71	300568	星源材质	1,800	66,114.00	0.02
72	000887	中鼎股份	2,700	58,887.00	0.02
73	000988	华工科技	2,100	58,506.00	0.02
74	600566	济川药业	2,000	56,680.00	0.02
75	000627	天茂集团	16,700	55,277.00	0.02
76	300088	长信科技	4,100	54,448.00	0.02
77	002839	张家港行	9,300	53,568.00	0.02
78	600908	无锡银行	9,300	52,731.00	0.02
79	601778	晶科科技	6,100	52,033.00	0.02
80	600039	四川路桥	4,100	49,364.00	0.02
81	301050	雷电微力	203	47,652.22	0.02
82	000039	中集集团	2,700	46,332.00	0.02
83	600702	舍得酒业	200	45,460.00	0.02
84	300253	卫宁健康	2,700	45,252.00	0.01
85	002212	天融信	2,300	44,091.00	0.01
86	000686	东北证券	5,000	43,900.00	0.01
87	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.01
88	000932	华菱钢铁	8,300	42,413.00	0.01
89	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
90	002409	雅克科技	500	40,585.00	0.01
91	600737	中粮糖业	4,100	38,540.00	0.01
92	601168	西部矿业	2,800	38,108.00	0.01
93	002648	卫星化学	900	36,027.00	0.01
94	688598	金博股份	100	35,504.00	0.01
95	002254	泰和新材	1,800	35,298.00	0.01
96	000807	云铝股份	3,100	34,627.00	0.01
97	601636	旗滨集团	2,000	34,200.00	0.01
98	300251	光线传媒	2,600	33,410.00	0.01
99	002850	科达利	200	32,068.00	0.01
100	300661	圣邦股份	100	30,900.00	0.01
101	300136	信维通信	1,200	30,384.00	0.01
102	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
103	301035	润丰股份	507	28,533.96	0.01
104	600803	新奥股份	1,500	27,540.00	0.01
105	301039	中集车辆	2,054	25,695.54	0.01
106	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
107	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
108	000733	振华科技	200	24,856.00	0.01
109	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01

110	600295	鄂尔多斯	1,000	23,590.00	0.01
111	300037	新宙邦	200	22,600.00	0.01
112	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
113	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
114	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
115	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
116	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
117	688408	中信博	100	17,651.00	0.01
118	600754	锦江酒店	300	17,580.00	0.01
119	301211	亨迪药业	518	17,430.70	0.01
120	301127	天源环保	1,011	17,308.32	0.01
121	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
122	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
123	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
124	301101	明月镜片	334	14,482.24	0.00
125	301087	可孚医疗	189	14,239.26	0.00
126	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
127	301221	光庭信息	152	13,485.44	0.00
128	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
129	301090	华润材料	1,141	12,802.02	0.00
130	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
131	301166	优宁维	135	12,757.50	0.00
132	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
133	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
134	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
135	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
136	301091	深城交	354	11,083.74	0.00
137	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
138	301093	华兰股份	201	10,019.85	0.00
139	301100	风光股份	318	9,902.52	0.00
140	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
141	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
142	301190	善水科技	338	9,281.48	0.00
143	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
144	301179	泽宇智能	182	9,240.14	0.00
145	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
146	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
147	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
148	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
149	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
150	301088	戎美股份	317	7,820.39	0.00
151	301092	争光股份	218	7,743.36	0.00
152	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
153	301193	家联科技	264	7,692.96	0.00

154	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
155	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
156	301096	百诚医药	95	7,460.35	0.00
157	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
158	301108	洁雅股份	124	6,660.04	0.00
159	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
160	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
161	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
162	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
163	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
164	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
165	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
166	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
167	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
168	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
169	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
170	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
171	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
172	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
173	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
174	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
175	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	600519	贵州茅台	71,451,705.00	17.64
2	600809	山西汾酒	37,968,784.62	9.38
3	000858	五粮液	36,333,350.89	8.97
4	000333	美的集团	36,250,524.35	8.95
5	601318	中国平安	33,837,092.20	8.36
6	601012	隆基股份	32,164,874.20	7.94
7	300059	东方财富	31,431,438.80	7.76
8	002415	海康威视	31,035,240.80	7.66
9	600036	招商银行	28,624,240.19	7.07
10	600887	伊利股份	26,082,453.66	6.44
11	002475	立讯精密	25,615,774.01	6.33
12	601888	中国中免	24,972,610.00	6.17
13	600030	中信证券	24,969,812.00	6.17
14	000568	泸州老窖	24,811,647.22	6.13
15	600690	海尔智家	24,159,471.00	5.97

