

光大保德信红利混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十一日

§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。

基金托管人兴业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。

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	2
1.1 重要提示	2
§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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§6 审计报告	19
6.1 审计意见	19
6.2 形成审计意见的基础	20
6.3 其他信息	20
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	20
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	60
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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	68
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	68
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.12	本报告期投资基金情况	68
8.13	投资组合报告附注	68
§9	基金份额持有人信息	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	70
§10	开放式基金份额变动	70
§11	重大事件揭示	70
11.1	基金份额持有人大会决议	70
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	70
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4	基金投资策略的改变	70
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	71
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.9	其他重大事件	74
12	影响投资者决策的其他重要信息	75
§13	备查文件目录	75
13.1	备查文件目录	75
13.2	存放地点	76
13.3	查阅方式	76

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信红利混合型证券投资基金
基金简称	光大保德信红利混合
基金主代码	360005
交易代码	360005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 3 月 24 日
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	203,888,047.81 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对高分红类股票及存托凭证及其他具有投资价值的股票及存托凭证进行投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	<p>本基金为混合型基金，强调收益的当期实现与资产的长期增值。高分红类股票、存托凭证及其他具有投资价值的股票、存托凭证是本基金的主要投资对象。</p> <p>基金管理人将充分发挥自身的研究力量，利用公司研究开发的各种数量模型工具，采用科学的投资策略，发现和捕捉市场的机会，实现基金的投资目标。</p> <p>1、总体资产配置策略</p> <p>（1）基金经理在公司开发的多种数量工具支持下，结合市场中各项分析研究结果，对影响中国证券市场的相关因素进行归纳和总结，以求最大可能地预测未来市场的整体变化方向；</p> <p>（2）根据对市场变化预测的结果，对各子市场平均收益率进行分析和预测，如股票市场平均股息率、市净率、不同久期的国债收益率等，最终形成投资者的平均收益预期；</p>

(3) 在基金合同规定的范围内，根据上述研究分析结果，积极灵活地配置各战略资产的投资比例，同时及时跟踪和深度分析国家的各项政策，对可能出现的特别投资机会领先布局。

2、股票投资策略

(1) 行业配置策略

基金经理将通过树状集群评价体系对整体行业进行定性和定量的分析，评价体系包括短期因素指标和长期因素指标，这些指标中特别强调行业的盈利模式和盈利程度、盈利的可持续性、行业平均市盈率、市净率、行业处于的生命周期阶段、行业的可替代性、基金经理与市场普遍看法的不一致性等。通过上述分析，形成本基金投资的重点考虑行业。

(2) 个股选择策略

本基金为投资高分红类股票的基金，高分红类股票为实际或预期现金股息率（税后）大于当期银行活期存款利率（税后）的股票。研究团队根据上述总体资产配置和行业配置结果，利用定性和定量相结合的方法对可投资股票进行初步选择，形成本基金投资的备选股票池。备选股票池中的股票必须是高分红或具有投资价值的股票，以求实现基金资产的短期收益与长期增值的目标。

入选股票必须满足以下至少 1 个指标的个股，其中满足第一个条件的个股不少于所有备选股票的 80%：

- 实际或预期现金股息率（税后）大于当期银行活期存款利率（税后）；
- 投资团队在公司模型支持下认为具有特别投资价值的股票。

预期现金股息率将采用以下步骤确定：

- 对备选股票的财务报表进行分析，对其盈利质量进行评估，在其财务状况健康的前提下对利润分配等历史信息进行归纳，了解该公司的利润分配倾向和历史现金分红比例，并以此作为预测该公司未来分红的基础；

- 对备选股票的未来盈利水平、扩张投资计划、现金流变化以及管理层分红意愿等多项内容进行分析，预测公司未来的每股收益和现金分红，确定其预期现金股息收益率；

- 对于那些没有或较少分红的股票我们也会进一步分析其盈利模式和增长潜力。对那些增长稳定、并可能进行高分红的股票进行股息率预测，并

	<p>选入备选股票池。</p> <p>在上述备选股票池建立完成后，基金经理通过数量模型的支持和公司基本面研究，对备选股票的价值进行进一步分析和研究：</p> <ul style="list-style-type: none"> □根据资本市场状况和公司/行业板块的未来发展前景，获取市场对备选股票价值判断的情报； □对备选股票在市场中的各项分析研究结果进行归纳和总结，应用 P/E、P/B、PEG 和现金流折现等多种评估工具对股票进行估值分析； □对积极参与中国金融市场改革和创新的备选股票进行分析，重点关注那些具有良好现金收益的个股，如：股权分置改革中具备较好补偿方案的股票，以较大现金补偿的股票，采用合理的回购价格进行回购的股票等。 <p>通过上述的工作，基金经理将在备选股票库中最终选定估值合理、公司持续性发展可以保证其长期分红趋势的股票进行投资，并构建投资组合。</p> <p>（3）存托凭证的投资策略</p> <p>本基金投资存托凭证的策略依照上述境内上市交易的股票投资策略执行。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>基金管理人采用利率预期调整方法作为本基金进行国债、央行票据、企业债、可转债等固定收益类证券投资的核心策略。通过宏观经济方面自上而下的分析及债券市场方面自下而上的分析，把握市场利率水平的运行态势，并作为债券组合久期选择的主要依据。</p> <p>在利率预期调整方法的基础上，基金管理人通过对备选投资品种的收益率、流动性、信用度等因素的分析评估，并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。</p> <p>4、其他品种投资策略</p> <p>基金经理将根据市场的实际情况及基金的申购赎回状况，将部分资产投资于央行票据、正、逆回购等短期货币市场工具或保留为现金。同时基金经理将通过适时的投资于回购（逆回购）等资产调控工具，提高基金资产的使用效率。</p> <p>另外，本基金被动持有股权分置改革而发行的权证外，也将根据基金管理人对权证价值的判断，在进行充分风险控制和遵守中国证监会相关法律法规规定的基础上，适当投资于权证，为基金持有人谋求收益，减少风险。</p>
--	--

	本基金管理人可以依据维护投资人合法权益的原则，根据证券市场实际情况对上述投资策略及投资组合构建流程进行非实质性的调整，此类变更不需经过基金份额持有人大会通过。
业绩比较基准	75%×上证红利指数+20%×中证全债指数+5%×银行活期存款利率。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金及债券型基金，但低于股票型基金。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。

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		光大保德信基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王许利	龚小武
	联系电话	(021) 80262888	021-52629999-212056
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		4008-202-888	95561
传真		(021) 80262468	021-62159217
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层	福州市湖东路154号
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层	上海市银城路167号兴业大厦4楼
邮政编码		200010	200120
法定代表人		刘翔	吕家进

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.epf.com.cn
基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、兴业银行股份有限公司

