

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52

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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	66
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	74
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.....	74
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.....	74
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.....	74
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.....	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	74
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 市场中性策略执行情况.....	75
8.13 投资组合报告附注.....	75
§ 9 基金份额持有人信息.....	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	77
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	78
§ 10 开放式基金份额变动.....	78
§ 11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	80
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§ 13 备查文件目录.....	82
13.1 备查文件目录.....	82
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	安信阿尔法定开混合	
基金主代码	005280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	185,379,494.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
下属分级基金的交易代码	005280	009624
报告期末下属分级基金的份额总额	146,662,333.05 份	38,717,161.34 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以追求绝对收益为目标，在完全对冲市场风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金主要采用市场中性策略，通过量化模型优选出股票多头组合，并通过股指期货等对冲工具剥离市场系统性风险，获取稳健的阿尔法收益。资产配置方面，通过对宏观经济周期、货币供应量、市场估值水平、宏观政策导向以及市场氛围等因素的分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例。股票投资方面，主要采用 Alpha 多因子模型，并结合风险模型和优化模型，构建 Alpha 股票组合，并使用股指期货对冲市场系统性风险。同时，本基金将运用期现套利、股指期货跨期套利、高频交易等绝对收益策略，进一步平抑本基金的收益波动。此外，本基金还将采用债券投资策略、资产证券投资策略、衍生工具投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	一年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，但高于债券型基金、货币市场基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	安信基金管理有限责任公司		招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	张燕
	联系电话	0755-82509999	0755-83199084
	电子邮箱	service@essencefund.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话	4008-088-088		95555
传真	0755-82799292		0755-83195201
注册地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层		深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	518026		518040
法定代表人	刘入领		缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年	2020 年 6 月 12 日 (基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	2019 年
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	安信阿尔法定开混合
本期已实现收益	13,682,371.43	5,752,749.14	20,109,573.76	7,184,779.62	2,309,248.26
本期	5,681,360.69	2,807,527.72	25,299,981.55	11,776,652.46	7,066,295.29

利润					
加权平均基金份额本期利润	0.0201	0.0149	0.1559	0.0909	0.0834
本期加权平均净值利润率	1.65%	1.24%	13.74%	7.82%	8.29%
本期基金份额净值增长率	2.10%	1.52%	15.40%	8.48%	4.79%
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	26,011,410.21	6,455,466.78	29,874,650.37	28,775,718.63	525,676.10
期末可供分配基金份额利润	0.1774	0.1667	0.1456	0.1421	0.0053
期末基金资产净值	178,785,701.51	46,789,710.02	244,920,630.16	241,050,794.41	103,198,921.91
期末基金份额净值	1.2190	1.2085	1.1939	1.1904	1.0346
3.1.3 累计期	2021 年末		2020 年末		2019 年末

末指标					
基金份额累计净值增长率	21.90%	10.13%	19.39%	8.48%	3.46%

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

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

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

4、根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信阿尔法定开混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.02%	0.17%	0.38%	0.00%	-0.40%	0.17%
过去六个月	0.37%	0.21%	0.76%	0.00%	-0.39%	0.21%
过去一年	2.10%	0.26%	1.50%	0.00%	0.60%	0.26%
过去三年	23.47%	0.23%	4.50%	0.00%	18.97%	0.23%
自基金合同生效起至今	21.90%	0.21%	6.11%	0.00%	15.79%	0.21%

