

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金（LOF）

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2022 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	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	13
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16
6.2	审计报告的基本内容	17
§ 7	年度财务报表	19
7.1	资产负债表	19
7.2	利润表	20
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	21
§ 8	投资组合报告	52
8.1	期末基金资产组合情况	52
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	70

8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	70
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	70
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 .....	70
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 .....	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.12	投资组合报告附注 .....	71
§ 9	基金份额持有人信息 .....	73
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	73
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	73
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.4	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 .....	74
9.5	发起式基金发起资金持有份额情况 .....	74
§ 10	开放式基金份额变动 .....	74
§ 11	重大事件揭示 .....	74
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	74
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 .....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	75
11.4	基金投资策略的改变 .....	75
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	75
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 .....	75
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8	其他重大事件 .....	79
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
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 .....	81
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
§ 13	备查文件目录 .....	82
13.1	备查文件目录 .....	82
13.2	存放地点 .....	82
13.3	查阅方式 .....	82

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)	
基金简称	中信保诚中证 500 指数 (LOF)	
场内简称	信诚 500LOF	
基金主代码	165511	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 01 月 01 日	
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	148,445,357.83 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2021 年 02 月 03 日	
下属分级基金的基金简称	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
下属分级基金场内简称	信诚 500LOF	-
下属分级基金的交易代码	165511	013119
报告期末下属分级基金的份额总额	127,597,582.52 份	20,847,775.31 份

注：自 2021 年 8 月 23 日起，本基金场内简称扩位为“信诚 500LOF”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行数量化指数投资,通过严谨的数量化管理和投资纪律约束,实现对中证 500 指数的有效跟踪,为投资者提供一个投资中证 500 指数的有效工具。
投资策略	<p>本基金采用数量化指数投资方法,按照成份股在中证 500 指数中的基准权重为基础,以抽样复制的策略构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股(含存托凭证)及其权重的变化进行相应调整,力争保持基金净值收益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 0.35%,年跟踪误差不超过 4%。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或法律法规禁止投资等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。</p> <p>基金管理人将对成份股的流动性进行分析,如发现流动性欠佳的个股将可能采用合理方法寻求替代。基金管理人运用以下策略构造替代股组合:</p> <p>(1) 基本面替代:按照与被替代股票所属行业,基本面及规模相似的原则,选取一揽子标的指数成份股票作为替代股备选库;</p> <p>(2) 相关性检验:计算备选库中各股票与被替代股票日收益率的相</p>

	<p>关系数并选取与被替代股票相关性较高的股票组成模拟组合,以组合与被替代股票的日收益率序列的相关系数最大化为优化目标,求解组合中替代股票的权重,并构建替代股组合。</p> <p>基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理,如预期大额申购赎回、大量分红等,以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。</p> <p>基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组,授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项,同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。此外,基金管理人还将做好培训和准备工作。</p> <p>对于存托凭证投资,本基金将在深入研究的基础上,通过定性分析、定量分析等方式,筛选相应的存托凭证投资标的。</p>
业绩比较基准	95%×中证 500 指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为跟踪指数的股票型基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	李申
	联系电话	021-68649788	021-60637102
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-666-0066	021-60637111
传真		021-50120895	021-60635778
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		涂一锴	田国立

### 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.citicprufunds.com.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	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼八层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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	报告期 (2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
本期已实现收益	48,620,479.98	1,430,773.47
本期利润	47,104,151.24	201,557.56
加权平均基金份额本期利润	0.3880	0.0252
本期加权平均净值利润率	23.04%	1.37%
本期基金份额净值增长率	25.88%	4.19%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021 年 12 月 31 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
期末可供分配利润	112,621,141.71	18,356,265.94
期末可供分配基金份额利润	0.8826	0.8805
期末基金资产净值	239,323,010.18	39,057,902.39
期末基金份额净值	1.8756	1.8735
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021 年 12 月 31 日)	
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C
基金份额累计净值增长率	25.88%	4.19%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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、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

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

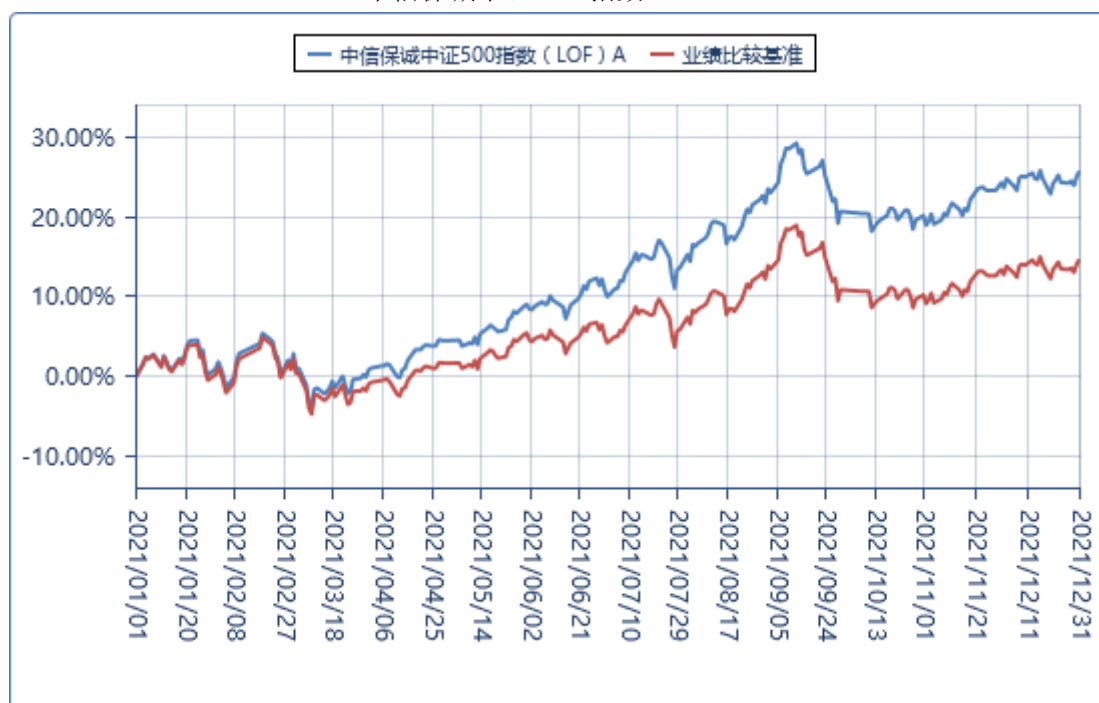
过去三个月	4.18%	0.71%	3.43%	0.72%	0.75%	-0.01%
过去六个月	12.04%	0.90%	7.72%	0.91%	4.32%	-0.01%
自基金合同生效起至今	25.88%	0.92%	14.83%	0.92%	11.05%	0.00%

中信保诚中证 500 指数 (LOF) 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	4.09%	0.71%	3.43%	0.72%	0.66%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.19%	0.87%	2.76%	0.88%	1.43%	-0.01%

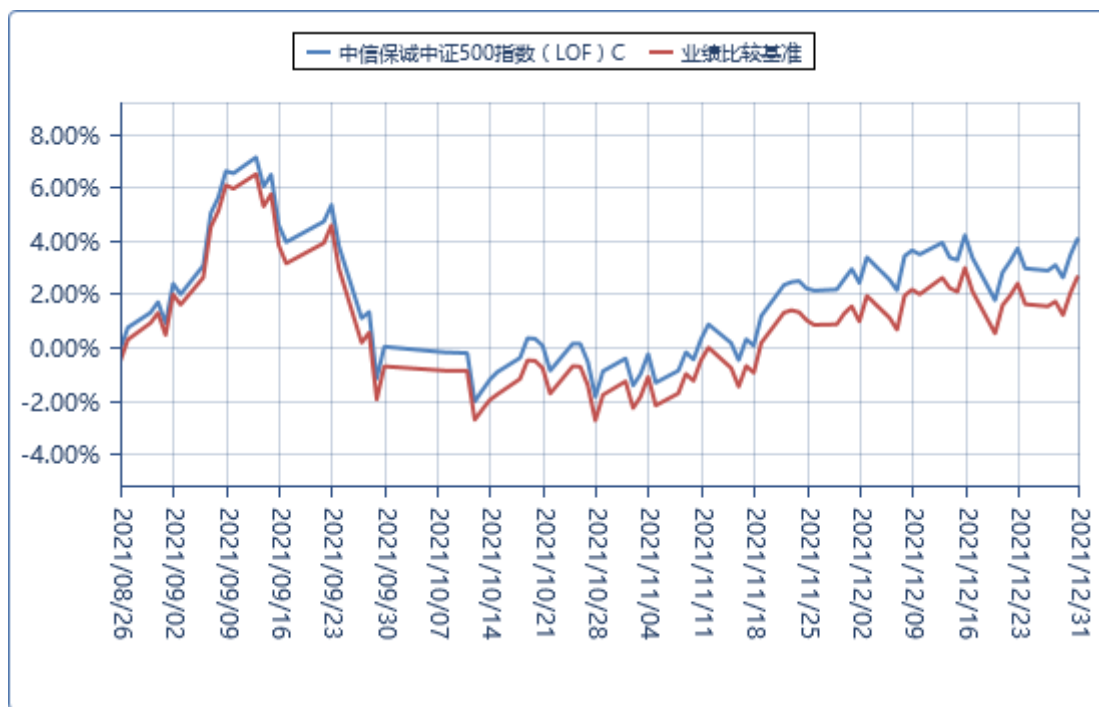
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A