	的办公场所。
--	--------

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)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 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
本期已实现收益	47,334,719.45	204,290,703.77	129,761,404.09
本期利润	19,715,898.20	234,060,864.54	175,605,148.98
加权平均基金份额本期利润	0.0917	1.1988	0.5549
本期加权平均净值利润率	3.21%	46.31%	28.34%
本期基金份额净值增长率	3.17%	57.17%	33.76%
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	97,705,042.21	146,801,997.39	-9,018,537.86
期末可供分配基金份额利润	0.4792	0.9048	-0.0306
期末基金资产净值	533,897,798.24	523,937,406.93	633,323,049.40
期末基金份额净值	2.6186	3.2293	2.1464
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	728.93%	703.46%	411.22%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

（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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.11%	0.91%	-4.48%	0.80%	3.37%	0.11%
过去六个月	-10.32%	1.22%	-1.31%	0.96%	-9.01%	0.26%
过去一年	3.17%	1.36%	7.17%	0.85%	-4.00%	0.51%
过去三年	116.88%	1.35%	13.19%	0.86%	103.69%	0.49%
过去五年	50.34%	1.26%	12.54%	0.79%	37.80%	0.47%
自基金合同生效起至今	728.93%	1.55%	175.79%	1.30%	553.14%	0.25%

注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 1 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“75%×上证红利指数+20%×天相国债全价指数+5%×银行活期存款利率”变更为“75%×上证红利指数+20%×中证全债指数+5%×银行活期存款利率”，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

光大保德信红利混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2006 年 3 月 24 日至 2021 年 12 月 31 日)

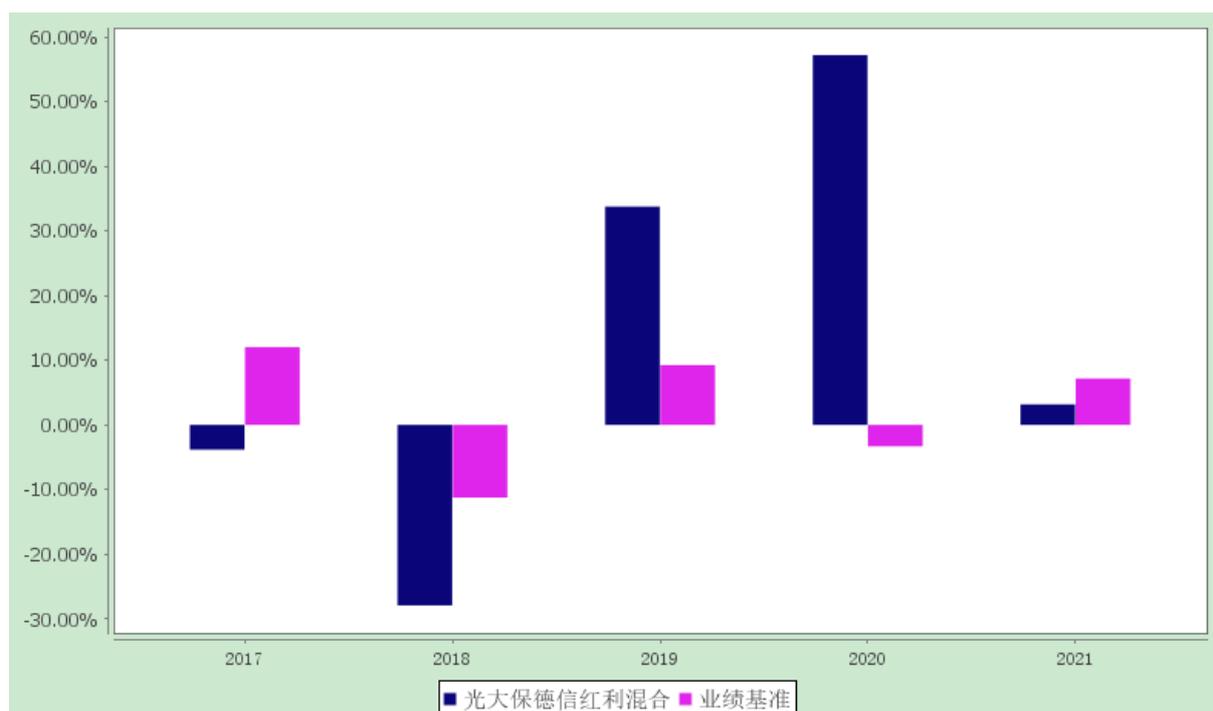


注：根据基金合同的规定，本基金建仓期为 2006 年 3 月 24 日至 2006 年 9 月 23 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 过去五年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

光大保德信红利混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2006 年 3 月 24 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，
第 11 页共 76 页

未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	7.003	70,618,918.21	84,661,784.75	155,280,702.96	-
2020	0.980	5,675,583.84	13,802,147.91	19,477,731.75	-
合计	7.983	76,294,502.05	98,463,932.66	174,758,434.71	-

§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

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55%和 45%的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2021 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 67 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信岁末红利纯债债券型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合

型证券投资基金、光大保德信吉鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信铭鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信尊富 18 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信多策略优选一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信安泽债券型证券投资基金、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信研究精选混合型证券投资基金、光大保德信消费主题股票型证券投资基金、光大保德信裕鑫混合型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金、光大保德信品质生活混合型证券投资基金、光大保德信健康优加混合型证券投资基金、光大保德信睿盈混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创新生活混合型证券投资基金、光大保德信纯债债券型证券投资基金、光大保德信恒鑫混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
徐晓杰	权益管理总部 权益投资团队 副团队长、基 金经理	2020-10- 22	-	15 年	徐晓杰女士，中科院上海生命科学院博士。1998 年 7 月至 2001 年 9 月在吉林省农科院作物研究所任职助理研究员；2006 年 6 月至 2007 年 8 月在上海邦联资产管理有限公司任职研究部行业研究

					<p>员；2007 年 8 月至 2020 年 7 月在华泰柏瑞基金管理有限公司历任投资研究部研究员、研究总监助理、基金经理助理、基金经理、投决会成员；2020 年 7 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部权益投资团队副团长，2020 年 10 月至今担任光大保德信红利混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 8 月至今担任光大保德信健康优加混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，未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》等相关法律法规，制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，并建立《投资研究管理制度》及细则、《集中交易管理制度》、《异常交易监控与报告制度》、《投资对象备选库建立与维护管理办法》等制度作为公平交易执行的制度保障。在投资管理活动中公平的对待公司管理包括开放式基金、特定客户资产管理组合在内的所有组合，范围包括股票、债券等所有投资品种，以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。实行事前控制、事中监控、事后分析的全过程控制，形成有效的公平交易体系。具体的控制方法包括：

事前控制：1、研究人员通过内部晨会、邮件和统一的研究报告平台系统发布投资建议，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；2、各个投资主体有明确的