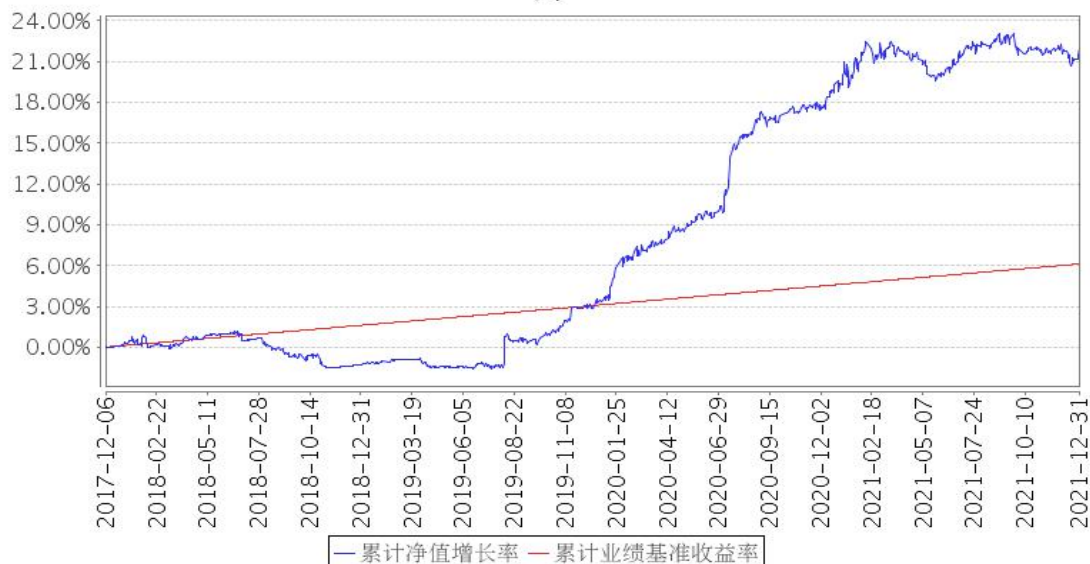
安信阿尔法定开混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.17%	0.17%	0.38%	0.00%	-0.55%	0.17%
过去六个月	0.09%	0.21%	0.76%	0.00%	-0.67%	0.21%
过去一年	1.52%	0.26%	1.50%	0.00%	0.02%	0.26%
自基金合同生效起至今	10.13%	0.26%	2.33%	0.00%	7.80%	0.26%

注：根据《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

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

安信阿尔法定开混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信阿尔法定开混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