中信保诚中证 500 指数 (LOF) C

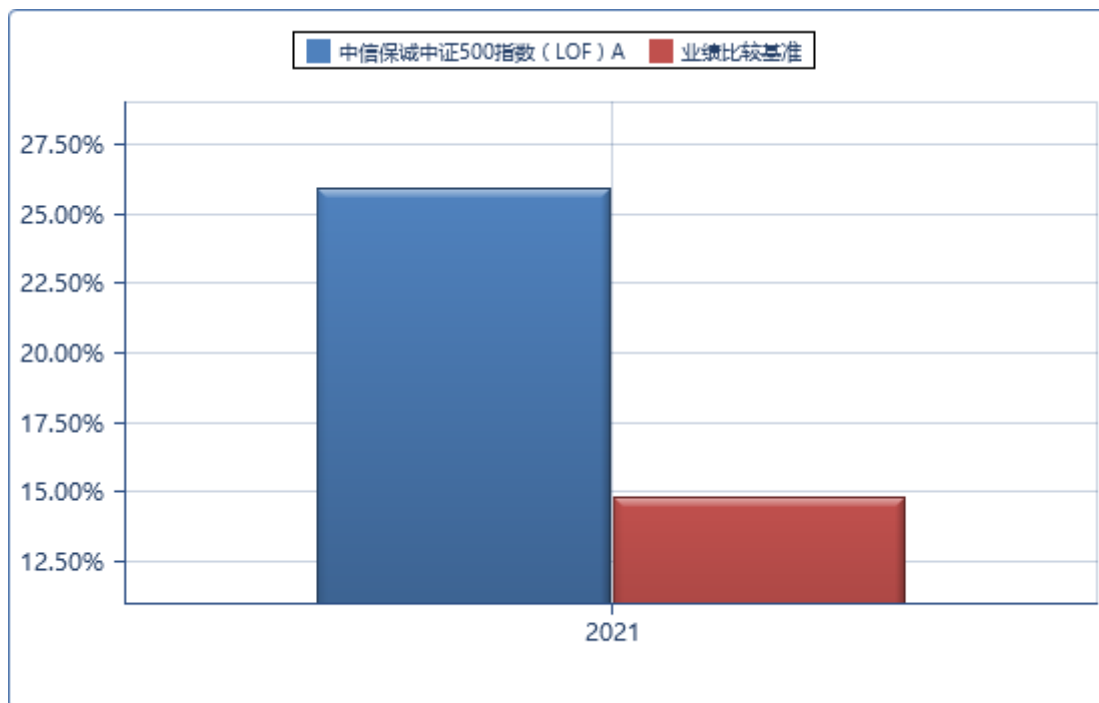




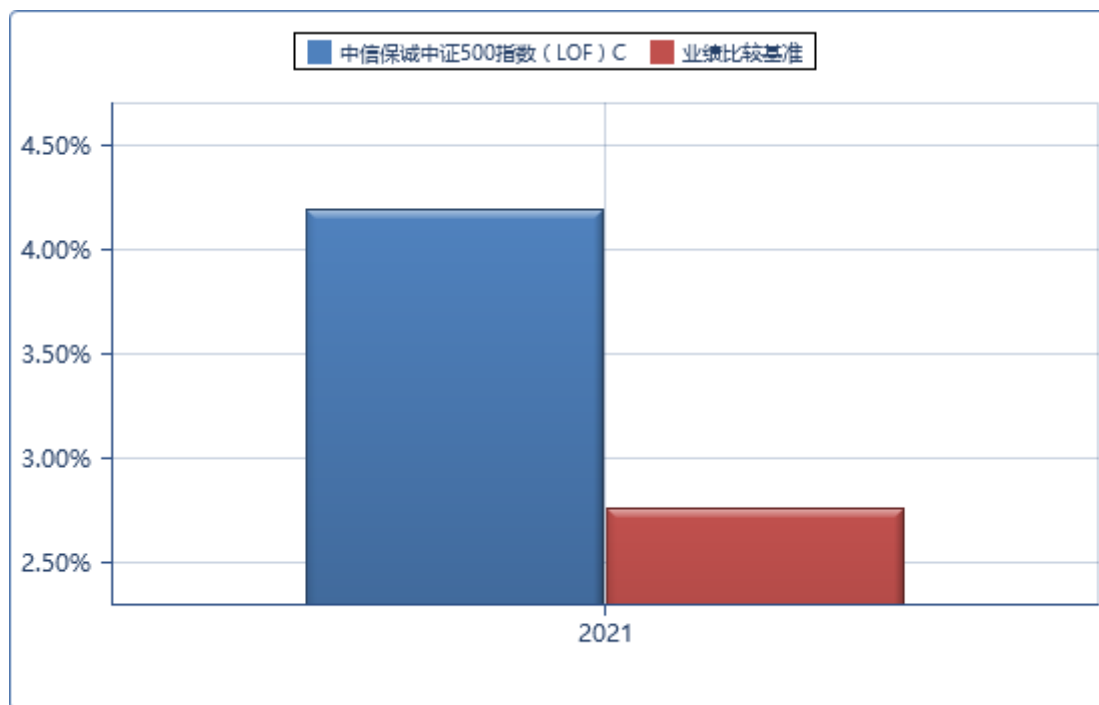
注：本基金于 2021 年 8 月 26 日起新增 C 类份额。

### 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

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A



中信保诚中证 500 指数 (LOF) C



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年无利润分配事项。

## § 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

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于 2005 年 9 月 30 日正式成立，注册资本 2 亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。因业务发展需要，经国家工商行政管理总局核准，本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人管理的运作中基金为 79 只，分别为：信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金 (LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金 (LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚货币市

场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金 (LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金 (LOF)、中信保诚沪深 300 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚双盈债券型证券投资基金 (LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚景华债券型证券投资基金、中信保诚至远动力混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 金融指数型证券投资基金 (LOF)、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金 (LOF)、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金 (LOF)、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金 (LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽 18 个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉鸿债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、中信保诚景裕中短债债券型证券投资基金、中信保诚安鑫回报债券型证券投资基金、中信保诚成长动力混合型证券投资基金、中信保诚嘉润 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中信保诚丰裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中信保诚龙腾精选混合型证券投资基金、中信保诚盛裕一年持有期混合型证券投资基金、中信保诚养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、中信保诚弘远混合型证券投资基金、

中信保诚前瞻优势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		
黄稚	基金经理	2018 年 07 月 25 日	-	10	黄稚女士, 理学硕士。曾任职于中国国际金融有限公司, 担任资产管理部产品经理; 于平安证券有限责任公司, 担任产品经理。2015 年 6 月加入中信保诚基金管理有限公司, 历任金融工程师、基金经理助理。现任中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)、信诚中证建设工程指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 医药指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 800 有色指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证 TMT 产业主题指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证信息安全指数型证券投资基金 (LOF)、中信保诚中证智能家居指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。

注: 1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规,

没有发生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

为使公司管理的不同投资组合得到公平对待,保护投资者合法权益,根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司已制订了《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》(“公平交易制度”)作为开展公平交易管理的规则指引,制度适用公司管理所有投资组合(包括公募基金、特定客户资产管理组合),对应的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动。

在实际的公平交易管理贯彻落实中,公司在公平交易制度的指引下采用事前、事中、事后的全流程控制方法。事前管理主要包括:已搭建了合理的资产管理业务之间及资产管理业务内的组织架构,健全投资授权制度,设立防火墙,确保各块投资业务、各基金组合投资决策机制的合理合规与相对独立;同时让各业务组合共享必要的研究、投资信息等,确保机会公平。在日常操作上明确一级市场、非集中竞价市场投资的要求与审批流程;借助系统建立投资备选库、交易对手库、基金风格维度库,规范二级市场、集中竞价市场的操作,建立公平交易的制度流程文化环境。事中监控主要包括:公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,确保一般情况下不同投资组合同向买卖同一证券时需通过交易系统对组合同间的交易公平性进行自动化处理,按照时间优先、比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量;同时原则上禁止同日反向交易,如因流动性等问题需要反向交易须经过严格审批和留档。一级市场、非集中竞价市场等的投资则需要经过合理询价、逐笔审批与公平分配。事后管理主要包括:定期对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异进行分析,对连续四个季度期间内、不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析,对反向交易等进行价差分析。同时,合规及内部审计人员会对公平交易的执行情况做定期检查。相关人员对事后评估报告、合规审计报告进行审阅,签字确认,如有异常情况将及时报送相关部门并做信息披露。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》,公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程,确保各投资组合享有公平的投资决策机会,建立公平交易的制度环境;交易环节加强交易执行的内部控制,利用恒生交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场对同一证券交易时的公平;

公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

## 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,全球经济延续复苏,大宗商品价格持续走高,海外主要经济体通胀数据攀升,宏观政策温和收缩。国内经济上半年复苏较为稳健,下半年受到极端天气、疫情反复等因素的拖累经济增长有所回落,经济内生动能逐渐趋缓。

报告期内,A股市场呈震荡上行格局,行业分化较为明显。上证指数上涨 4.80%,沪深 300 下跌 -5.20%,中证 500 上涨 15.58%,创业板指上涨 12.02%,其中电力设备、有色金属、煤炭、基础化工、钢铁等行业涨幅居前,而家用电器、非银金融、房地产、社会服务、食品饮料等行业表现较差。

本基金跟踪的标的指数为中证 500 指数。报告期内,本基金在严格控制指数跟踪偏离的基础上,采用数量化方法构建指数化投资组合,实现对标的指数的有效跟踪。本基金认真应对投资者日常申购、赎回,根据市场情况、成分股停牌等合理安排权益仓位和头寸,有效管理跟踪误差。本基金运用股指期货进行多头套保以提高投资效率。同时,积极参与网下新股申购,以提高基金收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,中信保诚中证 500 指数 (LOF) A 份额净值增长率为 25.88%,同期业绩比较基准收益率为 14.83%;中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 份额净值增长率为 4.19%,同期业绩比较基准收益率为 2.76%。

## 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,全球后疫情时代逐步到来,随着美联储量化宽松政策的退出,海外经济复苏力度可能逐渐减弱,同时全球金融市场的流动性也将受到一定制约。国内方面,去年底中央经济工作会议定调经济发展面临需求收缩、供给冲击和预期转弱三重压力,对经济形势判断较为严峻,强调积极的财政政策和灵活适度的货币政策。

疫情影响对国内制造业带来的红利正逐步减弱,2022 年国内经济面临较大下行压力。年初以来

逆周期调控预期持续升温，市场面临增长动能放缓和稳增长政策预期的博弈，叠加海外流动性收紧的压力，年内 A 股市场整体波动可能仍然较大，市场风格更趋于均衡。A 股市场经过年初的调整，各行业板块估值有不同程度的回落，总体来看 A 股市场目前估值水平处于合理区间。长期来看，中国经济发展模式从高增长转变为高质量发展，居民资产配置也将从以房地产为主逐步转向资本市场，A 股具备长期配置价值和投资机会。

#### 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，本基金管理人严格遵循和落实行业法规及监管要求，将保护基金份额持有人的合法权益放在首位，继续致力于完善公司内部控制机制与合规管理体系，持续加强业务风险控制与防范，有效保障公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人根据监管要求，结合公司业务发展实际情况推进公司内控制度建设，完善公司内控制度体系；对产品合同及各类法律文书进行审核；对基金募集、投资过程进行合规检查与提示，规范公司运作与所管理的各类投资组合运作过程中的关联交易，防范不正当关联交易和利益输送，防范内幕交易和利用未公开信息交易，切实维护基金份额持有人、股东和本公司的合法权益；完成各项法定信息披露工作及文档合规检查；根据审计工作计划开展内部审计工作和外部审计、检查的配合协调工作；开展合规培训、法规咨询、更新法规汇编；根据监管部门要求完成各项反洗钱工作，贯彻落实反洗钱监管要求；依法依规完成向监管部门的各项数据报送工作等。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、审慎勤勉的原则管理和运用基金资产，继续加强公司内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设置了估值决策委员会，负责组织制定适当的估值政策和程序，并定期进行评估，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值决策委员会包括下列成员：分管基金运营业务的领导、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管。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。会计师事务所对管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。基金经理不参与估值的具体流程，但若认为存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值决策委员会报告并提出相关意见和建议。

在每个估值日, 本基金管理人使用估值政策确定的估值方法, 确定证券投资基金的份额净值, 托管人复核无误后, 由基金管理人对外公布。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议, 由其按合同约定提供相关投资品种的估值相关数据服务。

#### 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进行过利润分配。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

#### 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 20 个工作日基金资产净值低于五千万元 (基金份额持有人数量不满二百人) 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, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内, 本基金未实施利润分配。

#### 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。

### § 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



报告编号	毕马威华振审字第 2200312 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	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (以下简称“中信保诚中证 500 指数基金”) 财务报表, 包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2021 年 1 月 1 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益 (基金净值) 变动表以及财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 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”) 和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了中信保诚中证 500 指数基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2021 年 1 月 1 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果及基金净值变动情况。</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 (以下简称“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, 我们独立于中信保诚中证 500 指数基金, 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	-
其他事项	-
其他信息	<p>中信保诚中证 500 指数基金管理人中信保诚基金管理有限公司 (以下简称“基金管理人”) 对其他信息负责。其他信息包括中信保诚中证 500 指数基金 2021 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</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>基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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</p>