16	601166	兴业银行	24,145,655.33	5.96
17	002594	比亚迪	23,859,510.00	5.89
18	601288	农业银行	23,846,072.00	5.89
19	600600	青岛啤酒	22,962,961.88	5.67
20	603501	韦尔股份	22,778,355.46	5.62
21	600048	保利发展	22,366,386.64	5.52
22	000725	京东方 A	22,062,201.42	5.45
23	603259	药明康德	21,697,967.68	5.36
24	300122	智飞生物	21,353,164.19	5.27
25	000651	格力电器	21,169,716.78	5.23
26	600276	恒瑞医药	20,771,717.24	5.13
27	002304	洋河股份	20,726,345.80	5.12
28	601899	紫金矿业	20,488,689.00	5.06
29	300750	宁德时代	20,446,622.50	5.05
30	300015	爱尔眼科	20,357,729.62	5.03
31	603799	华友钴业	19,547,520.83	4.83
32	600309	万华化学	19,351,755.10	4.78
33	000002	万科 A	19,291,756.40	4.76
34	600438	通威股份	19,280,144.20	4.76
35	300014	亿纬锂能	18,883,097.45	4.66
36	601377	兴业证券	18,846,308.50	4.65
37	002714	牧原股份	18,837,395.20	4.65
38	601328	交通银行	18,186,324.00	4.49
39	601211	国泰君安	18,117,854.00	4.47
40	601668	中国建筑	17,900,312.00	4.42
41	600900	长江电力	17,392,862.00	4.29
42	002311	海大集团	17,313,848.63	4.28
43	002812	恩捷股份	17,108,637.00	4.22
44	601225	陕西煤业	16,993,860.39	4.20
45	601688	华泰证券	16,852,554.19	4.16
46	601088	中国神华	16,623,914.00	4.11
47	600893	航发动力	16,380,303.33	4.04
48	002027	分众传媒	16,275,036.99	4.02
49	000661	长春高新	16,129,475.73	3.98
50	601628	中国人寿	15,907,289.74	3.93
51	002493	荣盛石化	15,879,201.48	3.92
52	600176	中国巨石	15,802,513.23	3.90
53	000100	TCL 科技	15,580,781.00	3.85
54	002129	中环股份	15,523,288.73	3.83
55	002271	东方雨虹	15,503,846.30	3.83
56	600183	生益科技	15,494,967.00	3.83
57	601009	南京银行	15,420,213.41	3.81

58	600837	海通证券	15,371,199.00	3.80
59	300347	泰格医药	15,213,551.00	3.76
60	300124	汇川技术	15,195,849.57	3.75
61	603986	兆易创新	15,046,801.00	3.72
62	600763	通策医疗	14,894,815.80	3.68
63	002179	中航光电	14,831,526.00	3.66
64	600570	恒生电子	14,770,561.80	3.65
65	600031	三一重工	14,743,016.00	3.64
66	002049	紫光国微	14,698,963.00	3.63
67	601939	建设银行	14,438,036.00	3.57
68	600660	福耀玻璃	14,349,455.00	3.54
69	600872	中炬高新	14,335,319.29	3.54
70	000786	北新建材	14,292,062.67	3.53
71	601601	中国太保	14,254,056.00	3.52
72	002624	完美世界	14,203,949.00	3.51
73	601633	长城汽车	14,151,815.00	3.49
74	601618	中国中冶	13,935,852.00	3.44
75	600019	宝钢股份	13,846,645.82	3.42
76	300408	三环集团	13,822,337.71	3.41
77	600383	金地集团	13,817,540.37	3.41
78	300142	沃森生物	13,767,187.00	3.40
79	002236	大华股份	13,697,900.33	3.38
80	000063	中兴通讯	13,631,218.56	3.37
81	600760	中航沈飞	13,517,482.00	3.34
82	601877	正泰电器	13,501,109.00	3.33
83	601919	中远海控	13,311,732.68	3.29
84	000776	广发证券	13,269,088.00	3.28
85	002460	赣锋锂业	13,156,298.25	3.25
86	600011	华能国际	13,152,688.00	3.25
87	600958	东方证券	13,120,352.55	3.24
88	600741	华域汽车	13,106,314.66	3.24
89	600745	闻泰科技	13,072,175.64	3.23
90	002241	歌尔股份	13,044,445.00	3.22
91	600919	江苏银行	12,999,681.00	3.21
92	601336	新华保险	12,927,372.86	3.19
93	002142	宁波银行	12,836,246.44	3.17
94	603833	欧派家居	12,798,850.35	3.16
95	002371	北方华创	12,690,987.00	3.13
96	600028	中国石化	12,491,392.00	3.08
97	002555	三七互娱	12,486,447.00	3.08
98	000001	平安银行	12,355,853.80	3.05
99	600585	海螺水泥	12,339,259.00	3.05