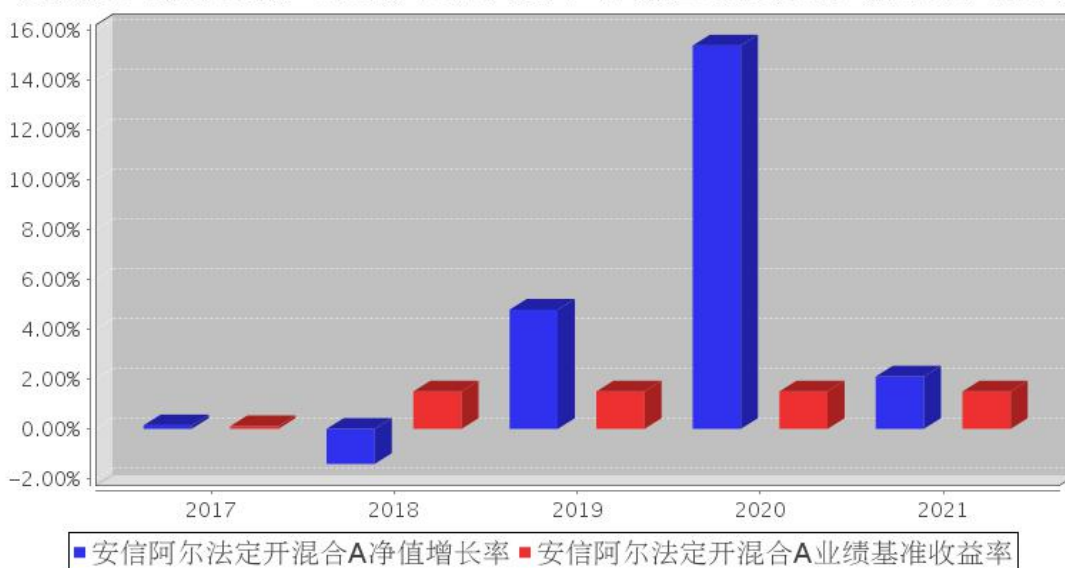
注：1、本基金合同生效日为 2017 年 12 月 06 日。

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

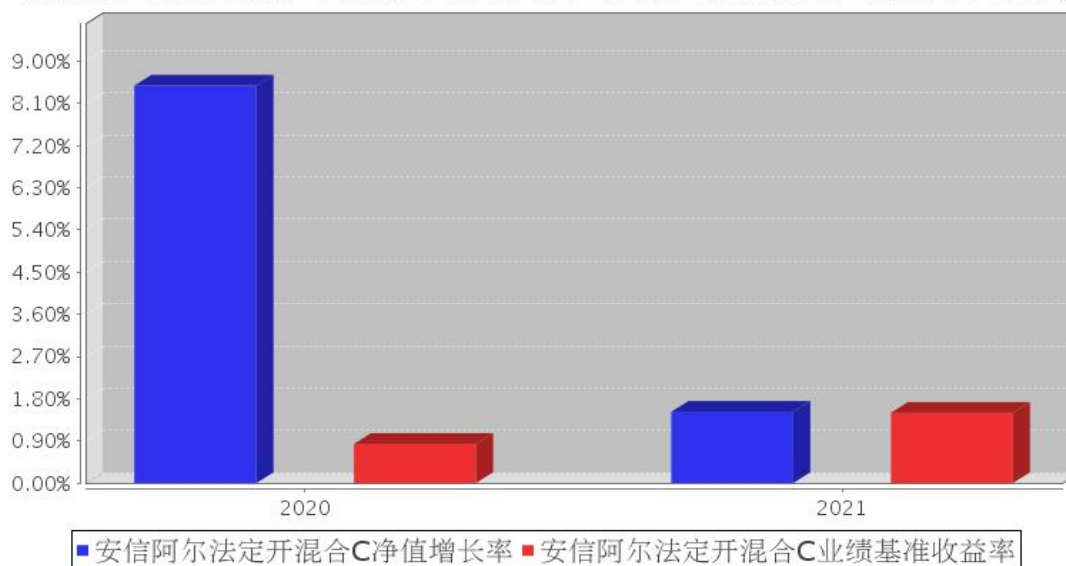
3、根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。

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

安信阿尔法定开混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信阿尔法定开混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年、新增份额当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 77 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型

证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金(原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金)、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金(原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金(LOF)、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金(LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金(LOF)、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐黄玮	本基金的基金经理，量化投资部总经理	2017 年 12 月 29 日	-	14 年	徐黄玮先生，理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理，安信量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，在疫情持续反复下，国内经济增长呈现上半年持续复苏，下半年增长动力减弱的状况。结构上来看，消费持续低迷，制造业下半年出现冲高回落。市场流动性相对宽裕，全年来看，以新能源为首的成长类行业表现相对较佳，部分顺周期行业上半年表现亮眼。风格方面，整体看成长表现占优，这与相关行业业绩增速表现是一致的。大小盘来看，小盘股表现相对活跃，主要是大盘股过去几年估值已经达到了一定高度，小盘股凸显出了一定价值。

本基金主要通过量化多因子的方法来构建多头，综合评估公司的盈利、企业质量、估值、市场趋势、投资者情绪等多个因素，精选优质、具有投资价值和合理估值的个股作为主要的投资标的，同时运用股指期货进行对冲。此外，本基金积极把握了个股事件驱动、科创板新股、可转债、固定收益等增强机会，也密切关注运用期货基差波动的交易机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.2190 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.10%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.2085 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.52%；同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年一季度，内外部环境将面临一定压力。国内疫情反复影响消费复苏，地产增速持续回落，对 GDP 增速形成了一定考验。所以，稳增长将是目前的主要政策方向。外部环境，目前海外生产有序复苏，国内出口相对减弱。市场方面，由于赛道股的预期已经给的比较充分，短期空间有限，面临调整。且成长在过去三年表现占优，价值股目前估值处于历史低位，在稳增长的预期下部分行业将有所表现，比如地产链相关公司，但后续还得看政策实施力度情况。整体上来

看，我们认为市场今年将以震荡为主，短期大盘价值占优，中期来看将是成长主导，碳中和、科技、高端制造仍将是未来的产业升级方向，是重点关注领域。本基金将继续重视公司的盈利，困境反转，企业质量，同时关注事件驱动以及分析师预期等方式，来产生更多的阿尔法。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审