	<p>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中信保诚中证 500 指数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，除非中信保诚中证 500 指数基金计划进行清算、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中信保诚中证 500 指数基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价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>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信保诚中证 500 指数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中信保诚中证 500 指数基金不能持续经营。</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>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>虞京京、 侯雯</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼八层</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2022 年 03 月 28 日</p>

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

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
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	19,401,152.00
结算备付金		1,992,545.68
存出保证金		715,177.60
交易性金融资产	7.4.7.2	258,256,075.29
其中：股票投资		258,235,075.29
基金投资		-
债券投资		21,000.00
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		71,116.17
应收利息	7.4.7.5	2,272.15
应收股利		-
应收申购款		1,126,512.00
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		281,564,850.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		6.05
应付赎回款		2,392,712.33
应付管理人报酬		224,382.16
应付托管费		49,364.07
应付销售服务费		9,732.00
应付交易费用	7.4.7.7	128,045.71
应交税费		14,735.73
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	364,960.27
负债合计		3,183,938.32
<b>所有者权益:</b>		-
实收基金	7.4.7.9	115,300,499.68
未分配利润	7.4.7.10	163,080,412.89
所有者权益合计		278,380,912.57
负债和所有者权益总计		281,564,850.89

注：1、截止本报告期末，基金份额总额 148,445,357.83 份。下属分级基金：中信保诚中证 500 指数 (LOF) A 的基金份额净值 1.8756 元，基金份额总额 127,597,582.52 份；中信保诚中证 500 指数 (LOF) C 的基金份额净值 1.8735 元，基金份额总额 20,847,775.31 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2021 年 01 月 01 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间，无上年度末或上年度可比期间数据。

## 7.2 利润表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

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

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		51,120,420.71
1. 利息收入		67,257.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	67,205.44
债券利息收入		51.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		53,508,511.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	50,123,813.57
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	57,878.58
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	649,902.91
股利收益	7.4.7.15	2,676,916.80
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-2,745,544.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	290,196.17

<b>减：二、费用</b>		3,814,711.91
1. 管理人报酬		2,088,830.96
2. 托管费		459,542.68
3. 销售服务费		19,499.58
4. 交易费用	7.4.7.18	774,241.95
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		2,339.72
7. 其他费用	7.4.7.19	470,257.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		47,305,708.80
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		47,305,708.80

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)

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

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配 利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	103,568,999.92	95,095,997.31	198,664,997.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 （本期利润）	-	47,305,708.80	47,305,708.80
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）	11,731,499.76	20,678,706.78	32,410,206.54
其中：1. 基金申购款	156,846,805.15	195,174,318.62	352,021,123.77
2. 基金赎回款	-145,115,305.39	-174,495,611.84	-319,610,917.23
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）	115,300,499.68	163,080,412.89	278,380,912.57

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：

张翔燕

陈逸辛

刘卓

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

中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (原“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”) (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”) 《关于核准信诚中证 500 指

数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2010]1877号文)批准,由中信保诚基金管理有限公司(原“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》发售,基金合同于 2011 年 2 月 11 日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集资金总额人民币 374,254,300.10 元。上述募集资金已由会计师事务所验证,并出具了验资报告。根据《信诚中证 500 指数分级证券投资基金之 A 类份额和 B 类份额终止运作、终止上市并修改基金合同的公告》和《关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金名称变更的公告》,本基金于 2020 年 12 月 31 日终止分级运作,《信诚中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》失效。基金管理人以 2020 年 12 月 31 日为基金份额折算基准日,对在该日登记在册的信诚中证 500A 份额和信诚中证 500B 份额办理向场内信诚中证 500 份额折算。于 2021 年 1 月 1 日,《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》生效,基金名称由“信诚中证 500 指数分级证券投资基金”变更为“中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF)”,取消分级机制,基金规模为 133,346,991.28 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据基金管理人中信保诚基金管理有限公司 2021 年 08 月 26 日《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》的规定,经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致并报中国证监会备案,自 2021 年 08 月 26 日起本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同,将本基金的基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用,不计提销售服务费;C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费,不收取申购费用。在本基金的基金份额分类实施后,本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同》和《中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书》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,包括中证 500 指数的成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。其中,中证 500 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 90%,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的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等,权证投资占基金资产净值的比例为 0-3%,其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较

基准为： $95\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人中信保诚基金管理有限公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 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,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的,把金融资产和金融负债分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资和债券投资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。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。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时,于资产负债表内确认。

在初始确认时,金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。
- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。
- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值
- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金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；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的

净额确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税（如适用）后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费、销售服务费和指数使用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。

本基金的交易费用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊，则于发生时直接计入基金损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资。登记在证券登记结算系统的基金份额，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资。若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在注册登记系统的基金份额收益分配方式为现金分红。每一基金份额享有同等分配权。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政

部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作, 本基金适用的主要税项列示如下:

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入, 暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起, 在全国范围内全面推开营业税改征增值税(以下称营改增)试点, 建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人, 纳入试点范围, 由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日(含)以后, 资管产品管理人(以下称管理人)运营资管产品过程中发生的增值税应税行为, 以管理人为增值税纳税人, 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 日以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, 已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税; 对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税; 同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得, 由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起, 对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: 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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司

（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

（e）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。

（f）对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

（g）对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	19,401,152.00
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	19,401,152.00

##### 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	241,318,159.06	258,235,075.29	16,916,916.23
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,000.00	21,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	21,000.00	21,000.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	241,339,159.06	258,256,075.29	16,916,916.23

### 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			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,216,960.00	-	-	-
IC2206	4,216,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,216,960.00	-	-	-

注：1、按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计业务核算细则（试行）》及《企业会计准则—金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具—股指期货投资”与“证券清算款—股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具—股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

2、于本报告期末，本基金持有 3 手中证 500 股指期货 IC2206，合约市值为 4,288,680.00 元，公允价值变动为 71,720.00 元。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从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
应收活期存款利息	1,849.38
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	407.33

应收债券利息	2.44
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	13.00
合计	2,272.15

注：其他包括应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 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
交易所市场应付交易费用	128,045.71
银行间市场应付交易费用	-
合计	128,045.71

#### 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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,360.27
应付证券出借违约金	-
应付审计费	90,000.00
应付信息披露费	220,000.00
应付指数使用费	50,600.00
合计	364,960.27

#### 7.4.7.9 实收基金

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	133,346,991.28	103,568,999.92
本期申购	130,156,877.98	101,098,465.28
本期赎回 (以“-”号填列)	-135,906,286.74	-105,559,575.61

本期末	127,597,582.52	99,107,889.59
-----	----------------	---------------

中信保诚中证 500 指数 (LOF) C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	71,774,572.92	55,748,339.87
本期赎回 (以“-”号填列)	-50,926,797.61	-39,555,729.78
本期末	20,847,775.31	16,192,610.09

注：1、申购含红利再投 (如有)、转换入份额 (如有)，赎回含转换出份额 (如有)。

2、本基金本报告期末场内外基金份额如下：

单位：份

基金代码	基金名称	本报告期末	
		场内	场外
165511	中信保诚中证500指数 (LOF) A	17,229,573.00	110,368,009.52
013119	中信保诚中证500指数 (LOF) C	-	20,847,775.31

#### 7.4.7.10 未分配利润

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	65,050,934.10	30,045,063.21	95,095,997.31
本期利润	48,620,479.98	-1,516,328.74	47,104,151.24
本期基金份额交易产生的变动数	-1,050,272.37	-934,755.59	-1,985,027.96
其中：基金申购款	89,960,383.65	29,091,420.34	119,051,803.99
基金赎回款	-91,010,656.02	-30,026,175.93	-121,036,831.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,621,141.71	27,593,978.88	140,215,120.59

中信保诚中证 500 指数 (LOF) C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,430,773.47	-1,229,215.91	201,557.56
本期基金份额交易产生的变动数	16,925,492.47	5,738,242.27	22,663,734.74
其中：基金申购款	58,152,866.66	17,969,647.97	76,122,514.63
基金赎回款	-41,227,374.19	-12,231,405.70	-53,458,779.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,356,265.94	4,509,026.36	22,865,292.30

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期



	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	53,408.55
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	13,082.99
其他	713.90
合计	67,205.44

注：其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入。

#### 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 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	269,864,086.07
减：卖出股票成本总额	219,740,272.50
买卖股票差价收入	50,123,813.57

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 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01月01日至2021年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	362,229.05
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	304,300.00
减：应收利息总额	50.47
买卖债券差价收入	57,878.58

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益—买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.14.2 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

	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	649,902.91

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,676,916.80
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	2,676,916.80

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-2,745,119.00
-- 股票投资	-2,745,119.00
-- 债券投资	-
-- 资产支持证券投资	-
-- 基金投资	-
-- 贵金属投资	-
-- 其他	-
2. 衍生工具	-440.00
-- 权证投资	-
-- 期货投资	-440.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-14.35
合计	-2,745,544.65

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	288,581.45
转换费收入	1,614.72
合计	290,196.17

注：1、本基金的场内外赎回费率不高于 1.5%，随基金份额持有期限的增加而递减，赎回费不低于其总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费不低于其总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	773,808.79
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	433.16
合计	774,241.95

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
指数使用费	201,250.00
银行费用	3,957.02
账户维护费	-
基金上市费	55,000.00
其他	50.00
合计	470,257.02

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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
中信保诚基金管理有限公司(“中信保诚基金”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
中信信托有限责任公司	基金管理人的股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的股东
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司
中信保诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,088,830.96
其中：支付销售机构的客户维护费	736,244.17

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.00%/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 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	459,542.68

注：支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数

###### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内无支付给各关联方的销售服务费。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期未发生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。

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

本基金本报告期未发生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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期内及上年度可比期间基金管理人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

除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按基金合同公布的费率执行,本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行	19,401,152.00	53,408.55

注:本基金的活期银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

#### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 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01月11日	新发未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021年07月26日	2022年02月16日	锁定期股票	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年08月04日	2022年02月14日	锁定期股票	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年09月08日	2022年03月16日	锁定期股票	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年08月02日	2022年02月14日	锁定期股票	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021年06月23日	2022年01月05日	锁定期股票	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021年06月28日	2022年01月06日	锁定期股票	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021年06月28日	2022年01月06日	锁定期股票	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年07月06日	2022年01月24日	锁定期股票	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-

301026	浩通科技	2021年 07月08 日	2022年 01月17 日	锁定期 股票	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年 07月08 日	2022年 01月19 日	锁定期 股票	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年 07月12 日	2022年 01月20 日	锁定期 股票	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年 07月14 日	2022年 01月24 日	锁定期 股票	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301032	新柴股份	2021年 07月15 日	2022年 01月24 日	锁定期 股票	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年 07月15 日	2022年 01月26 日	锁定期 股票	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年 07月21 日	2022年 01月28 日	锁定期 股票	22.04	56.28	299	6,589.96	16,827.72	-
301036	双乐股份	2021年 07月21 日	2022年 02月16 日	锁定期 股票	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年 07月21 日	2022年 02月07 日	锁定期 股票	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年 07月22 日	2022年 02月07 日	锁定期 股票	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年 07月01 日	2022年 01月10 日	锁定期 股票	6.96	12.51	1,043	7,259.28	13,047.93	-
301040	中环海陆	2021年 07月26 日	2022年 02月07 日	锁定期 股票	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年 08月02 日	2022年 02月11 日	锁定期 股票	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年 08月10 日	2022年 02月17 日	锁定期 股票	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰	2021年	2022年	锁定期	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-