职责和权限划分，投资组合经理在权限范围内自主决策，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；3、建立规范的一级市场股票债券询价申购和配售等审批流程、银行间债券价格公允性审批流程；建立和定期维护二级市场投资对象备选库和银行间市场交易对手库。

事中监控：1、主动管理型的基金，严禁同一投资组合或不同投资组合在同一交易日进行股票的反向交易，严禁不同投资组合在同一交易日进行债券的反向交易，确有需要进行日内反向交易的，需要进行严格的审批流程；2、交易环节中所有指令严格按照“时间优先、价格优先”的原则执行指令，交易所指令均需通过恒生系统公平交易模块进行分发和委托下单。

事后分析：对公平交易的事后分析主要集中在对同一投资组合或不同投资组合临近交易日的反向交易和不同投资组合临近交易日的同向交易，同时在每季度和每年度，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（如日内、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。特别的，对同一投资组合经理管理的不同投资组合之间的同向交易和反向交易重点进行分析。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

对于公平交易同向交易价差分析，具体的分析方法如下：第一步，在 A 组合买入或者卖出某只证券的当日（3日、5日）内，统计 A 组合在此期间的买入或者卖出该股票的均价，同时统计 B 组合在同期、同方向交易同一只证券的均价，然后比较两者的均价差异，其中买入溢价率 = $(B \text{ 组合交易均价} / A \text{ 组合交易均价} - 1)$ ，卖出溢价率 = $(A \text{ 组合交易均价} / B \text{ 组合交易均价} - 1)$ ；第二步，将发生的所有交易价差汇总进行 T 检验，置信区间 95%，得到交易价差是否趋近于 0 的判断结果，并计算 A 组合与 B 组合同向交易中占优次数的比例为占优比例，用溢价率乘以成交量较少方的成交量计算得到 B 组合对 A 组合溢价金额大小，将所有同向交易溢价金额求和，除以 A 组合平均资产净值来计算对 A 组合净值的影响，称为单位溢价率。判断同向交易价格是否有显著差异有以下四条标准：交易价差不趋向于零、样本数大于 30、单位溢价率大于 1%、占优比例不在 45%-55%之间。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。在同向交易价差分析中，出现溢价率统计显著主要原因是市场交易价格波动较大且组合经理交易时机的选择不同，本基金管理人旗下所有投资组合从投资信息的获取、投资决策到交易执行的各个环节均按照公平交易制度的要求进行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

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存在异常交易行为。本基金与公司旗下其他投资组合在交易所市场未发生较少单边成交量大于 5% 的同日反向交易。

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 年度市场整体震荡上行，上证综指上涨 21%，沪深 300 上涨 12%，创业板上涨 30%，光大红利上涨 3.17%。分行业来看，电力设备、有色金属、煤炭、化工、钢铁等行业涨幅居前，家电、非银、地产、社服、食品饮料、医药等行业跌幅居前。行业间分化继续变大，这是 2021 年市场的主要特征。我们在行业配置方面，消费类行业持仓较多，因此 2021 年表现一般。我们的持仓主要集中在医药、消费、科技三大方向，这三大方向是历史证明能够长期战胜市场的方向，同时我们认为这三大方向也是未来孕育伟大公司的重要领域，我们希望与优秀公司共成长。也正是因为这三大方向在过去几年涨幅较大，估值相对偏高，市场持股也相对集中，因此 2021 年这三大方向表现相对落后。在个股选择上，我们按照优质量、稳增长、高分红的选股策略自下而上精选个股，力求为投资者获取长期可持续的超额收益。2021 年我们在个股的选择上已经尽力去回避一些市场持股集中度较高的个股，但是在板块表现欠佳的前提下，仍然对我们的净值造成一定负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内份额净值增长率为 3.17%，业绩比较基准收益率为 7.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年 1 月 PPI 同比上涨 9.1%，前值涨 10.3%，环比-0.4%。1 月 CPI 同比上涨 0.9%，前值涨 1.5%，环比 0.4%。1 月新增社融 6.17 万亿，创历史新高。国内稳增长、宽信用的大背景下，我们对证券市场并没有那么悲观。

2022 年开年市场波动较大，主要是三方面原因：一是疫情影响下国内经济增长压力较大，二是担心海外货币收紧对国内经济及 A 股市场的负面影响，三是国际政治环境的复杂性。每一年的市场都有似曾相识的熟悉影子，每一年又都是完全不同的。面对各种不确定性，我们能做的还是坚持选股标准，坚守能力圈，赚业绩的钱。投资方向上，我们买入了一些前期调整幅度较大，业绩较好的行业及个股，后续我们会尽力继续挖掘一些底部超预期的个股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额

持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部、风险管理部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部、风险管理部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具合规风控工作情况报告报送董事会和公司管理层。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行了法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展的需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，年内计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，对公司重要业务环节剔除流程改进建议，促使公司规范运作。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始终按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察

稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

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；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同以及基金实际运作情况，光大保德信红利混合型证券投资基金实际分配金额为 155,280,702.96 元，符合基金合同规定。

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

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60467078_B05 号

光大保德信红利混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了光大保德信红利混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的光大保德信红利混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大保德信红利混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于光大保德信红利混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

光大保德信红利混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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。

在编制财务报表时，管理层负责评估光大保德信红利混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督光大保德信红利混合型证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

- （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。

(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。

(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。

(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，就可能导致对光大保德信红利混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致光大保德信红利混合型证券投资基金不能持续经营。

(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。

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。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
蒋燕华 石静筠
上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
2022 年 3 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信红利混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-

银行存款	7.4.7.1	79,950,450.87	58,421,406.69
结算备付金		1,350,833.32	1,408,230.25
存出保证金		197,947.86	180,446.37
交易性金融资产	7.4.7.2	459,192,482.15	466,590,059.46
其中：股票投资		459,192,482.15	466,363,059.46
基金投资		-	-
债券投资		-	227,000.00
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		-	195,087.96
应收利息	7.4.7.5	9,153.03	6,268.35
应收股利		-	-
应收申购款		16,217.82	23,011.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		540,717,085.05	526,824,511.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		5,334,773.98	-
应付赎回款		135,633.98	1,064,416.14
应付管理人报酬	7.4.10.2	679,986.49	635,097.08
应付托管费	7.4.10.2	113,331.07	105,849.49

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	365,329.27	891,241.24
应交税费		-	0.69
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	190,232.02	190,499.48
负债合计		6,819,286.81	2,887,104.12
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	203,888,047.81	162,246,428.22
未分配利润	7.4.7.10	330,009,750.43	361,690,978.71
所有者权益合计		533,897,798.24	523,937,406.93
负债和所有者权益总计		540,717,085.05	526,824,511.05