	计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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</p>

	告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	邓雯
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号，东方广场安永大楼16层	
审计报告日期	2022年03月24日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

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	7,403,277.23	27,885,895.04
结算备付金		10,390,693.69	20,869,846.96
存出保证金		18,507,356.06	40,977,717.51
交易性金融资产	7.4.7.2	184,457,076.95	409,640,550.10
其中：股票投资		163,425,732.06	361,034,604.16
基金投资		-	-
债券投资		21,031,344.89	48,605,945.94
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	10,000,000.00	25,000,000.00
应收证券清算款		-	213,238.57
应收利息	7.4.7.5	266,429.18	1,139,230.76
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		231,024,833.11	525,726,478.94
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		-	22,000,000.00

应付证券清算款		3,586,460.73	16,135,920.99
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		295,111.81	823,443.55
应付托管费		73,777.96	96,114.95
应付销售服务费		55,381.04	103,625.62
应付交易费用	7.4.7.7	1,268,669.22	419,892.28
应交税费		20.82	0.53
应付利息		-	16,056.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	170,000.00	160,000.00
负债合计		5,449,421.58	39,755,054.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	185,379,494.39	407,641,712.67
未分配利润	7.4.7.10	40,195,917.14	78,329,711.90
所有者权益合计		225,575,411.53	485,971,424.57
负债和所有者权益总计		231,024,833.11	525,726,478.94

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 185,379,494.39 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额为 146,662,333.05 份，基金份额净值 1.2190 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额总额为 38,717,161.34 份，基金份额净值 1.2085 元。

7.2 利润表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

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		29,823,509.64	46,161,401.44
1. 利息收入		5,392,210.65	2,900,154.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	503,464.23	291,107.54
债券利息收入		3,194,118.98	1,123,115.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,694,627.44	1,485,931.84
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,957,754.46	33,268,177.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	65,398,310.24	54,750,774.69
基金投资收益	-	-	-

债券投资收益	7.4.7.13	361,788.50	-529,288.80
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	-35,155,124.27	-23,037,472.68
股利收益	7.4.7.17	4,352,779.99	2,084,164.07
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.18	-10,946,232.16	9,782,280.63
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	419,776.69	210,788.71
减: 二、费用		21,334,621.23	9,084,767.43
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,241,628.20	5,461,495.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,423,297.24	666,730.62
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,363,537.67	501,009.89
4. 交易费用	7.4.7.20	10,834,288.55	1,804,762.14
5. 利息支出		296,140.02	470,202.40
其中: 卖出回购金融资产支出		296,140.02	470,202.40
6. 税金及附加		6.05	16,735.81
7. 其他费用	7.4.7.21	175,723.50	163,830.60
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		8,488,888.41	37,076,634.01
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		8,488,888.41	37,076,634.01

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

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)	407,641,712.67	78,329,711.90	485,971,424.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	8,488,888.41	8,488,888.41
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)	-222,262,218.28	-46,622,683.17	-268,884,901.45
其中: 1. 基金申购款	304,437,183.08	65,150,132.94	369,587,316.02

2. 基金赎回款	-526,699,401.36	-111,772,816.11	-638,472,217.47
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)	185,379,494.39	40,195,917.14	225,575,411.53
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)	99,748,397.41	3,450,524.50	103,198,921.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	37,076,634.01	37,076,634.01
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)	307,893,315.26	37,802,553.39	345,695,868.65
其中：1. 基金申购款	459,943,793.55	61,464,388.31	521,408,181.86
2. 基金赎回款	-152,050,478.29	-23,661,834.92	-175,712,313.21
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)	407,641,712.67	78,329,711.90	485,971,424.57

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：

刘入领	范瑛	苗杨
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金(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”)于2015年11月20日下发的中国证监会证监许可[2015]2684号文“关于准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复”的核准,由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,以定期开放方式运行,存续期限不定。本基金募集期间为2017年11月1日至2017年11月30日,募集结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2017)验字60962175_H11号验资报告。