100	601390	中国中铁	12,137,899.00	3.00
101	002230	科大讯飞	12,055,212.38	2.98
102	002352	顺丰控股	11,995,807.22	2.96
103	600111	北方稀土	11,982,601.00	2.96
104	600406	国电南瑞	11,841,673.16	2.92
105	600436	片仔癀	11,808,335.00	2.92
106	002821	凯莱英	11,677,246.00	2.88
107	002008	大族激光	11,650,235.14	2.88
108	600104	上汽集团	11,501,736.17	2.84
109	601838	成都银行	11,244,890.74	2.78
110	600999	招商证券	11,185,536.96	2.76
111	300529	健帆生物	11,158,561.37	2.76
112	000338	潍柴动力	11,133,246.00	2.75
113	300033	同花顺	10,987,109.00	2.71
114	601600	中国铝业	10,976,393.11	2.71
115	603993	洛阳钼业	10,956,272.00	2.71
116	601808	中海油服	10,727,579.55	2.65
117	000538	云南白药	10,704,067.00	2.64
118	000895	双汇发展	10,679,695.00	2.64
119	601100	恒立液压	10,570,617.00	2.61
120	603288	海天味业	10,557,039.51	2.61
121	000977	浪潮信息	10,511,145.30	2.60
122	601238	广汽集团	10,294,553.85	2.54
123	603806	福斯特	10,227,686.77	2.53
124	601111	中国国航	10,224,908.00	2.52
125	600845	宝信软件	10,158,467.90	2.51
126	002736	国信证券	10,143,405.00	2.50
127	601006	大秦铁路	10,060,012.00	2.48
128	002508	老板电器	10,050,290.00	2.48
129	300413	芒果超媒	9,975,165.00	2.46
130	002601	龙佰集团	9,924,106.00	2.45
131	000166	申万宏源	9,899,663.00	2.44
132	601155	新城控股	9,890,148.73	2.44
133	600196	复星医药	9,881,799.00	2.44
134	002001	新和成	9,761,432.00	2.41
135	601766	中国中车	9,709,714.00	2.40
136	002841	视源股份	9,658,744.02	2.39
137	002410	广联达	9,569,642.10	2.36
138	002727	一心堂	9,532,551.02	2.35
139	600132	重庆啤酒	9,475,103.35	2.34
140	000596	古井贡酒	9,381,038.77	2.32
141	300628	亿联网络	9,299,498.00	2.30

142	300760	迈瑞医疗	9,243,987.04	2.28
143	601818	光大银行	9,159,645.00	2.26
144	300274	阳光电源	9,071,638.93	2.24
145	001979	招商蛇口	8,975,714.25	2.22
146	000625	长安汽车	8,923,475.20	2.20
147	603369	今世缘	8,853,363.00	2.19
148	601985	中国核电	8,831,306.00	2.18
149	300601	康泰生物	8,784,291.00	2.17
150	600926	杭州银行	8,697,116.00	2.15
151	601229	上海银行	8,692,740.00	2.15
152	300450	先导智能	8,671,210.00	2.14
153	000938	紫光股份	8,574,039.75	2.12
154	600346	恒力石化	8,518,758.00	2.10
155	002202	金风科技	8,421,706.00	2.08
156	603517	绝味食品	8,360,694.00	2.06
157	002007	华兰生物	8,290,650.00	2.05
158	002414	高德红外	8,253,823.00	2.04