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.6186 元，基金份额总额 203,888,047.81 份。

7.2 利润表

会计主体：光大保德信红利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		34,529,543.80	250,183,116.28
1.利息收入		390,593.04	458,049.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	363,101.00	450,162.48
债券利息收入		61.90	7,887.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,430.14	-
证券出借利息收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		61,307,229.84	219,862,004.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	57,342,988.31	214,845,028.48
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	85,980.68	256,017.71
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	3,878,260.85	4,760,958.08
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-27,618,821.25	29,770,160.77
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	450,542.17	92,901.40
减：二、费用		14,813,645.60	16,122,251.74
1. 管理人报酬	7.4.10.2	9,183,639.48	7,615,330.99
2. 托管费	7.4.10.2	1,530,606.55	1,269,221.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	3,871,549.34	7,009,553.03
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.23	0.92
7. 其他费用	7.4.7.21	227,850.00	228,145.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,715,898.20	234,060,864.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,715,898.20	234,060,864.54

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：光大保德信红利混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	162,246,428.22	361,690,978.71	523,937,406.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	19,715,898.20	19,715,898.20
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）	41,641,619.59	103,883,576.48	145,525,196.07
其中：1.基金申购款	137,623,550.68	276,425,418.98	414,048,969.66
2.基金赎回款	-95,981,931.09	-172,541,842.50	-268,523,773.59
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）	-	-155,280,702.96	-155,280,702.96
五、期末所有者权益（基金净值）	203,888,047.81	330,009,750.43	533,897,798.24
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）	295,068,042.11	338,255,007.29	633,323,049.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	234,060,864.54	234,060,864.54
三、本期基金份额交易	-132,821,613.89	-191,147,161.37	-323,968,775.26

产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	20,552,863.27	31,811,974.38	52,364,837.65
2.基金赎回款	-153,374,477.16	-222,959,135.75	-376,333,612.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-19,477,731.75	-19,477,731.75
五、期末所有者权益(基金净值)	162,246,428.22	361,690,978.71	523,937,406.93

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 刘翔, 主管会计工作负责人: 贺敬哲, 会计机构负责人: 王永万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大保德信红利混合型证券投资基金(原名光大保德信红利股票型证券投资基金)(以下简称“本基金”), 系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]206 号文《关于同意光大保德信红利股票型证券投资基金募集的批复》的核准, 由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集, 基金合同于 2006 年 3 月 24 日正式生效, 首次设立募集规模为 532,471,074.61 份基金份额。本基金为契约型开放式, 存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司, 基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据 2014 年 8 月 8 日实行的《公开募集证券投资基金运作管理办法》, 经与基金托管人兴业银行股份有限公司协商一致, 并报中国证监会备案, 自 2015 年 7 月 17 日起将本基金变更为光大保德信红利混合型证券投资基金。

本基金股票资产占基金净资产不少于 60%, 最高可达基金净资产 90%, 其余资产除应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在 1 年以内的政府债券外, 还可投资于中国证监会认可的其他金融工具, 包括债券、可转债、央行票据、回购、权证等。前述现金资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：75%×上证红利指数+20%×中证全债指数+5%×银行活期存款利率。

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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“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

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

(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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

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。

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的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；

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；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，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；

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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(2) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，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，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按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方法进行估值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，按最能反映公允价值的方法估值；

(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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入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应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股利收益于除息日确认，并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入账；

(10) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其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；

(11) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等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。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配的比例按有关规定制定；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；

(3) 在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，至多 5 次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 60%。但若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(4) 基金当期收益须先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

(5) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(6) 每一基金份额享有同等收益分配权；

(7) 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担；

(8) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(9) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

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》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，本基金的基金管理人运营本基金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。对本基金在 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，已纳税额从本基金的基金管理人以后月

份的增值税应纳税额中抵减。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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	79,950,450.87	58,421,406.69
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	79,950,450.87	58,421,406.69

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	429,810,914.85	459,192,482.15	29,381,567.30
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	429,810,914.85	459,192,482.15	29,381,567.30
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	409,362,670.91	466,363,059.46	57,000,388.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	227,000.00	227,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	227,000.00	227,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	409,589,670.91	466,590,059.46	57,000,388.55

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均未持有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	上年度末

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	8,456.23	5,531.06
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	607.80	633.70
应收债券利息	-	22.39
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	89.00	81.20
合计	9,153.03	6,268.35

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	365,329.27	890,841.24
银行间市场应付交易费用	-	400.00
合计	365,329.27	891,241.24

7.4.7.8 其他负债

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
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	232.02	499.48
应付证券出借违约金	-	-
预提审计费	70,000.00	70,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	190,232.02	190,499.48

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

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	162,246,428.22	162,246,428.22
本期申购	137,623,550.68	137,623,550.68
本期赎回（以“-”号填列）	-95,981,931.09	-95,981,931.09
本期末	203,888,047.81	203,888,047.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	146,801,997.39	214,888,981.32	361,690,978.71
本期利润	47,334,719.45	-27,618,821.25	19,715,898.20
本期基金份额交易产生的变动数	58,849,028.33	45,034,548.15	103,883,576.48
其中：基金申购款	118,761,307.08	157,664,111.90	276,425,418.98
基金赎回款	-59,912,278.75	-112,629,563.75	-172,541,842.50
本期已分配利润	-155,280,702.96	-	-155,280,702.96
本期末	97,705,042.21	232,304,708.22	330,009,750.43

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	341,283.88	419,725.10
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	18,064.93	27,308.15
其他	3,752.19	3,129.23
合计	363,101.00	450,162.48

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	1,386,166,731.24	2,496,808,286.41
减：卖出股票成本总额	1,328,823,742.93	2,281,963,257.93
买卖股票差价收入	57,342,988.31	214,845,028.48

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	85,980.68	256,017.71
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	85,980.68	256,017.71

7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	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	500,366.89	20,727,954.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	414,300.00	20,241,620.00
减：应收利息总额	86.21	230,316.46
买卖债券差价收入	85,980.68	256,017.71

7.4.7.14.3 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均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,878,260.85	4,760,958.08
合计	3,878,260.85	4,760,958.08

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	-27,618,821.25	29,770,160.77
——股票投资	-27,618,821.25	29,770,160.77
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-27,618,821.25	29,770,160.77

7.4.7.19 其他收入

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
基金赎回费收入	441,063.98	84,885.20
转换费收入	9,478.19	8,016.20
合计	450,542.17	92,901.40

7.4.7.20 交易费用

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
交易所市场交易费用	3,871,549.34	7,009,153.03
银行间市场交易费用	-	400.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	3,871,549.34	7,009,553.03

7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无持有基金产生的费用。

7.4.7.21 其他费用

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
审计费用	70,000.00	70,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	650.00	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	2,145.00
合计	227,850.00	228,145.00