经向中国证监会备案,《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 10,298,649.48 份,其中认购资金利息折合 143.77 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司,注册登记机构为安信基金管理有限责任公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人安信基金管理有限责任公司于 2020 年 5 月 28 日发布的《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》以及更新的《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,经本基金管理人与基金托管人招商银行股份有限公司协商一致,本基金自 2020 年 6 月 12 日起增加 C 类份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、且不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类份额和 C 类份额分别设置代码,分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括:股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证),股指期货、权证,债券(国债、金融债、企业(公司)债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 100%。开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。在封闭期内,本基金不受上述 5%的限制。

本基金的业绩比较基准为:一年期银行定期存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产分类

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

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

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

(2) 金融负债分类

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

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

初始确认

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

后续计量

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

终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

金融资产转移

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

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

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

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

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

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

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

衍生工具收益是指持有的股指期货合约平仓和到期交割实现的收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用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。

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

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

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

7.4.6.2 企业所得税

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

7.4.6.3 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70

号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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

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

7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为 20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	7,403,277.23	27,885,895.04
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	7,403,277.23	27,885,895.04

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	160,892,148.05	163,425,732.06	2,533,584.01
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	21,043,927.75	21,031,344.89
	银行间市场	-	-
	合计	21,043,927.75	21,031,344.89
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	181,936,075.80	184,457,076.95	2,521,001.15
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	322,529,763.47	361,034,604.16	38,504,840.69
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	48,761,629.05	48,605,945.94
	银行间市场	-	-
	合计	48,761,629.05	48,605,945.94
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	371,291,392.52	409,640,550.10	38,349,157.58

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	-141,734,305.96	-	-	-
其中：股指期货投资	-141,734,305.96	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-141,734,305.96	-	-	-
项目	上年度末 2020年12月31日			备注
	合同/名义	公允价值		

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-340,296,780.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-340,296,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-340,296,780.00	-	-	-

注：1、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为 0。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 52 手 IF2203 卖出合约，合约市值-77,229,360.00 元；3 手 IC2202 卖出合约，合约市值-4,410,360.00 元；40 手 IC2201 卖出合约，合约市值-59,022,400.00 元。

2、买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	818.12	3,467.98
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	6,327.75	11,354.11
应收债券利息	259,105.55	1,128,875.37
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-4,536.99
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	177.76	70.29
合计	266,429.18	1,139,230.76

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,268,669.22	419,892.28
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,268,669.22	419,892.28

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付审计费	50,000.00	40,000.00
合计	170,000.00	160,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	205,140,936.34	205,140,936.34
本期申购	227,762,655.44	227,762,655.44
本期赎回（以“-”号填列）	-286,241,258.73	-286,241,258.73
本期末	146,662,333.05	146,662,333.05

安信阿尔法定开混合 C

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日
----	-----------------------------

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	202,500,776.33	202,500,776.33
本期申购	76,674,527.64	76,674,527.64
本期赎回（以“-”号填列）	-240,458,142.63	-240,458,142.63
本期末	38,717,161.34	38,717,161.34

注：申购份额含转换入份额，赎回份额含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,874,650.37	9,905,043.45	39,779,693.82
本期利润	13,682,371.43	-8,001,010.74	5,681,360.69
本期基金份额交易产生的变动数	-17,545,611.59	4,207,925.54	-13,337,686.05
其中：基金申购款	31,266,284.04	17,535,782.37	48,802,066.41
基金赎回款	-48,811,895.63	-13,327,856.83	-62,139,752.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,011,410.21	6,111,958.25	32,123,368.46

安信阿尔法定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	28,775,718.63	9,774,299.45	38,550,018.08
本期利润	5,752,749.14	-2,945,221.42	2,807,527.72
本期基金份额交易产生的变动数	-28,073,000.99	-5,211,996.13	-33,284,997.12
其中：基金申购款	10,342,914.78	6,005,151.75	16,348,066.53
基金赎回款	-38,415,915.77	-11,217,147.88	-49,633,063.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,455,466.78	1,617,081.90	8,072,548.68

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	87,301.58	103,952.90
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	410,861.93	186,146.71
其他	5,300.72	1,007.93
合计	503,464.23	291,107.54