	重工	08月11日	02月28日	股票						
301049	超越科技	2021年08月17日	2022年02月24日	锁定期股票	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年08月17日	2022年02月24日	锁定期股票	60.64	234.74	114	6,912.96	26,760.36	-
301053	远信工业	2021年08月25日	2022年03月01日	锁定期股票	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年08月26日	2022年03月07日	锁定期股票	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫股份	2021年08月27日	2022年03月07日	锁定期股票	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年08月31日	2022年03月09日	锁定期股票	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301059	金三江	2021年09月03日	2022年03月14日	锁定期股票	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年09月06日	2022年03月14日	锁定期股票	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年09月07日	2022年03月14日	锁定期股票	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年09月09日	2022年03月24日	锁定期股票	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021年09月13日	2022年03月22日	锁定期股票	5.24	22.84	344	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021年09月16日	2022年03月28日	锁定期股票	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年09月16日	2022年03月28日	锁定期股票	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年09月22日	2022年03月29日	锁定期股票	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-



		日	日							
301073	君亭酒店	2021年 09月22 日	2022年 03月30 日	锁定期 股票	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年 09月30 日	2022年 04月14 日	锁定期 股票	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳 液压	2021年 10月11 日	2022年 04月19 日	锁定期 股票	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌 股份	2021年 10月13 日	2022年 04月20 日	锁定期 股票	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛 电气	2021年 10月14 日	2022年 04月27 日	锁定期 股票	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜 智能	2021年 10月13 日	2022年 04月21 日	锁定期 股票	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚 医疗	2021年 10月15 日	2022年 04月25 日	锁定期 股票	93.09	75.34	137	12,753.33	10,321.58	-
301088	戎美 股份	2021年 10月19 日	2022年 04月28 日	锁定期 股票	33.16	24.67	231	7,659.96	5,698.77	-
301089	拓新 药业	2021年 10月20 日	2022年 04月27 日	锁定期 股票	19.11	67.93	204	3,898.44	13,857.72	-
301090	华润 材料	2021年 10月19 日	2022年 04月26 日	锁定期 股票	10.45	11.22	928	9,697.60	10,412.16	-
301091	深城 交	2021年 10月20 日	2022年 04月29 日	锁定期 股票	36.50	31.31	271	9,891.50	8,485.01	-
301092	争光 股份	2021年 10月21 日	2022年 05月05 日	锁定期 股票	36.31	35.52	183	6,644.73	6,500.16	-
301093	华兰 股份	2021年 10月21 日	2022年 05月05 日	锁定期 股票	58.08	49.85	135	7,840.80	6,729.75	-
301096	百诚 医药	2021年 12月13 日	2022年 06月20 日	锁定期 股票	79.60	78.53	82	6,527.20	6,439.46	-

301098	金埔园林	2021年11月04日	2022年05月12日	锁定期股票	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年05月23日	锁定期股票	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年06月17日	锁定期股票	27.81	31.14	303	8,426.43	9,435.42	-
301101	明月镜片	2021年12月09日	2022年06月16日	锁定期股票	26.91	43.36	311	8,369.01	13,484.96	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年06月06日	锁定期股票	57.27	53.71	115	6,586.05	6,176.65	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年06月07日	锁定期股票	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021年11月09日	2022年05月18日	锁定期股票	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年06月07日	锁定期股票	12.37	19.23	658	8,139.46	12,653.34	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年06月30日	锁定期股票	12.03	17.12	934	11,236.02	15,990.08	-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年05月26日	锁定期股票	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年01月11日	新发未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021年12月08日	2022年06月15日	锁定期股票	26.17	44.86	266	6,961.22	11,932.76	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年05月24日	锁定期股票	60.66	96.75	217	13,163.22	20,994.75	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年06月28日	锁定期股票	86.06	94.50	106	9,122.36	10,017.00	-
301168	通灵	2021年	2022年	锁定期	39.08	52.13	191	7,464.28	9,956.83	-

	股份	12月02日	06月10日	股票						
301177	迪阿股份	2021年12月08日	2022年06月15日	锁定期股票	116.88	116.08	126	14,726.88	14,626.08	-
301179	泽宇智能	2021年12月01日	2022年06月08日	锁定期股票	43.99	50.77	128	5,630.72	6,498.56	-
301180	万祥科技	2021年11月09日	2022年05月16日	锁定期股票	12.20	22.72	645	7,869.00	14,654.40	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年06月23日	锁定期股票	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年06月28日	锁定期股票	66.18	56.62	155	10,257.90	8,776.10	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年06月24日	锁定期股票	27.85	27.46	271	7,547.35	7,441.66	-
301193	家联科技	2021年12月02日	2022年06月09日	锁定期股票	30.73	29.14	228	7,006.44	6,643.92	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年06月02日	锁定期股票	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年06月07日	锁定期股票	29.28	32.00	245	7,173.60	7,840.00	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年06月22日	锁定期股票	69.89	88.72	132	9,225.48	11,711.04	-
688082	盛美上海	2021年11月10日	2022年05月18日	锁定期股票	85.00	114.28	1,401	119,085.00	160,106.28	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年01月07日	新发未上市	22.98	22.98	10,040	230,719.20	230,719.20	-
688227	品高股份	2021年12月23日	2022年06月30日	锁定期股票	37.09	30.76	3,071	113,903.39	94,463.96	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年01月06日	新发未上市	41.98	41.98	2,443	102,557.14	102,557.14	-

688296	和达科技	2021年07月19日	2022年01月27日	锁定期股票	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688737	中自科技	2021年10月14日	2022年04月22日	锁定期股票	70.90	55.06	971	68,843.90	53,463.26	-
688800	瑞可达	2021年07月14日	2022年01月24日	锁定期股票	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	-

#### 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
110084	贵燃转债	2021年12月27日	2022年01月18日	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.00	-
113634	珀莱转债	2021年12月08日	2022年01月04日	新债未上市	100.00	100.00	140	14,000.00	14,000.00	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，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，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021年12月20日	拟筹划重大资产重组	30.12	2022年01月04日	31.00	16,400	502,885.78	493,968.00	-

注：本基金本报告期末持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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，通过可靠的管理及信息系统进行持续监控。

公司风险管理组织体系包括董事会（及其下设的审计与风控委员会）、管理层（及其下设的经营层面风险管理委员会）及公司各业务部门层面。董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略等等。董事会下设审计与风控委员会，根据董事会的授权履行相应的风险管理和监督职责。公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，确保风险管理制度全面、有效执行；批准重大事件、重大决策的风险评估意见和重大风险的解决方案等等。管理层下设经营层面风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和各业务单元开展风险管理工作；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大事件、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案等等。各业务部门负责执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理的有效性负责，并及时、准确、全面、客观地将本部门的风险信息 and 监测情况向管理层报告。同时，公司设立独立于业务体系汇报路径的风险管理部和监察稽核部，协调并与各业务部门共同配合完成公司整体风险管理工作。风险管理部和监察稽核部日常向督察长汇报工作。

### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管银行, 本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外, 本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程, 审慎进行债券投资, 通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末未持有短期债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有短期资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有短期同业存单投资。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位: 人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	21,000.00
未评级	-
合计	21,000.00

注: 以上评级取自第三方评级机构的债项评级, 未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末未持有长期资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末未持有长期同业存单投资。

#### 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,另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。

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。针对资产变现流动性风险,本基金管理人严格控制受限资产的投资限额,并及时追踪持仓证券的流动性情况,综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末所持有的全部金融负债无固定到期日或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 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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得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前述比例限制。)

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%。本报告期末,本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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。本报告期末, 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。

本报告期末, 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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金持有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。

##### 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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,401,152.00	-	-	-	-	-	19,401,152.00
结算备付金	1,992,545.68	-	-	-	-	-	1,992,545.68



存出保证金	28,988.80	-	-	-	-	686,188.80	715,177.60
交易性金融资产	-	-	-	-	21,000.00	258,235,075.29	258,256,075.29
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	71,116.17	71,116.17
应收利息	-	-	-	-	-	2,272.15	2,272.15
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,126,512.00	1,126,512.00
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	21,422,686.48	-	-	-	21,000.00	260,121,164.41	281,564,850.89
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	6.05	6.05
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,392,712.33	2,392,712.33
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	224,382.16	224,382.16
应付托管费	-	-	-	-	-	49,364.07	49,364.07
应付销售服务费	-	-	-	-	-	9,732.00	9,732.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	128,045.71	128,045.71
应交税费	-	-	-	-	-	14,735.73	14,735.73
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	364,960.27	364,960.27
负债总计	-	-	-	-	-	3,183,938.32	3,183,938.32
利率敏感度缺口	21,422,686.48	-	-	-	21,000.00	256,937,226.09	278,380,912.57

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，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进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末, 本基金持有对利率敏感的金融资产与负债的比例较低。因此市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。本基金合同自 2021 年 01 月 01 日起生效, 无上年度末数据。

#### 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

其他价格风险主要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。本基金的其他价格风险, 主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响, 由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票, 因此存在相应的其他价格风险。

##### 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	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	258,235,075.29	92.76
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	258,235,075.29	92.76

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	除业绩比较基准中的股票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)
业绩比较基准中的股票指数上升 5%	13,063,863.07
业绩比较基准中的股票指数下降 5%	-13,063,863.07

#### 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) 以公允价值计量的资产和负债

如下列示了本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于本报告期末，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 255,863,602.91 元，属于第二层次的余额为 929,198.27 元，属于第三层次的余额为 1,463,274.11 元

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 第三层次的公允价值计量

于 2021 年 12 月 31 日，本基金采用第三层次估值的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 1,463,274.11 元。于 2021 年度，本基金购买第三层次金融工具 759,648.53 元，计入当期损益的利得或损失（均计入利润表中的公允价值变动损益项目）的金额为 703,625.58 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 703,625.58 元。

本基金管理人制定了相关流程来确定持续的第三层次公允价值计量中合适的估值技术和输入值。本基金管理人定期复核相关流程以及公允价值确定的合适性。

第三层次公允价值计量的量化信息如下：

于 2021 年 12 月 31 日，上述第三层次金融工具公允价值为 1,463,274.11 元，估值技术为平均价格亚式期权模型，不可观察输入值为预期年化波动率，对公允价值影响为预期年化波动率越高，

公允价值越低。

2021 年, 上述持续和非持续第三层次公允价值计量的资产和负债的公允价值的估值技术并未发生变更。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

(2) 其他金融工具的公允价值 (期末非以公允价值计量的项目)

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、卖出回购金融资产、应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

(3) 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《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。本基金将按照新金融工具准则的衔接规定, 对新金融工具准则施行日(即 2022 年 1 月 1 日)未终止确认的金融工具的分类和计量(含减值)进行追溯调整。本基金将不调整比较财务报表数据, 将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益或其他综合收益。