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

截至财务报表批准日，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
光大保德信基金管理有限公司(简称"光大保德信")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(简称"兴业银行")	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司(简称"光大证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券	-	-	103,619,760.61	2.24%

注：本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
光大证券	-	-	349,576.00	25.46%

注：本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
-	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
光大证券	96,500.00	2.41%	54,766.74	6.15%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	9,183,639.48
其中：支付销售机构的客户维护费	2,162,954.72	1,738,880.77

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。

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	1,530,606.55	1,269,221.80

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{基金托管费年费率} / \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，按月支付。

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均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

本基金本报告期末及上年度可比期间末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

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本报告期及上年度可比期间均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报告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	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

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	79,950,450.87	341,283.88	58,421,406.69	419,725.10

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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2021-04-15	-	2021- 04-15	7.003	70,618,918.2 1	84,661,784.7 5	155,280,702. 96	-
合计				7.003	70,618,918.2 1	84,661,784.7 5	155,280,702. 96	-

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
00123 4	泰慕 士	2021- 12-31	2022- 01-11	认购 新发 证券	16.53	16.53	333.00	5,504. 49	5,504. 49	-

300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	21.08	444.00	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328.00	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股流通受限	9.96	27.29	203.00	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420.00	4,998.00	19,089.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	30.44	421.00	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290.00	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股流通受限	1.55	20.88	403.00	624.65	8,414.64	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286.00	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733.00	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	14.14	89.87	427.00	6,037.78	38,374.49	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242.00	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	4.97	12.51	513.00	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108.00	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644.00	14,193.76	36,244.32	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股流通	23.38	29.93	205.00	4,792.90	6,135.65	-

				受限							
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	14.82	24.26	193.00	2,860.26	4,682.18	-	
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	12.51	1,751.00	12,186.96	21,905.01	-	
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	241.00	3,270.37	9,280.91	-	
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215.00	1,571.65	6,065.15	-	
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	48.99	290.00	2,418.60	14,207.10	-	
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.96	799.00	3,299.87	10,355.04	-	
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196.00	3,790.64	6,452.32	-	
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	60.64	234.74	233.00	14,129.12	54,694.42	-	
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.78	155.00	1,839.85	4,460.90	-	
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.78	355.00	2,449.50	7,731.90	-	
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股流通受限	3.93	11.09	572.00	2,247.96	6,343.48	-	
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218.00	1,750.54	4,146.36	-	
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	3.55	18.24	1,386.00	4,920.30	25,280.64	-	
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	19.30	259.00	2,095.31	4,998.70	-	
30106	兰卫	2021-	2022-	新股	4.17	30.94	587.00	2,447.	18,161	-	

0	医学	09-06	03-14	流通受限				79	.78	
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股流通受限	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	153.00	2,662.20	5,524.83	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	新股流通受限	5.24	22.84	344.00	1,802.56	7,856.96	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144.00	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	539.00	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181.00	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144.00	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140.00	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403.00	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	新股流通受限	15.48	21.53	915.00	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股流通受限	9.08	14.21	416.00	3,777.28	5,911.36	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	442.00	14,656.72	10,904.14	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220.00	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	新股流通受限	10.45	11.22	1,748.00	18,266.60	19,612.56	-

30109 1	深城 交	2021- 10-20	2022- 04-29	新股 流通 受限	36.50	31.31	524.00	19,126 .00	16,406 .44	-
30109 2	争光 股份	2021- 10-21	2022- 05-05	新股 流通 受限	36.31	35.52	323.00	11,728 .13	11,472 .96	-
30109 3	华兰 股份	2021- 10-21	2022- 05-05	新股 流通 受限	58.08	49.85	299.00	17,365 .92	14,905 .15	-
30109 6	百诚 医药	2021- 12-13	2022- 06-20	新股 流通 受限	79.60	78.53	187.00	14,885 .20	14,685 .11	-
30109 8	金埔 园林	2021- 11-04	2022- 05-12	新股 流通 受限	12.36	22.17	307.00	3,794. 52	6,806. 19	-
30109 9	雅创 电子	2021- 11-10	2022- 05-23	新股 流通 受限	21.99	71.36	351.00	7,718. 49	25,047 .36	-
30110 0	风光 股份	2021- 12-10	2022- 06-17	新股 流通 受限	27.81	31.14	599.00	16,658 .19	18,652 .86	-
30110 1	明月 镜片	2021- 12-09	2022- 06-16	新股 流通 受限	26.91	43.36	371.00	9,983. 61	16,086 .56	-
30110 8	洁雅 股份	2021- 11-25	2022- 06-06	新股 流通 受限	57.27	53.71	247.00	14,145 .69	13,266 .37	-
301111	粤万 年青	2021- 11-30	2022- 06-07	新股 流通 受限	10.48	36.68	379.00	3,971. 92	13,901 .72	-
30112 6	达嘉 维康	2021- 11-30	2022- 06-07	新股 流通 受限	12.37	19.23	662.00	8,188. 94	12,730 .26	-
30112 7	天源 环保	2021- 12-23	2022- 06-30	新股 流通 受限	12.03	17.12	1,685. 00	20,270 .55	28,847 .20	-
30113 8	华研 精机	2021- 12-08	2022- 06-15	新股 流通 受限	26.17	44.86	285.00	7,458. 45	12,785 .10	-
30114 9	隆华 新材	2021- 11-03	2022- 05-10	新股 流通 受限	10.07	16.76	1,214. 00	12,224 .98	20,346 .64	-
30116 6	C 优宁 维	2021- 12-21	2022- 06-28	新股 流通	86.06	94.50	198.00	17,039 .88	18,711 .00	-

				受限						
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	329.00	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	264.00	30,856.32	30,645.12	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	274.00	12,053.26	13,910.98	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	新股流通受限	27.12	30.58	294.00	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	新股流通受限	11.88	21.16	578.00	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股流通受限	13.00	20.48	647.00	8,411.00	13,250.56	-
301189	C 奥尼	2021-12-21	2022-06-28	新股流通受限	66.18	56.62	348.00	23,030.64	19,703.76	-
301190	C 善水	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	551.00	15,345.35	15,130.46	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	297.00	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262.00	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	29.28	32.00	402.00	11,770.56	12,864.00	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	新股流通受限	25.80	33.65	923.00	23,813.40	31,058.95	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	新股流通受限	69.89	88.72	280.00	19,569.20	24,841.60	-
688032	禾迈股份	2021-12-13	2022-06-20	新股流通受限	557.80	650.66	482.00	268,859.60	313,618.12	-
68819	云路	2021-	2022-	新股	46.63	92.51	3,026.	141,10	279,93	-