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	600519	贵州茅台	80,370,559.76	19.85
2	601318	中国平安	42,139,254.21	10.41
3	000333	美的集团	39,330,386.44	9.71
4	000858	五粮液	38,820,969.40	9.59
5	600809	山西汾酒	38,597,536.85	9.53
6	600036	招商银行	37,128,122.00	9.17
7	300059	东方财富	34,800,711.89	8.59
8	601012	隆基股份	33,519,790.11	8.28
9	002415	海康威视	31,442,469.28	7.76
10	601166	兴业银行	28,665,086.50	7.08
11	600887	伊利股份	26,937,496.00	6.65
12	601888	中国中免	26,621,554.00	6.57
13	000568	泸州老窖	26,254,621.00	6.48
14	002475	立讯精密	26,008,886.00	6.42
15	601288	农业银行	25,966,858.00	6.41
16	600030	中信证券	25,943,099.73	6.41
17	002594	比亚迪	25,694,483.24	6.34
18	600276	恒瑞医药	25,465,717.78	6.29

19	600048	保利发展	24,863,907.31	6.14
20	603501	韦尔股份	24,588,653.96	6.07
21	000651	格力电器	23,896,745.60	5.90
22	000725	京东方 A	23,629,010.00	5.83
23	603259	药明康德	23,120,769.32	5.71
24	601899	紫金矿业	22,949,788.29	5.67
25	600690	海尔智家	22,860,082.05	5.65
26	600600	青岛啤酒	22,521,700.80	5.56
27	600309	万华化学	21,865,909.00	5.40
28	002304	洋河股份	21,580,706.16	5.33
29	000002	万科 A	21,520,014.80	5.31
30	300122	智飞生物	21,214,658.91	5.24
31	600438	通威股份	20,701,652.38	5.11
32	300014	亿纬锂能	20,168,070.00	4.98
33	002714	牧原股份	19,990,617.98	4.94
34	300015	爱尔眼科	18,925,306.87	4.67
35	603799	华友钴业	18,894,352.00	4.67
36	601211	国泰君安	18,886,117.94	4.66
37	601377	兴业证券	18,686,300.00	4.61
38	601225	陕西煤业	18,595,626.00	4.59
39	600900	长江电力	18,594,766.00	4.59
40	601668	中国建筑	18,436,539.68	4.55
41	600031	三一重工	18,056,794.00	4.46
42	002311	海大集团	18,050,519.63	4.46
43	601328	交通银行	17,622,026.00	4.35
44	002027	分众传媒	17,459,398.80	4.31
45	601088	中国神华	17,238,058.75	4.26
46	002179	中航光电	16,920,199.60	4.18
47	600837	海通证券	16,751,510.77	4.14
48	601688	华泰证券	16,591,010.00	4.10
49	601628	中国人寿	16,579,792.33	4.09
50	000001	平安银行	16,566,292.60	4.09
51	601009	南京银行	16,377,345.00	4.04
52	600893	航发动力	16,209,034.26	4.00
53	000661	长春高新	16,184,591.00	4.00
54	300124	汇川技术	16,148,034.00	3.99
55	600176	中国巨石	16,114,530.97	3.98
56	002271	东方雨虹	15,988,167.56	3.95
57	603986	兆易创新	15,957,252.80	3.94
58	000100	TCL 科技	15,622,381.00	3.86
59	600570	恒生电子	15,180,206.50	3.75
60	601601	中国太保	15,157,854.00	3.74

61	000786	北新建材	14,851,504.31	3.67
62	002241	歌尔股份	14,760,962.12	3.65
63	601939	建设银行	14,726,441.00	3.64
64	002236	大华股份	14,725,979.84	3.64
65	601633	长城汽车	14,681,947.98	3.63
66	600872	中炬高新	14,672,335.02	3.62
67	002812	恩捷股份	14,667,296.40	3.62
68	000776	广发证券	14,622,789.57	3.61
69	300142	沃森生物	14,543,386.00	3.59
70	600763	通策医疗	14,481,457.56	3.58
71	000063	中兴通讯	14,474,865.00	3.57
72	002230	科大讯飞	14,325,341.00	3.54
73	600741	华域汽车	13,869,813.59	3.42
74	002624	完美世界	13,853,669.50	3.42
75	600183	生益科技	13,848,040.00	3.42
76	002493	荣盛石化	13,798,684.78	3.41
77	600019	宝钢股份	13,755,499.96	3.40
78	300408	三环集团	13,743,993.60	3.39
79	002129	中环股份	13,715,442.05	3.39
80	600919	江苏银行	13,711,262.00	3.39
81	600660	福耀玻璃	13,693,049.12	3.38
82	300347	泰格医药	13,644,929.50	3.37
83	601336	新华保险	13,447,626.08	3.32
84	601618	中国中冶	13,420,699.00	3.31
85	600958	东方证券	13,389,569.88	3.31
86	601919	中远海控	13,361,225.06	3.30
87	600406	国电南瑞	13,330,046.08	3.29
88	002049	紫光国微	13,228,146.14	3.27
89	600585	海螺水泥	13,135,656.66	3.24
90	600011	华能国际	12,921,642.66	3.19
91	002460	赣锋锂业	12,902,673.98	3.19
92	600999	招商证券	12,889,247.60	3.18
93	601390	中国中铁	12,879,876.00	3.18
94	600383	金地集团	12,791,873.07	3.16
95	002142	宁波银行	12,648,706.00	3.12
96	600745	闻泰科技	12,534,851.00	3.10
97	002008	大族激光	12,530,333.55	3.09
98	002352	顺丰控股	12,529,147.99	3.09
99	600104	上汽集团	12,504,310.00	3.09
100	600436	片仔癀	12,471,913.00	3.08
101	300750	宁德时代	12,431,437.00	3.07
102	002371	北方华创	12,267,313.00	3.03