## § 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	258,235,075.29	91.71
	其中: 股票	258,235,075.29	91.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,000.00	0.01
	其中: 债券	21,000.00	0.01
	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	21,393,697.68	7.60
8	其他各项资产	1,915,077.92	0.68
9	合计	281,564,850.89	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	1,963,097.32	0.71
B	采矿业	9,944,342.78	3.57
C	制造业	155,491,816.22	55.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,645,311.30	3.46
E	建筑业	4,887,615.60	1.76
F	批发和零售业	7,934,206.03	2.85
G	交通运输、仓储和邮政业	6,034,555.91	2.17
H	住宿和餐饮业	1,522,758.00	0.55
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,986,965.44	7.90
J	金融业	18,516,793.96	6.65
K	房地产业	6,392,752.40	2.30
L	租赁和商务服务业	3,152,705.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	909,841.00	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	2,205,715.99	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	537,120.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	3,323,249.56	1.19
S	综合	1,856,142.00	0.67
	合计	256,304,988.51	92.07

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,292,231.69	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	90,429.39	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
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	323,163.61	0.12
J	金融业	-	-

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	114,724.09	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	37,341.79	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	18,161.78	0.01
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.01
S	综合	-	-
	合计	1,930,086.78	0.69

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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	002340	格林美	175,900	1,820,565.00	0.65
2	600522	中天科技	97,800	1,658,688.00	0.60
3	000733	振华科技	13,300	1,652,924.00	0.59
4	000723	美锦能源	94,200	1,528,866.00	0.55
5	601615	明阳智能	57,400	1,498,140.00	0.54
6	600157	永泰能源	816,900	1,486,758.00	0.53
7	600399	抚顺特钢	57,900	1,434,183.00	0.52
8	600885	宏发股份	19,200	1,433,088.00	0.51
9	600884	杉杉股份	42,635	1,397,148.95	0.50
10	000009	中国宝安	94,600	1,365,078.00	0.49
11	002384	东山精密	50,200	1,360,420.00	0.49
12	601117	中国化学	112,100	1,345,200.00	0.48
13	601555	东吴证券	148,430	1,315,089.80	0.47
14	002013	中航机电	71,300	1,296,234.00	0.47
15	002385	大北农	121,600	1,275,584.00	0.46
16	300285	国瓷材料	29,500	1,255,815.00	0.45
17	002180	纳思达	25,900	1,236,984.00	0.44
18	300751	迈为股份	1,900	1,220,370.00	0.44
19	002268	卫士通	21,800	1,219,492.00	0.44
20	605358	立昂微	10,100	1,212,101.00	0.44
21	300037	新宙邦	10,600	1,197,800.00	0.43
22	300088	长信科技	90,100	1,196,528.00	0.43

23	600765	中航重机	23,200	1,171,368.00	0.42
24	688099	晶晨股份	8,986	1,169,977.20	0.42
25	600563	法拉电子	5,000	1,162,000.00	0.42
26	688005	容百科技	9,900	1,144,242.00	0.41
27	600298	安琪酵母	18,400	1,110,624.00	0.40
28	002028	思源电气	22,500	1,107,225.00	0.40
29	600256	广汇能源	168,600	1,102,644.00	0.40
30	600862	中航高科	30,700	1,097,832.00	0.39
31	600141	兴发集团	28,600	1,083,368.00	0.39
32	300363	博腾股份	12,000	1,073,400.00	0.39
33	300253	卫宁健康	62,900	1,054,204.00	0.38
34	600487	亨通光电	69,300	1,047,816.00	0.38
35	002185	华天科技	82,300	1,046,033.00	0.38
36	603456	九洲药业	18,400	1,035,184.00	0.37
37	000988	华工科技	36,900	1,028,034.00	0.37
38	601636	旗滨集团	59,300	1,014,030.00	0.36
39	600392	盛和资源	51,500	1,010,430.00	0.36
40	600754	锦江酒店	16,800	984,480.00	0.35
41	300058	蓝色光标	91,400	980,722.00	0.35
42	600418	江淮汽车	56,100	976,140.00	0.35
43	300699	光威复材	11,400	963,072.00	0.35
44	603613	国联股份	8,900	956,750.00	0.34
45	300223	北京君正	7,100	951,400.00	0.34
46	601168	西部矿业	69,900	951,339.00	0.34
47	000630	铜陵有色	270,400	940,992.00	0.34
48	603589	口子窖	13,200	935,484.00	0.34
49	603267	鸿远电子	5,100	915,144.00	0.33
50	600516	方大炭素	83,800	906,716.00	0.33
51	002138	顺络电子	23,700	904,866.00	0.33
52	002797	第一创业	123,300	902,556.00	0.32
53	300136	信维通信	35,500	898,860.00	0.32
54	600486	扬农化工	6,800	892,160.00	0.32
55	300724	捷佳伟创	7,700	880,110.00	0.32
56	300308	中际旭创	20,600	875,500.00	0.31
57	601077	渝农商行	227,100	874,335.00	0.31
58	600875	东方电气	40,800	873,936.00	0.31
59	600038	中直股份	10,800	867,240.00	0.31
60	000728	国元证券	112,100	863,170.00	0.31
61	601689	拓普集团	16,160	856,480.00	0.31
62	002409	雅克科技	10,500	852,285.00	0.31
63	688536	思瑞浦	1,100	844,800.00	0.30

64	002353	杰瑞股份	21,100	844,000.00	0.30
65	300146	汤臣倍健	31,200	841,152.00	0.30
66	600233	圆通速递	50,400	840,672.00	0.30
67	002080	中材科技	24,700	840,294.00	0.30
68	002223	鱼跃医疗	22,150	837,270.00	0.30
69	300474	景嘉微	5,500	837,100.00	0.30
70	603893	瑞芯微	6,100	835,090.00	0.30
71	002212	天融信	43,500	833,895.00	0.30
72	300763	锦浪科技	3,600	833,580.00	0.30
73	688065	凯赛生物	4,500	829,260.00	0.30
74	000519	中兵红箭	30,700	818,769.00	0.29
75	300418	昆仑万维	35,100	812,565.00	0.29
76	002673	西部证券	98,400	794,088.00	0.29
77	600733	北汽蓝谷	78,600	787,572.00	0.28
78	000547	航天发展	47,100	786,570.00	0.28
79	000636	风华高科	26,300	783,740.00	0.28
80	002439	启明星辰	27,400	781,722.00	0.28
81	600482	中国动力	39,600	780,120.00	0.28
82	600705	中航产融	196,400	779,708.00	0.28
83	688208	道通科技	9,794	777,643.60	0.28
84	000932	华菱钢铁	152,100	777,231.00	0.28
85	000039	中集集团	45,080	773,572.80	0.28
86	603077	和邦生物	226,800	773,388.00	0.28
87	600699	均胜电子	35,160	772,465.20	0.28
88	603605	珀莱雅	3,700	770,747.00	0.28
89	600188	兖矿能源	32,700	769,431.00	0.28
90	002444	巨星科技	25,200	768,852.00	0.28
91	600529	山东药玻	17,500	768,250.00	0.28
92	600739	辽宁成大	39,300	767,136.00	0.28
93	688002	睿创微纳	9,750	766,057.50	0.28
94	300296	利亚德	74,600	764,650.00	0.27
95	000739	普洛药业	21,682	760,821.38	0.27
96	002507	涪陵榨菜	19,600	740,880.00	0.27
97	002465	海格通信	67,600	738,192.00	0.27
98	000738	航发控制	24,200	732,776.00	0.26
99	600988	赤峰黄金	48,800	727,120.00	0.26
100	603290	斯达半导	1,900	723,900.00	0.26
101	002030	达安基因	36,060	723,363.60	0.26
102	601016	节能风电	110,400	718,704.00	0.26
103	000960	锡业股份	36,756	717,844.68	0.26
104	000807	云铝股份	63,800	712,646.00	0.26



105	600521	华海药业	32,900	712,614.00	0.26
106	600637	东方明珠	75,200	710,640.00	0.26
107	002273	水晶光电	40,840	710,207.60	0.26
108	600549	厦门钨业	31,200	706,056.00	0.25
109	688521	芯原股份	9,100	703,976.00	0.25
110	600177	雅戈尔	101,900	702,091.00	0.25
111	600732	爱旭股份	29,900	698,464.00	0.25
112	601198	东兴证券	59,300	689,659.00	0.25
113	002557	洽洽食品	11,200	687,232.00	0.25
114	603127	昭衍新药	5,900	681,037.00	0.24
115	002078	太阳纸业	59,200	680,208.00	0.24
116	002985	北摩高科	5,630	678,189.80	0.24
117	600704	物产中大	114,400	677,248.00	0.24
118	600201	生物股份	41,300	675,255.00	0.24
119	603444	吉比特	1,600	674,960.00	0.24
120	300383	光环新网	45,300	672,252.00	0.24
121	601128	常熟银行	100,600	664,966.00	0.24
122	300357	我武生物	11,600	664,680.00	0.24
123	600642	申能股份	90,100	664,037.00	0.24
124	002156	通富微电	34,100	662,563.00	0.24
125	002299	圣农发展	27,400	662,258.00	0.24
126	600879	航天电子	79,800	657,552.00	0.24
127	600497	驰宏锌锗	130,800	652,692.00	0.23
128	600369	西南证券	121,900	644,851.00	0.23
129	600027	华电国际	119,900	641,465.00	0.23
130	300618	寒锐钴业	8,000	641,440.00	0.23
131	600160	巨化股份	49,570	639,948.70	0.23
132	000830	鲁西化工	41,900	639,394.00	0.23
133	600372	中航电子	28,300	633,637.00	0.23
134	600039	四川路桥	52,600	633,304.00	0.23
135	002739	万达电影	40,900	633,132.00	0.23
136	002092	中泰化学	66,200	631,548.00	0.23
137	000623	吉林敖东	34,100	629,827.00	0.23
138	002508	老板电器	17,400	626,748.00	0.23
139	000983	山西焦煤	75,150	621,490.50	0.22
140	600580	卧龙电驱	33,800	618,202.00	0.22
141	600316	洪都航空	15,800	617,148.00	0.22
142	000629	攀钢钒钛	157,600	613,064.00	0.22
143	300115	长盈精密	30,860	612,262.40	0.22
144	601997	贵阳银行	93,900	611,289.00	0.22
145	603198	迎驾贡酒	8,800	611,160.00	0.22