0	股份	11-18	05-26	流通受限			00	2.38	5.26	
688206	概伦电子	2021-12-20	2022-06-28	新股流通受限	28.28	33.01	5,760.00	162,892.80	190,137.60	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	6.42	15.76	2,693.00	17,289.06	42,441.68	-
688305	科德数控	2021-07-02	2022-01-10	新股流通受限	11.03	105.68	1,496.00	16,500.88	158,097.28	-
688670	金迪克	2021-07-23	2022-02-07	新股流通受限	55.18	74.11	2,310.00	127,465.80	171,194.10	-
688778	厦钨新能	2021-07-29	2022-02-07	新股流通受限	24.50	100.74	5,075.00	124,337.50	511,255.50	-
688786	悦安新材	2021-08-18	2022-02-28	新股流通受限	11.76	54.01	1,513.00	17,792.88	81,717.13	-

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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融出证券。

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财务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内部管理制度和流程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持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、地方政府债、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 0.00%(2020 年 12 月 31 日：0.04%)。

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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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该比例限制)。

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。

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。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为清算备付金、存出保证金及银行存款等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

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	79,950,450.87	-	-	-	-	-	79,950,450.87
结算备付金	1,350,833.3	-	-	-	-	-	1,350,833.3

	2						2
存出保证金	197,947.86	-	-	-	-	-	197,947.86
交易性金融资产	-	-	-	-	-	459,192,482.15	459,192,482.15
应收利息	-	-	-	-	-	9,153.03	9,153.03
应收申购款	-	-	-	-	-	16,217.82	16,217.82
资产总计	81,499,232.05	-	-	-	-	459,217,853.00	540,717,085.05
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,334,773.98	5,334,773.98
应付赎回款	-	-	-	-	-	135,633.98	135,633.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	679,986.49	679,986.49
应付托管费	-	-	-	-	-	113,331.07	113,331.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	365,329.27	365,329.27
其他负债	-	-	-	-	-	190,232.02	190,232.02
负债总计	-	-	-	-	-	6,819,286.81	6,819,286.81
利率敏感度缺口	81,499,232.05	-	-	-	-	452,398,566.19	533,897,798.24
上年度末 2020 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	58,421,406.69	-	-	-	-	-	58,421,406.69
结算备付金	1,408,230.25	-	-	-	-	-	1,408,230.25
存出保证金	180,446.37	-	-	-	-	-	180,446.37
交易性金融资产	-	-	227,000.00	-	-	466,363,059.46	466,590,059.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	195,087.96	195,087.96
应收利息	-	-	-	-	-	6,268.35	6,268.35
应收申购款	-	-	-	-	-	23,011.97	23,011.97
资产总计	60,010,083.	-	227,000.00	-	-	466,587,42	526,824,51

	31					7.74	1.05
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,064,416.14	1,064,416.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	635,097.08	635,097.08
应付托管费	-	-	-	-	-	105,849.49	105,849.49
应付交易费用	-	-	-	-	-	891,241.24	891,241.24
其他负债	-	-	-	-	-	190,499.48	190,499.48
应交税费	-	-	-	-	-	0.69	0.69
负债总计	-	-	-	-	-	2,887,104.12	2,887,104.12
利率敏感度缺口	60,010,083.31	-	227,000.00	-	-	463,700.323.62	523,937.406.93

注：上表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了归类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业

和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。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，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	459,192,482.15	86.01	466,363,059.46	89.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	227,000.00	0.04
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	459,192,482.15	86.01	466,590,059.46	89.05

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与本报告期的整体水平保持一致		
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
	业绩比较基准上升 1%	增加约 910,130.97	增加约 5,979,888.46
	业绩比较基准下降 1%	减少约 910,130.97	减少约 5,979,888.46

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期

限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 456,445,657.43 元，属于第二层次的余额为人民币 5,504.49 元，属于第三层次的余额为人民币 2,741,320.23 元（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 463,542,673.61 元，属于第二层次的余额为人民币 434,119.06 元，属于第三层次的余额为人民币 2,613,266.79 元）。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.1.2.3 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变动情况如下：上年度末余额人民币 2,613,266.79 元，2021 年度转入第三层次人民币 0.00 元，转出第三层次人民币 2,927,993.78 元，当期计入损益的利得或损失总额人民币 1,626,456.55 元，购买人民币 1,443,024.05 元，卖出人民币 13,433.38 元，本期末人民币 2,741,320.23 元，本期末持有的资产计入损益的当期未实现利得或损失的变动人民币 1,298,296.18 元。

7.4.14.2 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。

7.4.14.3 其他事项

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）（以下简称“新金融工具准则”）和《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)的规定及相关法律法规的要求,自2022年1月1日起,本基金开始执行新金融工具准则。

截至资产负债表日,本基金无其他需要说明的其他重要事项。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月X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	459,192,482.15	84.92
	其中:股票	459,192,482.15	84.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	81,301,284.19	15.04
8	其他各项资产	223,318.71	0.04
9	合计	540,717,085.05	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

A	农、林、牧、渔业	2,651,992.00	0.50
B	采矿业	4,698,329.00	0.88
C	制造业	337,534,289.78	63.22
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	14,669,633.48	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	12,669,320.00	2.37
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	4,316,485.78	0.81
J	金融业	12,371,527.68	2.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,160,877.10	1.90
M	科学研究和技术服务业	49,284,875.29	9.23
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	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	10,760,410.50	2.02
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	459,192,482.15	86.01

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300416	苏试试验	924,370	31,382,361.50	5.88
2	300760	迈瑞医疗	75,900	28,902,720.00	5.41
3	600519	贵州茅台	9,400	19,270,000.00	3.61
4	688006	杭可科技	149,117	16,042,006.86	3.00
5	300790	宇瞳光学	326,200	14,737,716.00	2.76
6	000858	五粮液	65,800	14,651,028.00	2.74