103	603288	海天味业	12,257,508.63	3.03
104	600028	中国石化	12,234,674.40	3.02
105	000338	潍柴动力	12,121,922.80	2.99
106	600760	中航沈飞	12,092,285.20	2.99
107	600196	复星医药	11,845,331.00	2.93
108	603833	欧派家居	11,798,276.29	2.91
109	601838	成都银行	11,342,122.00	2.80
110	601877	正泰电器	11,317,294.00	2.79
111	600111	北方稀土	11,292,168.00	2.79
112	603993	洛阳钼业	11,254,944.16	2.78
113	300033	同花顺	11,109,134.20	2.74
114	601100	恒立液压	10,875,650.40	2.69
115	002555	三七互娱	10,859,665.00	2.68
116	002601	龙佰集团	10,793,255.00	2.67
117	002821	凯莱英	10,788,920.00	2.66
118	601818	光大银行	10,771,030.00	2.66
119	300529	健帆生物	10,752,299.22	2.66
120	000538	云南白药	10,703,359.00	2.64
121	000977	浪潮信息	10,679,196.10	2.64
122	601600	中国铝业	10,387,747.00	2.57
123	000166	申万宏源	10,366,238.17	2.56
124	601238	广汽集团	10,311,339.95	2.55
125	601111	中国国航	10,257,882.00	2.53
126	600926	杭州银行	10,232,101.43	2.53
127	002508	老板电器	10,138,032.00	2.50
128	002410	广联达	10,115,205.75	2.50
129	601006	大秦铁路	10,092,250.00	2.49
130	600346	恒力石化	10,020,463.60	2.47
131	002841	视源股份	9,867,815.00	2.44
132	000895	双汇发展	9,813,777.50	2.42
133	601808	中海油服	9,803,050.12	2.42
134	000625	长安汽车	9,774,626.84	2.41
135	300413	芒果超媒	9,765,699.41	2.41
136	002727	一心堂	9,496,732.51	2.35
137	000596	古井贡酒	9,409,180.00	2.32
138	002001	新和成	9,311,581.60	2.30
139	600703	三安光电	9,026,336.00	2.23
140	600845	宝信软件	9,015,123.00	2.23
141	001979	招商蛇口	9,001,896.01	2.22
142	002007	华兰生物	8,874,502.60	2.19
143	601229	上海银行	8,783,840.05	2.17
144	601155	新城控股	8,664,227.14	2.14

145	300601	康泰生物	8,574,703.00	2.12
146	601985	中国核电	8,528,592.00	2.11
147	300144	宋城演艺	8,500,574.89	2.10
148	002736	国信证券	8,303,435.46	2.05
149	000739	普洛药业	8,269,046.41	2.04
150	002202	金风科技	8,257,956.56	2.04
151	603806	福斯特	8,216,895.00	2.03
152	603369	今世缘	8,146,462.32	2.01
153	300274	阳光电源	8,122,823.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,530,709,335.56
卖出股票收入（成交）总额	3,604,705,148.80

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

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	15,202,085.00	5.03
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）	337,126.99	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,539,211.99	5.14

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	100,000	10,003,000.00	3.31
2	019649	21 国债 01	40,500	4,050,810.00	1.34
3	019658	21 国债 10	11,500	1,148,275.00	0.38
4	113052	兴业转债	3,040	303,996.04	0.10