146	002249	大洋电机	69,400	610,026.00	0.22
147	002131	利欧股份	247,800	609,588.00	0.22
148	002373	千方科技	40,600	606,970.00	0.22
149	300017	网宿科技	89,800	600,762.00	0.22
150	002603	以岭药业	30,620	600,152.00	0.22
151	002936	郑州银行	188,691	596,263.56	0.21
152	002422	科伦药业	31,400	594,402.00	0.21
153	600118	中国卫星	21,700	589,155.00	0.21
154	000825	太钢不锈	83,600	588,544.00	0.21
155	600170	上海建工	163,300	587,880.00	0.21
156	000050	深天马 A	45,100	587,202.00	0.21
157	000887	中鼎股份	26,900	586,689.00	0.21
158	603218	日月股份	17,800	586,510.00	0.21
159	600166	福田汽车	168,900	581,016.00	0.21
160	000400	许继电气	22,200	579,420.00	0.21
161	300070	碧水源	80,200	576,638.00	0.21
162	000750	国海证券	139,850	574,783.50	0.21
163	600803	新奥股份	31,300	574,668.00	0.21
164	002506	协鑫集成	150,700	572,660.00	0.21
165	600867	通化东宝	52,200	572,112.00	0.21
166	002191	劲嘉股份	37,800	571,914.00	0.21
167	600153	建发股份	63,000	571,410.00	0.21
168	002372	伟星新材	23,420	569,574.40	0.20
169	300001	特锐德	22,900	569,523.00	0.20
170	002926	华西证券	57,800	569,330.00	0.20
171	300168	万达信息	43,600	567,672.00	0.20
172	603707	健友股份	13,470	565,740.00	0.20
173	000027	深圳能源	69,780	565,218.00	0.20
174	002056	横店东磁	29,800	562,326.00	0.20
175	600859	王府井	20,800	561,600.00	0.20
176	002266	浙富控股	78,800	561,056.00	0.20
177	600909	华安证券	103,380	559,285.80	0.20
178	600236	桂冠电力	86,800	557,256.00	0.20
179	002002	鸿达兴业	91,500	554,490.00	0.20
180	300251	光线传媒	43,100	553,835.00	0.20
181	000513	丽珠集团	13,750	552,887.50	0.20
182	300009	安科生物	42,076	550,774.84	0.20
183	002065	东华软件	70,600	550,680.00	0.20
184	600008	首创环保	161,150	549,521.50	0.20
185	000997	新大陆	30,300	549,036.00	0.20
186	600066	宇通客车	49,800	548,796.00	0.20

187	600271	航天信息	40,800	546,312.00	0.20
188	000021	深科技	34,400	544,896.00	0.20
189	600536	中国软件	10,900	544,237.00	0.20
190	002152	广电运通	45,600	542,640.00	0.19
191	002408	齐翔腾达	51,500	540,750.00	0.19
192	600171	上海贝岭	21,000	538,860.00	0.19
193	600258	首旅酒店	20,600	538,278.00	0.19
194	002203	海亮股份	43,300	538,219.00	0.19
195	000975	银泰黄金	61,176	537,125.28	0.19
196	300244	迪安诊断	16,000	537,120.00	0.19
197	002221	东华能源	42,400	533,816.00	0.19
198	300630	普利制药	9,605	528,659.20	0.19
199	603156	养元饮品	18,600	528,426.00	0.19
200	600535	天士力	33,300	527,805.00	0.19
201	000656	金科股份	117,500	526,400.00	0.19
202	600348	华阳股份	44,100	522,585.00	0.19
203	002572	索菲亚	23,500	521,700.00	0.19
204	002500	山西证券	79,010	521,466.00	0.19
205	300026	红日药业	66,300	519,129.00	0.19
206	300212	易华录	14,680	518,938.00	0.19
207	601005	重庆钢铁	246,000	514,140.00	0.18
208	300024	机器人	45,800	511,586.00	0.18
209	600998	九州通	34,400	506,368.00	0.18
210	603568	伟明环保	13,833	505,319.49	0.18
211	600315	上海家化	12,500	505,125.00	0.18
212	000878	云南铜业	37,500	501,375.00	0.18
213	000012	南玻 A	50,390	500,372.70	0.18
214	002127	南极电商	72,200	498,180.00	0.18
215	000970	中科三环	31,028	497,999.40	0.18
216	601699	潞安环能	43,900	496,509.00	0.18
217	002745	木林森	32,700	494,751.00	0.18
218	000537	广宇发展	20,500	494,050.00	0.18
219	002683	广东宏大	16,400	493,968.00	0.18
220	603712	七一二	11,400	493,620.00	0.18
221	000999	华润三九	14,400	493,056.00	0.18
222	300315	掌趣科技	101,205	491,856.30	0.18
223	002195	二三四五	210,060	491,540.40	0.18
224	600673	东阳光	55,300	491,064.00	0.18
225	600415	小商品城	100,700	488,395.00	0.18
226	601872	招商轮船	119,000	487,900.00	0.18
227	002250	联化科技	27,100	486,987.00	0.17

228	600801	华新水泥	25,060	483,658.00	0.17
229	002511	中顺洁柔	28,858	482,217.18	0.17
230	002019	亿帆医药	27,200	479,264.00	0.17
231	300463	迈克生物	16,400	478,716.00	0.17
232	300182	捷成股份	75,600	478,548.00	0.17
233	601866	中远海发	145,800	473,850.00	0.17
234	000690	宝新能源	80,000	473,600.00	0.17
235	688006	杭可科技	4,400	473,352.00	0.17
236	002153	石基信息	16,400	471,336.00	0.17
237	600863	内蒙华电	119,400	470,436.00	0.17
238	600208	新湖中宝	157,800	470,244.00	0.17
239	600970	中材国际	40,700	465,201.00	0.17
240	002831	裕同科技	13,720	462,226.80	0.17
241	000060	中金岭南	93,900	461,049.00	0.17
242	600517	国网英大	63,100	459,999.00	0.17
243	000686	东北证券	51,600	453,048.00	0.16
244	601778	晶科科技	53,100	452,943.00	0.16
245	300482	万孚生物	11,460	451,294.80	0.16
246	600839	四川长虹	135,800	449,498.00	0.16
247	600380	健康元	35,000	449,400.00	0.16
248	002294	信立泰	16,400	448,048.00	0.16
249	600498	烽火通信	24,900	447,702.00	0.16
250	000930	中粮科技	41,100	446,757.00	0.16
251	002505	鹏都农牧	116,900	446,558.00	0.16
252	600155	华创阳安	44,700	445,212.00	0.16
253	002939	长城证券	34,200	442,890.00	0.16
253	603858	步长制药	21,000	442,890.00	0.16
255	600390	五矿资本	82,500	438,900.00	0.16
256	600511	国药股份	13,900	438,267.00	0.16
257	000729	燕京啤酒	51,700	437,899.00	0.16
258	600667	太极实业	54,100	437,128.00	0.16
259	002701	奥瑞金	62,400	436,800.00	0.16
260	000401	冀东水泥	36,400	435,344.00	0.16
261	600500	中化国际	50,830	435,104.80	0.16
262	600718	东软集团	32,000	433,920.00	0.16
263	601992	金隅集团	152,500	433,100.00	0.16
264	600728	佳都科技	51,600	429,828.00	0.15
265	600895	张江高科	28,400	427,704.00	0.15
266	600764	中国海防	10,500	426,930.00	0.15
267	002430	杭氧股份	14,200	426,142.00	0.15
268	300376	易事特	42,400	426,120.00	0.15

269	688029	南微医学	1,999	425,127.33	0.15
270	600216	浙江医药	24,800	423,584.00	0.15
271	600158	中体产业	28,000	423,360.00	0.15
272	002382	蓝帆医疗	25,900	421,911.00	0.15
273	002004	华邦健康	58,100	420,644.00	0.15
274	002128	电投能源	28,200	418,770.00	0.15
275	601179	中国西电	75,400	418,470.00	0.15
276	600282	南钢股份	113,000	418,100.00	0.15
277	002532	天山铝业	51,200	417,280.00	0.15
278	000598	兴蓉环境	65,900	416,488.00	0.15
279	002966	苏州银行	61,300	415,001.00	0.15
280	603225	新凤鸣	27,900	414,315.00	0.15
281	002368	太极股份	14,939	411,420.06	0.15
282	300072	三聚环保	51,800	410,774.00	0.15
283	002670	国盛金控	42,700	409,920.00	0.15
284	600985	淮北矿业	36,500	408,070.00	0.15
285	000540	中天金融	154,500	407,880.00	0.15
286	002174	游族网络	26,700	406,908.00	0.15
287	002396	星网锐捷	17,200	405,404.00	0.15
288	002595	豪迈科技	14,600	405,296.00	0.15
289	600528	中铁工业	49,000	402,290.00	0.14
290	000581	威孚高科	18,500	398,490.00	0.14
291	603866	桃李面包	14,020	398,168.00	0.14
292	600297	广汇汽车	149,100	398,097.00	0.14
293	002048	宁波华翔	18,400	397,992.00	0.14
294	603638	艾迪精密	12,380	395,169.60	0.14
295	600409	三友化工	45,400	394,980.00	0.14
296	002958	青农商行	101,900	393,334.00	0.14
297	002010	传化智联	45,200	393,240.00	0.14
298	600827	百联股份	29,500	393,235.00	0.14
299	600755	厦门国贸	54,500	392,945.00	0.14
300	601717	郑煤机	33,759	391,266.81	0.14
301	002925	盈趣科技	11,490	391,004.70	0.14
302	600567	山鹰国际	118,800	390,852.00	0.14
303	600060	海信视像	28,900	388,705.00	0.14
304	300271	华宇软件	30,500	387,350.00	0.14
305	688188	柏楚电子	1,000	385,460.00	0.14
306	603885	吉祥航空	21,700	385,175.00	0.14
307	600131	国网信通	17,600	384,560.00	0.14
308	000709	河钢股份	155,800	383,268.00	0.14
309	000778	新兴铸管	88,000	381,040.00	0.14

310	002183	怡亚通	57,300	379,326.00	0.14
311	002075	沙钢股份	64,900	378,367.00	0.14
312	600598	北大荒	25,912	377,278.72	0.14
313	000883	湖北能源	71,800	376,232.00	0.14
314	600325	华发股份	62,230	374,624.60	0.13
315	600967	内蒙一机	31,300	374,035.00	0.13
316	600820	隧道股份	69,400	373,372.00	0.13
317	600566	济川药业	13,100	371,254.00	0.13
318	002690	美亚光电	9,900	370,854.00	0.13
319	600782	新钢股份	70,200	370,656.00	0.13
320	600021	上海电力	28,900	370,498.00	0.13
321	600507	方大特钢	47,474	370,297.20	0.13
322	603883	老百姓	7,475	369,115.50	0.13
323	601456	国联证券	26,400	368,808.00	0.13
324	600597	光明乳业	25,300	367,356.00	0.13
325	600737	中粮糖业	39,000	366,600.00	0.13
326	000990	诚志股份	23,000	363,860.00	0.13
327	600022	山东钢铁	201,300	360,327.00	0.13
328	600707	彩虹股份	52,800	360,096.00	0.13
329	002434	万里扬	24,400	359,656.00	0.13
330	601880	辽港股份	207,700	359,321.00	0.13
331	000987	越秀金控	41,000	356,700.00	0.13
332	002281	光迅科技	15,300	356,337.00	0.13
333	603927	中科软	12,960	354,585.60	0.13
334	600663	陆家嘴	32,400	351,864.00	0.13
335	600435	北方导航	32,900	351,372.00	0.13
336	601106	中国一重	100,900	351,132.00	0.13
337	002124	天邦股份	54,140	348,661.60	0.13
338	002146	荣盛发展	79,900	347,565.00	0.12
339	601577	长沙银行	44,400	346,764.00	0.12
340	600446	金证股份	24,000	343,680.00	0.12
341	600572	康恩贝	68,700	343,500.00	0.12
342	603650	彤程新材	6,600	332,112.00	0.12
343	600259	广晟有色	6,700	329,908.00	0.12
344	601118	海南橡胶	62,400	329,472.00	0.12
345	002390	信邦制药	44,400	329,448.00	0.12
346	000877	天山股份	21,500	329,165.00	0.12
347	000898	鞍钢股份	87,600	328,500.00	0.12
348	600329	中新药业	10,400	326,664.00	0.12
349	688088	虹软科技	7,398	325,955.88	0.12
350	600811	东方集团	108,260	325,862.60	0.12