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	4,770,087,903.72	648,003,868.26
减：卖出股票成本总额	4,704,689,593.48	593,253,093.57
买卖股票差价收入	65,398,310.24	54,750,774.69

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	256,112,388.12	153,012,680.44
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	252,539,115.72	149,952,466.32
减：应收利息总额	3,211,483.90	3,589,502.92
买卖债券差价收入	361,788.50	-529,288.80

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资产生的衍生工具收益	-35,155,124.27	-23,037,472.68
合计	-35,155,124.27	-23,037,472.68

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,352,779.99	2,084,164.07
其中：证券出借权益补偿收入	-	-

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,352,779.99	2,084,164.07

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年12月31日
1. 交易性金融资产	-35,828,156.43	32,340,871.57
股票投资	-35,971,256.68	32,499,752.52
债券投资	143,100.25	-158,880.95
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	24,881,924.27	-22,558,590.94
权证投资	-	-
股指期货	24,881,924.27	-22,558,590.94
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	-10,946,232.16	9,782,280.63

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	412,914.26	210,512.29
基金转换费收入	6,862.43	183.64
其他	-	92.78
合计	419,776.69	210,788.71

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	10,834,288.55	1,804,762.14
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,834,288.55	1,804,762.14

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	50,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	5,723.50	3,830.60
合计	175,723.50	163,830.60

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

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 (%)
安信证券	4,297,243,244.89	46.28	350,242,858.83	24.04

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

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 (%)
安信证券	1,337,738.48	27.38	172,747.55	13.62
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 (%)
安信证券	109,036.79	12.17	64,541.58	15.37

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	7,241,628.20
其中：支付销售机构的客户维护费	1,537,253.05	1,060,832.92

注：1) 基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2) 基金管理人可在满足合同约定的条件时提取附加管理费。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	1,423,297.24

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	301,037.54	301,037.54
安信证券	-	666.62	666.62
合计	-	301,704.16	301,704.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	44,089.72	44,089.72
安信证券	-	97.49	97.49
合计	-	44,187.21	44,187.21

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.60%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日(2017年12月6日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.39%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年6月12日(基金合同生效日)至2020年12月31日
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日(2017年12月6日)持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.45%	-

注：本基金管理人运用自有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	7,403,277.23	87,301.58	27,885,895.04	103,952.90

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-

300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年02月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年01月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年01月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021年7月	2022年1月	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-

		21 日	28 日							
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年02月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年02月28日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年02月28日	新股锁定	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301056	森赫	2021	2022	新股锁	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-

	股份	年 8 月 27 日	年 3 月 7 日	定						
301058	中粮 工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股锁 定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三 江	2021 年 9 月 3 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁 定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫 医学	2021 年 9 月 6 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁 定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海 艾录	2021 年 9 月 7 日	2022 年 3 月 14 日	新股锁 定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅 股份	2021 年 9 月 9 日	2022 年 3 月 24 日	新股锁 定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地 海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁 定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛 新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股锁 定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301078	孩子 王	2021 年 9 月 30 日	2022 年 4 月 14 日	新股锁 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳 液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301082	久盛 电气	2021 年 10 月 14 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁 定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜 智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股锁 定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚 医疗	2021 年 10 月 15 日	2022 年 4 月 25 日	新股锁 定	93.09	75.34	300	27,927.00	22,602.00	-
301088	戎美 股份	2021 年 10	2022 年 4 月	新股锁 定	33.16	24.67	493	16,347.88	12,162.31	-

		月 19 日	28 日							
301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	新股锁定	10.45	11.22	1,757	18,360.65	19,713.54	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新股锁定	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新股锁定	58.08	49.85	315	18,295.20	15,702.75	-
301096	百诚医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新股锁定	79.60	78.53	150	11,940.00	11,779.50	-
301098	金埔园林	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 12 日	新股锁定	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301099	雅创电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	新股锁定	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301100	风光股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股锁定	27.81	31.14	487	13,543.47	15,165.18	-
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新股锁定	57.27	53.71	194	11,110.38	10,419.74	-