5	113049	长汽转债	210	32,148.90	0.01
---	--------	------	-----	-----------	------

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

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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计 (元)					-
股指期货投资本期收益 (元)					-1,066,050.48
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					-917,440.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，通过多头或空头套期保值等策略进行股指期货投资，以控制并调整投资组合风险、提高投资的资金效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本基金的投资目标。

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

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

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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东方财富（股票代码：300059 SZ）、招商银行（股票代码：600036 SH）、中国平安（股票代码：601318 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 7 月 19 日，东方财富信息股份有限公司因未依法履行职责被工信部通报批评，通知整改。

2021 年 5 月 10 日，招商银行股份有限公司因未依法履行职责被国家互联网信息办公室通知整改。

2021 年 5 月 21 日，招商银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会罚款 7,170.00 万元【银保监罚决字（2021）16 号】。

2021 年 2 月 23 日，中国平安保险(集团)股份有限公司因未依法履行职责被广东省通信管理局通知整改。

2021 年 7 月 5 日，中国平安保险(集团)股份有限公司因违规经营被银保监会人身保险监管部通知整改，通报批评【人身险部函（2021）305 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	120,241.32
2	应收证券清算款	637,174.18
3	应收股利	-
4	应收利息	270,455.48
5	应收申购款	112,900.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,140,771.90

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113049	长汽转债	32,148.90	0.01
2	127038	国微转债	982.05	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五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 (%)
安信量化沪深 300 增强 A	8,646	9,496.54	57,246,768.65	69.72	24,860,285.84	30.28
安信量化沪深 300 增强 C	7,553	11,058.91	62,014,888.17	74.24	21,513,034.51	25.76
合计	16,007	10,347.66	119,261,656.82	72.00	46,373,320.35	28.00

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	安信量化沪深 300 增强 A	160.04	0.00
	安信量化沪深 300 增强 C	65,878.83	0.08

有本基金			
	合计	66,038.87	0.04

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	安信量化沪深 300 增强 A	0
	安信量化沪深 300 增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	安信量化沪深 300 增强 A	0
	安信量化沪深 300 增强 C	0~10
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信量化沪深 300 增强 A	安信量化沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 5 月 7 日）基金份额总额	586,304.23	60,774,551.77
本报告期期初基金份额总额	36,391,131.55	181,003,842.93
本报告期基金总申购份额	81,963,995.82	210,398,862.75
减：本报告期基金总赎回份额	36,248,072.88	307,874,783.00
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	82,107,054.49	83,527,922.68

§ 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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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 50,000.00 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	
信达证券	2	1,772,785,252.78	24.92%	1,260,980.28	24.38%	新租

方正证券	2	1,366,361,76 1.54	19.21%	971,891.94	18.79%	-
中泰证券	2	1,153,542,93 2.93	16.22%	820,517.05	15.86%	-
广发证券	2	1,020,926,36 0.30	14.35%	726,185.74	14.04%	-
开源证券	1	855,176,414. 39	12.02%	608,289.38	11.76%	-
中信证券	2	564,401,691. 26	7.93%	514,342.32	9.94%	-
申万宏源	2	379,724,582. 31	5.34%	270,093.54	5.22%	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-

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
信达证券	45,816,758.70	44.40%	1,152,100,000.00	44.28%	-	-
方正证券	3,550,505.00	3.44%	154,900,000.00	5.95%	-	-
中泰证券	3,281,040.08	3.18%	205,200,000.00	7.89%	-	-
广发证券	44,622,940.20	43.25%	801,300,000.00	30.80%	-	-
开源证券	2,041,975.10	1.98%	-	-	-	-
中信证券	3,000,000.00	2.91%	257,000,000.00	9.88%	-	-
申万宏源	867,608.38	0.84%	31,500,000.00	1.21%	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-21
2	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
3	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
4	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
5	关于安信价值精选股票型证券投资基金等 10 只基金新增华林证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-10
6	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 16 只基金新增华金证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-15
7	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
8	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
9	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
10	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-30
11	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
12	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-21
13	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增爱建证券有限责	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-30

	任公司为基金销售服务机构的公告		
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
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英大证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-15
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新增基金直销账户信息的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
22	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
23	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-10-26

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

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新起点灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件；

- 2、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化精选沪深 300 指数增强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