7	002463	沪电股份	862,940	14,307,545.20	2.68
8	688155	先惠技术	113,933	12,988,362.00	2.43
9	603456	九洲药业	226,908	12,765,844.08	2.39
10	603713	密尔克卫	94,000	12,669,320.00	2.37
11	600030	中信证券	465,800	12,301,778.00	2.30
12	300558	贝达药业	148,920	11,888,283.60	2.23
13	002821	凯莱英	26,400	11,484,000.00	2.15
14	300124	汇川技术	158,567	10,877,696.20	2.04
15	300015	爱尔眼科	254,074	10,742,248.72	2.01
16	300567	精测电子	146,600	10,618,238.00	1.99
17	601888	中国中免	46,310	10,160,877.10	1.90
18	600882	妙可蓝多	178,400	9,990,400.00	1.87
19	300122	智飞生物	79,300	9,880,780.00	1.85
20	300327	中颖电子	144,760	9,829,204.00	1.84
21	000739	普洛药业	261,700	9,183,053.00	1.72
22	603259	药明康德	77,320	9,168,605.60	1.72
23	002727	一心堂	222,200	8,556,922.00	1.60
24	300759	康龙化成	58,700	8,292,549.00	1.55
25	688016	心脉医疗	31,223	7,766,409.02	1.45
26	300702	天宇股份	154,760	7,482,646.00	1.40
27	603345	安井食品	43,100	7,360,618.00	1.38
28	002637	赞宇科技	351,000	6,626,880.00	1.24
29	300316	晶盛机电	94,200	6,546,900.00	1.23
30	603233	大参林	142,500	6,000,675.00	1.12
31	300398	飞凯材料	240,400	5,808,064.00	1.09
32	603229	奥翔药业	151,900	5,530,679.00	1.04
33	002304	洋河股份	33,200	5,469,036.00	1.02
34	000999	华润三九	159,500	5,461,280.00	1.02
35	603816	顾家家居	70,700	5,455,212.00	1.02
36	300363	博腾股份	58,400	5,223,880.00	0.98
37	300054	鼎龙股份	209,700	5,104,098.00	0.96
38	002078	太阳纸业	422,000	4,848,780.00	0.91
39	000661	长春高新	17,500	4,749,500.00	0.89
40	002557	洽洽食品	76,700	4,706,312.00	0.88
41	300750	宁德时代	8,000	4,704,000.00	0.88
42	601001	晋控煤业	488,900	4,698,329.00	0.88
43	603707	健友股份	109,062	4,580,604.00	0.86
44	603155	新亚强	82,400	4,458,664.00	0.84
45	688029	南微医学	20,200	4,295,934.00	0.80
46	600845	宝信软件	64,800	3,941,784.00	0.74
47	600085	同仁堂	71,100	3,198,078.00	0.60
48	300203	聚光科技	102,700	2,902,302.00	0.54
49	002714	牧原股份	49,700	2,651,992.00	0.50
50	688639	华恒生物	20,000	2,585,000.00	0.48

51	300685	艾德生物	33,400	2,522,034.00	0.47
52	688778	厦钨新能	5,075	511,255.50	0.10
53	688105	诺唯赞	3,453	366,018.00	0.07
54	688167	炬光科技	1,611	352,809.00	0.07
55	688032	禾迈股份	482	313,618.12	0.06
56	688190	云路股份	3,026	279,935.26	0.05
57	688206	概伦电子	5,760	190,137.60	0.04
58	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.03
59	688305	科德数控	1,496	158,097.28	0.03
60	688227	品高股份	4,164	133,581.12	0.03
61	688236	春立医疗	3,945	108,053.55	0.02
62	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.02
63	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
64	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
65	688226	威腾电气	2,693	42,441.68	0.01
66	301029	怡合达	427	38,374.49	0.01
67	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
68	301211	亨迪药业	923	31,058.95	0.01
69	301177	迪阿股份	264	30,645.12	0.01
70	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.01
71	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
72	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
73	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
74	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
75	301039	中集车辆	1,751	21,905.01	0.00
76	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
77	301189	C 奥尼	348	19,703.76	0.00
78	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
79	301090	华润材料	1,748	19,612.56	0.00
80	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
81	301166	C 优宁维	198	18,711.00	0.00
82	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
83	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
84	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
85	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
86	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
87	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
88	301190	C 善水	551	15,130.46	0.00
89	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
90	301093	华兰股份	299	14,905.15	0.00
91	301096	百诚医药	187	14,685.11	0.00
92	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
93	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
94	301179	泽宇智能	274	13,910.98	0.00

95	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
96	301108	洁雅股份	247	13,266.37	0.00
97	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
98	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
99	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
100	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
101	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
102	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
103	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
104	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
105	301088	戎美股份	442	10,904.14	0.00
106	301048	金鹰重工	799	10,355.04	0.00
107	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
108	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
109	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
110	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
111	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
112	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
113	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
114	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
115	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
116	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
117	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
118	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
119	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
120	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
121	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
122	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
123	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
124	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
125	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
126	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
127	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
128	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
129	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
130	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
131	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
132	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
133	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
134	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
135	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
136	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
137	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
138	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00

139	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
140	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
141	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	000661	长春高新	40,559,459.75	7.74
2	300015	爱尔眼科	40,259,496.92	7.68
3	300760	迈瑞医疗	30,930,016.00	5.90
4	300832	新产业	30,201,093.10	5.76
5	000858	五粮液	25,749,493.00	4.91
6	300702	天宇股份	22,595,147.60	4.31
7	300416	苏试试验	22,502,548.80	4.29
8	603259	药明康德	21,558,681.30	4.11
9	688006	杭可科技	20,467,621.30	3.91
10	300347	泰格医药	19,319,566.00	3.69
11	603456	九洲药业	19,279,651.00	3.68
12	600196	复星医药	19,172,824.74	3.66
13	688155	先惠技术	18,958,390.18	3.62
14	300482	万孚生物	18,706,745.00	3.57
15	002821	凯莱英	18,313,180.00	3.50
16	002304	洋河股份	17,717,729.00	3.38
17	603599	广信股份	16,614,423.00	3.17
18	300529	健帆生物	15,773,078.00	3.01
19	603713	密尔克卫	15,665,984.50	2.99
20	600521	华海药业	15,027,425.91	2.87
21	300558	贝达药业	14,880,835.00	2.84
22	603520	司太立	14,462,458.28	2.76
23	000568	泸州老窖	14,089,103.00	2.69
24	600036	招商银行	13,798,940.00	2.63
25	300122	智飞生物	13,650,799.00	2.61
26	300285	国瓷材料	13,469,730.81	2.57
27	002463	沪电股份	13,395,991.00	2.56
28	300171	东富龙	13,319,829.00	2.54
29	600409	三友化工	13,302,120.00	2.54
30	600309	万华化学	13,224,620.00	2.52
31	000739	普洛药业	12,734,764.60	2.43

32	600030	中信证券	12,388,884.00	2.36
33	000513	丽珠集团	12,356,662.82	2.36
34	300454	深信服	12,296,500.00	2.35
35	603229	奥翔药业	11,653,282.70	2.22
36	300450	先导智能	11,340,623.00	2.16
37	600763	通策医疗	11,141,962.00	2.13
38	300759	康龙化成	11,062,909.00	2.11
39	300567	精测电子	10,647,459.00	2.03
40	300725	药石科技	10,552,467.60	2.01