351	603228	景旺电子	9,412	324,996.36	0.12
352	002233	塔牌集团	30,700	324,806.00	0.12
353	000488	晨鸣纸业	44,600	322,904.00	0.12
354	002440	闰土股份	33,500	321,265.00	0.12
355	600808	马钢股份	87,000	321,030.00	0.12
356	002429	兆驰股份	66,000	320,760.00	0.12
356	300166	东方国信	29,700	320,760.00	0.12
358	002155	湖南黄金	30,900	320,124.00	0.11
359	001914	招商积余	15,600	316,056.00	0.11
360	688321	微芯生物	8,950	313,339.50	0.11
361	000559	万向钱潮	48,600	309,582.00	0.11
362	601200	上海环境	24,550	309,084.50	0.11
363	002416	爱施德	27,100	308,398.00	0.11
364	600037	歌华有线	35,500	308,140.00	0.11
365	600908	无锡银行	54,300	307,881.00	0.11
366	002085	万丰奥威	55,800	306,342.00	0.11
367	600373	中文传媒	24,700	305,292.00	0.11
368	600906	财达证券	23,900	304,964.00	0.11
369	002110	三钢闽光	44,650	303,620.00	0.11
370	600398	海澜之家	47,200	302,552.00	0.11
371	002705	新宝股份	12,200	301,340.00	0.11
372	600167	联美控股	33,380	300,753.80	0.11
373	600026	中远海能	50,500	298,960.00	0.11
374	601000	唐山港	108,000	297,000.00	0.11
375	600546	山煤国际	36,100	296,381.00	0.11
376	002081	金螳螂	48,700	296,096.00	0.11
377	600064	南京高科	31,500	294,210.00	0.11
378	601991	大唐发电	90,300	292,572.00	0.11
379	600195	中牧股份	22,207	290,245.49	0.10
380	000528	柳工	37,640	290,204.40	0.10
381	603000	人民网	20,100	289,842.00	0.10
382	000961	中南建设	69,900	289,386.00	0.10
383	601611	中国核建	28,900	288,133.00	0.10
384	002867	周大生	16,150	287,147.00	0.10
385	601718	际华集团	96,000	286,080.00	0.10
386	000685	中山公用	32,200	284,970.00	0.10
387	002038	双鹭药业	26,200	283,222.00	0.10
388	000158	常山北明	40,800	282,336.00	0.10
389	300133	华策影视	41,600	281,632.00	0.10
390	002387	维信诺	30,200	280,256.00	0.10
391	600120	浙江东方	63,279	279,693.18	0.10

392	000090	天健集团	47,580	279,294.60	0.10
393	000959	首钢股份	48,700	279,051.00	0.10
394	601333	广深铁路	123,600	276,864.00	0.10
395	000758	中色股份	50,200	274,092.00	0.10
396	000089	深圳机场	37,400	273,768.00	0.10
397	003022	联泓新科	7,400	269,656.00	0.10
398	600376	首开股份	47,000	266,020.00	0.10
399	600582	天地科技	60,300	264,114.00	0.09
400	000415	渤海租赁	90,100	262,191.00	0.09
401	000718	苏宁环球	55,300	260,463.00	0.09
402	002242	九阳股份	11,200	259,840.00	0.09
403	688289	圣湘生物	4,400	259,600.00	0.09
404	601598	中国外运	57,600	258,048.00	0.09
405	601975	招商南油	126,900	255,069.00	0.09
406	600062	华润双鹤	19,000	254,030.00	0.09
407	000967	盈峰环境	34,600	253,618.00	0.09
408	600126	杭钢股份	49,200	252,396.00	0.09
409	600307	酒钢宏兴	114,100	251,020.00	0.09
410	601098	中南传媒	26,208	250,810.56	0.09
411	000402	金融街	43,600	246,776.00	0.09
412	002458	益生股份	21,700	245,427.00	0.09
413	600556	天下秀	19,800	244,530.00	0.09
414	601958	金钼股份	35,300	241,805.00	0.09
415	001965	招商公路	31,500	241,605.00	0.09
416	600959	江苏有线	72,900	239,841.00	0.09
417	600643	爱建集团	35,462	239,723.12	0.09
418	002399	海普瑞	13,800	235,980.00	0.08
419	000563	陕国投 A	72,200	233,206.00	0.08
420	300257	开山股份	14,500	230,260.00	0.08
421	600056	中国医药	19,453	229,739.93	0.08
422	003035	南网能源	27,600	228,804.00	0.08
423	002563	森马服饰	29,400	227,262.00	0.08
424	601928	凤凰传媒	27,800	224,902.00	0.08
425	601860	紫金银行	66,700	223,445.00	0.08
426	600266	城建发展	49,284	221,778.00	0.08
427	600901	江苏租赁	43,500	221,415.00	0.08
428	600717	天津港	52,689	220,766.91	0.08
429	603317	天味食品	8,200	219,842.00	0.08
430	600968	海油发展	74,100	217,113.00	0.08
431	002815	崇达技术	12,800	215,680.00	0.08
432	300741	华宝股份	4,500	215,325.00	0.08



433	000937	冀中能源	38,600	212,686.00	0.08
434	002244	滨江集团	45,300	211,098.00	0.08
435	600095	湘财股份	20,800	210,496.00	0.08
436	000717	韶钢松山	44,100	209,475.00	0.08
437	600928	西安银行	48,600	208,980.00	0.08
438	002423	中粮资本	25,200	204,120.00	0.07
439	000028	国药一致	5,500	203,390.00	0.07
440	002468	申通快递	22,300	202,707.00	0.07
441	600787	中储股份	32,100	200,304.00	0.07
442	600776	东方通信	17,400	200,274.00	0.07
443	600006	东风汽车	29,100	198,171.00	0.07
444	000062	深圳华强	11,420	196,766.60	0.07
445	002424	贵州百灵	25,700	195,320.00	0.07
446	600729	重庆百货	7,400	192,548.00	0.07
447	600649	城投控股	46,100	189,471.00	0.07
448	600339	中油工程	61,000	187,880.00	0.07
449	600835	上海机电	11,800	187,856.00	0.07
450	600623	华谊集团	20,600	187,460.00	0.07
451	601139	深圳燃气	21,000	185,430.00	0.07
452	002375	亚厦股份	24,300	182,007.00	0.07
453	600648	外高桥	13,600	179,928.00	0.06
454	600299	安迪苏	14,600	179,872.00	0.06
455	300869	康泰医学	4,400	178,420.00	0.06
456	601969	海南矿业	14,700	176,547.00	0.06
457	000031	大悦城	47,000	175,310.00	0.06
458	000156	华数传媒	20,300	171,738.00	0.06
459	000869	张裕 A	5,000	159,300.00	0.06
460	002653	海思科	7,800	159,120.00	0.06
461	600871	石化油服	74,200	158,788.00	0.06
462	600639	浦东金桥	12,400	158,348.00	0.06
463	600377	宁沪高速	18,100	156,022.00	0.06
464	603379	三美股份	6,640	151,259.20	0.05
465	601828	美凯龙	17,100	150,651.00	0.05
466	601228	广州港	45,100	150,183.00	0.05
467	603708	家家悦	8,900	148,096.00	0.05
468	002302	西部建设	18,400	147,752.00	0.05
469	601869	长飞光纤	4,500	147,330.00	0.05
470	601298	青岛港	25,500	145,095.00	0.05
471	000046	泛海控股	75,700	142,316.00	0.05
472	601156	东航物流	6,400	140,032.00	0.05
473	001872	招商港口	8,200	138,990.00	0.05

474	002948	青岛银行	30,000	138,900.00	0.05
475	600823	世茂股份	41,000	134,480.00	0.05
476	000553	安道麦 A	15,900	134,196.00	0.05
477	002945	华林证券	9,800	133,868.00	0.05
478	603786	科博达	1,600	128,480.00	0.05
479	603355	莱克电气	4,260	124,903.20	0.04
480	001203	大中矿业	8,200	123,656.00	0.04
481	603719	良品铺子	2,900	123,163.00	0.04
482	601568	北元集团	14,500	117,885.00	0.04
483	600350	山东高速	22,800	117,648.00	0.04
484	600657	信达地产	31,200	116,376.00	0.04
485	603056	德邦股份	11,200	114,576.00	0.04
486	603515	欧普照明	5,450	113,142.00	0.04
487	600466	蓝光发展	55,220	112,648.80	0.04
488	601665	齐鲁银行	18,500	103,230.00	0.04
489	002946	新乳业	6,300	100,422.00	0.04
490	601003	柳钢股份	18,700	97,614.00	0.04
491	600917	重庆燃气	11,400	95,646.00	0.03
492	600956	新天绿能	5,100	87,771.00	0.03
493	002901	大博医疗	1,600	80,992.00	0.03
494	600903	贵州燃气	8,300	80,344.00	0.03
495	603868	飞科电器	1,800	78,156.00	0.03
496	601187	厦门银行	10,600	73,140.00	0.03
497	603983	丸美股份	1,900	60,553.00	0.02

### 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	688800	瑞可达	1,967	262,653.51	0.09
2	688176	亚虹医药	10,040	230,719.20	0.08
3	688082	盛美上海	1,401	160,106.28	0.06
4	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.04
5	688262	国芯科技	2,443	102,557.14	0.04
6	688227	品高股份	3,071	94,463.96	0.03
7	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.03
8	688737	中自科技	971	53,463.26	0.02
9	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
10	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
11	301050	雷电微力	114	26,760.36	0.01
12	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
13	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01

14	301155	海力风电	217	20,994.75	0.01
15	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
16	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
17	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
18	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
19	301035	润丰股份	299	16,827.72	0.01
20	301127	天源环保	934	15,990.08	0.01
21	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
22	301180	万祥科技	645	14,654.40	0.01
23	301177	迪阿股份	126	14,626.08	0.01
24	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
25	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
26	301089	拓新药业	204	13,857.72	0.00
27	301101	明月镜片	311	13,484.96	0.00
28	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
29	301039	中集车辆	1,043	13,047.93	0.00
30	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
31	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
32	301126	达嘉维康	658	12,653.34	0.00
33	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
34	301138	华研精机	266	11,932.76	0.00
35	301221	光庭信息	132	11,711.04	0.00
36	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
37	301090	华润材料	928	10,412.16	0.00
38	301087	可孚医疗	137	10,321.58	0.00
39	301166	优宁维	106	10,017.00	0.00
40	301168	通灵股份	191	9,956.83	0.00
41	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
42	301100	风光股份	303	9,435.42	0.00
43	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
44	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
45	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
46	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
47	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
48	301189	奥尼电子	155	8,776.10	0.00
49	301091	深城交	271	8,485.01	0.00
50	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
51	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
52	301199	迈赫股份	245	7,840.00	0.00
53	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
54	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00