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000661	长春高新	48,136,989.88	9.19
2	300015	爱尔眼科	47,708,070.48	9.11
3	300725	药石科技	29,891,632.96	5.71
4	002648	卫星化学	24,906,906.00	4.75
5	300832	新产业	24,595,287.70	4.69
6	601888	中国中免	22,034,343.40	4.21
7	603599	广信股份	21,325,005.00	4.07
8	000002	万科A	21,239,381.00	4.05
9	300171	东富龙	21,181,749.24	4.04
10	300470	中密控股	19,870,460.48	3.79
11	600276	恒瑞医药	19,267,691.20	3.68
12	300759	康龙化成	18,747,196.00	3.58
13	600486	扬农化工	18,404,588.00	3.51
14	000858	五粮液	18,285,561.00	3.49
15	000516	国际医学	18,151,304.00	3.46
16	688169	石头科技	17,370,325.26	3.32
17	300347	泰格医药	17,045,678.47	3.25
18	300132	青松股份	15,993,627.00	3.05
19	002821	凯莱英	15,057,506.00	2.87
20	300285	国瓷材料	15,041,156.00	2.87
21	688366	昊海生科	15,005,735.44	2.86
22	603707	健友股份	14,748,833.80	2.81
23	603520	司太立	14,603,346.00	2.79
24	300702	天宇股份	14,521,426.00	2.77
25	000568	泸州老窖	14,220,135.00	2.71
26	603259	药明康德	14,170,938.80	2.70

27	300122	智飞生物	14,058,924.47	2.68
28	601233	桐昆股份	13,892,458.00	2.65
29	600196	复星医药	13,776,745.00	2.63
30	688050	爱博医疗	13,736,045.22	2.62
31	300482	万孚生物	12,919,316.44	2.47
32	600309	万华化学	12,865,750.30	2.46
33	603337	杰克股份	12,655,125.97	2.42
34	600036	招商银行	12,556,299.00	2.40
35	002304	洋河股份	12,388,877.00	2.36
36	002430	杭氧股份	12,344,178.00	2.36
37	600436	片仔癀	12,231,958.97	2.33
38	300450	先导智能	12,211,665.83	2.33
39	300595	欧普康视	12,141,975.60	2.32
40	688356	键凯科技	12,013,208.40	2.29
41	300529	健帆生物	11,772,879.72	2.25
42	601677	明泰铝业	11,607,340.00	2.22
43	300558	贝达药业	11,550,323.86	2.20
44	000157	中联重科	11,507,106.00	2.20
45	600584	长电科技	11,232,966.00	2.14
46	600600	青岛啤酒	10,928,672.00	2.09
47	002050	三花智控	10,765,682.44	2.05
48	600521	华海药业	10,495,463.42	2.00

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

买入股票的成本（成交）总额	1,349,271,986.87
卖出股票的收入（成交）总额	1,386,166,731.24

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

报告期末本基金未投资贵金属。

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

报告期末本基金未投资股指期货交易。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

报告期末本基金未投资国债期货交易。

8.12 本报告期投资基金情况

8.12.1 投资政策及风险说明

本基金本报告期末未投资基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 报告期内本基金投资的前十名证券中,没有发行主体被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情形。

8.13.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.13.3 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	197,947.86
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	9,153.03
5	应收申购款	16,217.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,318.71

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

报告期内本基金没有其他需要说明的重要事项。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
15,165	13,444.65	33,063,673.07	16.22%	170,824,374.74	83.78%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有	407,991.70	0.20%

本基金		
-----	--	--

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本基金的基金经理未持有本基金的份额。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年3月24日)基金份额总额	532,471,074.61
本报告期期初基金份额总额	162,246,428.22
本报告期基金总申购份额	137,623,550.68
减：本报告期基金总赎回份额	95,981,931.09
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	203,888,047.81

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经公司十届十三次董事会会议审议通过，自 2021 年 2 月 2 日起，梅雷军先生正式离任公司副总经理、首席运营总监兼首席信息官，自 2021 年 2 月 26 日起，贺敬哲先生正式担任公司副总经理兼首席信息官。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬为人民币 7 万元,目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 16 年。

11.7 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,本基金的基金管理人和基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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	
东方证券股份有限公司	1	14,275,549.44	0.53%	13,009.88	0.60%	-
平安证券股份有限公司	1	17,429,692.11	0.64%	15,883.59	0.73%	-
中银国际证券股份有限公司	1	43,934,278.22	1.62%	40,038.10	1.83%	-
信达证券	1	609,923,906.67	22.47%	555,823.21	25.43%	-
中信证券股份有限公司	2	781,123,143.92	28.78%	399,390.28	18.27%	-
华创证券有限责任公司	2	1,247,358,255.14	45.96%	1,161,662.78	53.15%	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

齐鲁证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：本报告期内本基金未新增、撤销租用交易单元。

专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

- 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；
- 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- 经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；
- 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；
- 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；
- 对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（1）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构，并报本管理人董事会批准。

经董事会批准后，由本管理人交易部门、运营部门配合完成专用交易单元的具体租用事

宜。

11.8.2 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	
	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
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	50,000,000.00	21.74%	-	-
中信证券股份有限公司	266,044.00	53.17%	160,000,000.00	69.57%	-	-
华创证券有限责任公司	234,322.89	46.83%	20,000,000.00	8.70%	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.9 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	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2020 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2021-01-01
2	光大保德信基金管理有限公司关于暂停使用招商银行直付通服务办理直销网上交易部分业务的公告	同上	2021-01-18
3	光大保德信红利混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	同上	2021-01-22
4	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2021-02-02
5	光大保德信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	同上	2021-02-26
6	光大保德信红利混合型证券投资基金 2020 年年度报告	同上	2021-03-31
7	光大保德信红利混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021-04-07
8	光大保德信红利混合型证券投资基金分红公告	同上	2021-04-13
9	光大保德信红利混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资的公告	同上	2021-04-14
10	光大保德信红利混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	同上	2021-04-22
11	光大保德信红利混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2021-04-22
12	光大保德信红利混合型证券投资基金招募说明书(更新)	同上	2021-04-22
13	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	同上	2021-07-01
14	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2021 年 6 月 30 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2021-07-01
15	光大保德信红利混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	同上	2021-07-21
16	关于调整旗下开放式基金认购、申购、定期定额投资金额下限的公告	同上	2021-08-14
17	光大保德信红利混合型证券投资基金 2021 年中期报告	同上	2021-08-31
18	光大保德信红利混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	同上	2021-10-27
19	光大保德信基金管理有限公司关于旗下部分	同上	2021-12-10

	基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告		
20	光大保德信基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	同上	2021-12-31

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210317-20210415	0.00	46,686,482.62	46,686,482.62	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回的情况，从而：</p> <p>（1）对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。</p> <p>（2）基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。</p> <p>（3）因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。</p> <p>本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p>							

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、中国证监会批准光大保德信红利股票型证券投资基金设立的文件
- 2、光大保德信红利混合型证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信红利混合型证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信红利混合型证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信红利股票型证券投资基金法律意见书
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照

- 8、报告期内光大保德信红利混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二二年三月三十一日