55	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
56	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
57	301190	善水科技	271	7,441.66	0.00
58	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
59	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
60	301093	华兰股份	135	6,729.75	0.00
61	301193	家联科技	228	6,643.92	0.00
62	301092	争光股份	183	6,500.16	0.00
63	301179	泽宇智能	128	6,498.56	0.00
64	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
65	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
66	301096	百诚医药	82	6,439.46	0.00
67	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
68	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
69	301108	洁雅股份	115	6,176.65	0.00
70	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
71	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
72	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
73	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
74	301088	戎美股份	231	5,698.77	0.00
75	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
76	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
77	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
78	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
79	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
80	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
81	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
82	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
83	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
84	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
85	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
86	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
87	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000799	酒鬼酒	2,440,035.00	0.88
2	002340	格林美	1,803,958.46	0.65

3	600522	中天科技	1,752,129.00	0.63
4	002709	天赐材料	1,718,351.00	0.62
5	000733	振华科技	1,601,857.00	0.58
6	600157	永泰能源	1,573,900.00	0.57
7	600089	特变电工	1,529,274.00	0.55
8	601868	中国能建	1,521,450.00	0.55
9	000009	中国宝安	1,474,847.00	0.53
10	300037	新宙邦	1,428,848.00	0.51
11	601636	旗滨集团	1,424,162.00	0.51
12	605358	立昂微	1,387,224.00	0.50
13	300751	迈为股份	1,382,427.00	0.50
14	600399	抚顺特钢	1,378,418.00	0.50
15	002384	东山精密	1,328,864.00	0.48
16	601615	明阳智能	1,318,551.00	0.47
17	002074	国轩高科	1,297,969.00	0.47
18	300253	卫宁健康	1,285,623.00	0.46
19	601117	中国化学	1,254,160.00	0.45
20	601555	东吴证券	1,249,834.70	0.45

注：买入金额按成交金额(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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600089	特变电工	4,262,746.00	1.53
2	002709	天赐材料	3,626,797.96	1.30
3	300274	阳光电源	3,543,539.82	1.27
4	002074	国轩高科	3,373,898.00	1.21
5	300207	欣旺达	2,839,309.00	1.02
6	600460	士兰微	2,651,799.00	0.95
7	000799	酒鬼酒	2,342,114.00	0.84
8	300316	晶盛机电	2,256,934.00	0.81
9	603486	科沃斯	2,028,783.20	0.73
10	601233	桐昆股份	1,958,679.00	0.70
11	300012	华测检测	1,833,983.12	0.66
12	002625	光启技术	1,751,066.00	0.63
13	600426	华鲁恒升	1,746,637.70	0.63
14	600219	南山铝业	1,743,572.00	0.63
15	600779	水井坊	1,661,504.00	0.60
16	600132	重庆啤酒	1,594,672.82	0.57
17	300595	欧普康视	1,521,043.64	0.55
18	600143	金发科技	1,511,142.00	0.54

19	300496	中科创达	1,495,505.00	0.54
20	603882	金域医学	1,416,196.00	0.51

注：卖出金额按成交金额(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	296,277,091.99
卖出股票收入(成交)总额	269,864,086.07

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(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)	21,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,000.00	0.01

### 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	113634	珀莱转债	140	14,000.00	0.01
2	110084	贵燃转债	70	7,000.00	0.00

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2206	IC2206	3	4,288,680.00	71,720.00	-
公允价值变动总额合计					71,720.00
股指期货投资本期收益					649,902.91
股指期货投资本期公允价值变动					-427.18

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理，如预期大额申购赎回、大量分红等，以及对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险。

## 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

本基金投资范围不包括国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体本期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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体均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。

### 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中,没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

### 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	715,177.60
2	应收证券清算款	71,116.17
3	应收股利	-
4	应收利息	2,272.15
5	应收申购款	1,126,512.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,915,077.92

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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

#### 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

本基金本报告期末持有的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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688800	瑞可达	262,653.51	0.09	锁定期股票
2	688176	亚虹医药	230,719.20	0.08	新发未上市
3	688082	盛美上海	160,106.28	0.06	锁定期股票
4	688296	和达科技	107,932.91	0.04	锁定期股票
5	688262	国芯科技	102,557.14	0.04	新发未上市

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。



## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
中信保诚 中证 500 指 数 (LOF) A	45,882	2,780.99	6,874,406.16	5.39%	120,723,176.36	94.61%
中信保诚 中证 500 指 数 (LOF) C	1,963	10,620.36	15,019,062.45	72.04%	5,828,712.86	27.96%
合计	47,845	3,102.63	21,893,468.61	14.75%	126,551,889.22	85.25%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

中信保诚中证 500 指数 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	广州市广百股份有限公司	460,843.00	2.67%
2	杨胜华	414,335.00	2.40%
3	杨晓梅	364,750.00	2.12%
4	冯建强	231,239.00	1.34%
5	张兰芳	204,254.00	1.19%
6	孔一诺	202,381.00	1.17%
7	加建民	200,000.00	1.16%
8	邱玲利	196,951.00	1.14%
9	陈远明	190,717.00	1.11%
10	陈慧然	172,263.00	1.00%

### 9.3 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	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	86,108.45	0.07%
	中信保诚中证	-	-

	500 指数 (LOF) C		
	合计	86,108.45	0.06%

注：本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

#### 9.4 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	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	0~10
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放 式基金	中信保诚中证 500 指数 (LOF) A	0
	中信保诚中证 500 指数 (LOF) C	0
	合计	0

注：期末本基金的基金经理未持有本基金的基金份额。

#### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信保诚中证 500 指 数 (LOF) A	中信保诚中证 500 指 数 (LOF) C
基金合同生效日 (2021 年 01 月 01 日) 基金份额总额	133,346,991.28	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	130,156,877.98	71,774,572.92
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	135,906,286.74	50,926,797.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	127,597,582.52	20,847,775.31

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，自 2021 年 5 月 21 日起，胡喆女士、韩海平先生担任中信保诚基金管理有限公司（以下简称“公司”）副总经理职务；自 2021 年 10 月 21 日起，涂一锴先生担任公司董事长职务，张翔燕女士不再担任公司董事长职务并转任公司总经理职务，唐世春先生不再担任公司总经理职务并转任公司常务副总经理职务，公司法定代表人由张翔燕女士变更为涂一锴先生。上述变更事项已按监管要求公告并备案。

本报告期内基金托管人未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金就参与存托凭证投资事宜修订基金合同等法律文件，增加存托凭证的投资策略。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 90,000.00 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

### 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

报告期内基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	181,200,369.46	32.87%	128,678.01	30.90%	-

东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	11,131,631.01	2.02%	10,144.18	2.44%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	7,973,821.71	1.45%	5,831.19	1.40%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	3	49,574,115.50	8.99%	46,095.46	11.07%	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	151,054,642.65	27.40%	107,444.78	25.80%	-
金通证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	4	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	6,510,011.92	1.18%	4,760.91	1.14%	-

西南证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	2	6,240,234.94	1.13%	5,686.61	1.37%	-
野村东方 国际证券有 限公司	1	6,924,933.33	1.26%	4,925.91	1.18%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
中金公司	1	45,106,868.50	8.18%	42,008.17	10.09%	-
中泰证券	2	85,513,999.86	15.51%	60,826.04	14.61%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
中信山东	1	-	-	-	-	-
中信浙江	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

### 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		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东北证券	308,447.50	45.17%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	5,960.68	0.87%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	42,858.60	6.28%	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	125,700.00	18.41%	-	-	-	-	-	-
华西证券	138,390.27	20.26%	-	-	-	-	-	-
金通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
野村东方 国际证券有 限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	61,572.00	9.02%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信山东	-	-	-	-	-	-	-	-
中信浙江	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

## 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	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书	《中国证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 01 月 01 日
2	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要	同上	2021 年 01 月 01 日
3	关于信诚中证 500 指数分级证券投资基金之信诚中证 500 A 份额和信诚中证 500 B 份额基金份额折算结果的公告	同上	2021 年 01 月 05 日
4	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年第四季度报告	同上	2021 年 01 月 22 日
5	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第四季度报告提示性公告	同上	2021 年 01 月 22 日
6	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书	同上	2021 年 01 月 29 日
7	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金	同上	2021 年 02 月 03 日

	(LOF) 基金产品资料概要更新		日
8	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 上市交易提示性公告	同上	2021 年 02 月 03 日
9	信诚中证 500 指数分级证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021 年 03 月 26 日
10	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年年度报告提示性公告	同上	2021 年 03 月 26 日
11	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2021 年 03 月 31 日
12	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2021 年 03 月 31 日
13	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、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》修改法律文件的公告	同上	2021 年 03 月 31 日
14	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2021 年 04 月 02 日
15	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2021 年 04 月 02 日
16	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第一季度报告	同上	2021 年 04 月 21 日
17	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第一季度报告提示性公告	同上	2021 年 04 月 21 日
18	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金赎回费率优惠活动的公告	同上	2021 年 05 月 14 日
19	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金开展直销柜台基金申购费率优惠活动的公告	同上	2021 年 05 月 14 日
20	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 2 季度报告	同上	2021 年 07 月 20 日
21	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第二季度报告提示性公告	同上	2021 年 07 月 20 日
22	中信保诚基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	同上	2021 年 08 月 21 日
23	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	同上	2021 年 08 月 23 日
24	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同	同上	2021 年 08 月 25 日
25	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 托管协议	同上	2021 年 08 月 25 日
26	中信保诚基金管理有限公司关于旗下部	同上	2021 年 08 月 25



	分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告		日
27	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书	同上	2021 年 08 月 26 日
28	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2021 年 08 月 26 日
29	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2021 年 08 月 26 日
30	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年中期报告	同上	2021 年 08 月 27 日
31	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	同上	2021 年 08 月 27 日
32	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 2021 年第 3 季度报告	同上	2021 年 10 月 27 日
33	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第三季度报告提示性公告	同上	2021 年 10 月 27 日
34	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (A 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2021 年 12 月 17 日
35	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) (C 类份额) 基金产品资料概要更新	同上	2021 年 12 月 17 日
36	中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 更新招募说明书 (2021 年 12 月)	同上	2021 年 12 月 17 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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2021 年 3 月 31 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、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〉修改法律文件的公告》，本基金就投资范围增加存托凭证、增加侧袋机制、标的指数事项修订事项调整了基金合同、托管协议、招募说明书（更新）及基金产品资料概要。

本基金管理人于 2021 年 8 月 25 日发布了《中信保诚基金管理有限公司关于旗下部分基金增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并修改基金合同及托管协议的公告》，自 2021 年 8 月 26 日起，中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 增加 C 类基金份额、调整基金份额净值计算精度并对

基金合同、托管协议、招募说明书等相关法律文件进行修订。

2022 年 3 月 29 日, 本基金管理人收到中国证券监督管理委员会上海监管局处罚决定, 对公司未按照规定向投资者披露私募资产管理计划信息给予警告并处三万元罚款。基金管理人对此高度重视, 积极开展整改工作, 全面完善公司私募资产管理业务管理及其信息披露的制度体系和内控管理机制, 对具体问题进行深入整改。前述事项对基金份额持有人利益无不利影响。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、(原)信诚中证 500 指数分级证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 4、中信保诚中证 500 指数型证券投资基金 (LOF) 招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅, 也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅, 公司网址为 [www.citicprufunds.com.cn](http://www.citicprufunds.com.cn)。

中信保诚基金管理有限公司  
2022 年 03 月 31 日