301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股锁定	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,155	13,894.65	19,773.60	-
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	156	13,425.36	14,742.00	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	280	12,317.20	14,215.60	-
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股锁定	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021年11月4日	2022年5月11日	新股锁定	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	541	15,066.85	14,855.86	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-

		日								
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股锁定	25.80	33.65	832	21,465.60	27,996.80	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	244	17,053.16	21,647.68	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688038	中科通达	2021年7月5日	2022年1月13日	新股锁定	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
688227	品高股份	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	37.09	30.76	3,643	135,118.87	112,058.68	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年7月6日	新股锁定	41.98	41.98	2,043	85,765.14	85,765.14	-
688285	高铁电气	2021年10月12日	2022年4月20日	新股锁定	7.18	9.14	15,159	108,841.62	138,553.26	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021年12月29日	2022年01月14日	新债未上市	100.00	100.00	1,970	196,997.41	196,997.41	-
113052	兴业转债	2021年12月27日	2022年01月14日	配债未上市	100.00	100.00	510	50,999.78	50,999.78	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	11,303,390.00	36,196,380.00
合计	11,303,390.00	36,196,380.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	247,997.19	225,997.03
AAA 以下	-	43,999.81
未评级	9,479,957.70	12,139,569.10
合计	9,727,954.89	12,409,565.94

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	7,403,277.23	-	-	-	7,403,277.23
结算备付金	10,390,693.69	-	-	-	10,390,693.69
存出保证金	18,507,356.06	-	-	-	18,507,356.06
交易性金融资产	11,643,847.70	9,139,500.00	247,997.19	163,425,732.06	184,457,076.95
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
应收利息	-	-	-	266,429.18	266,429.18
资产总计	57,945,174.68	9,139,500.00	247,997.19	163,692,161.24	231,024,833.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	295,111.81	295,111.81
应付托管费	-	-	-	73,777.96	73,777.96
应付证券清算款	-	-	-	3,586,460.73	3,586,460.73
应付销售服务费	-	-	-	55,381.04	55,381.04
应付交易费用	-	-	-	1,268,669.22	1,268,669.22
应交税费	-	-	-	20.82	20.82
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	5,449,421.58	5,449,421.58
利率敏感度缺口	57,945,174.68	9,139,500.00	247,997.19	158,242,739.66	225,575,411.53
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	27,885,895.04	-	-	-	27,885,895.04
结算备付金	20,869,846.96	-	-	-	20,869,846.96
存出保证金	40,977,717.51	-	-	-	40,977,717.51
交易性金融资产	36,196,380.00	12,139,569.10	269,996.84	361,034,604.16	409,640,550.10
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	25,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,139,230.76	1,139,230.76
应收证券清算款	-	-	-	213,238.57	213,238.57
资产总计	150,929,839.51	12,139,569.10	269,996.84	362,387,073.49	525,726,478.94
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	823,443.55	823,443.55
应付托管费	-	-	-	96,114.95	96,114.95
应付证券清算款	-	-	-	16,135,920.99	16,135,920.99
卖出回购金融资产款	22,000,000.00	-	-	-	22,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	103,625.62	103,625.62
应付交易费用	-	-	-	419,892.28	419,892.28
应付利息	-	-	-	16,056.45	16,056.45
应交税费	-	-	-	0.53	0.53
其他负债	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	22,000,000.00	-	-	17,755,054.37	39,755,054.37
利率敏感度缺口	128,929,839.51	12,139,569.10	269,996.84	344,632,019.12	485,971,424.57

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	41,608.35	45,685.93
	2. 市场利率上升 25 个基点	-41,406.87	-45,402.47

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计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。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	163,425,732.06	72.45	361,034,604.16	74.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	163,425,732.06	72.45	361,034,604.16	74.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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）	
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	7,850,553.22	19,362,171.88
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-7,850,553.22	-19,362,171.88

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.2 其他事项

(1) 公允价值

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

各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 160,444,394.73 元，划分为第二层次的余额为人民币 24,012,682.22 元，无划分为第三层次余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币

355,685,225.84 元,划分为第二层次的余额为人民币 53,955,324.26 元,无划分为第三层次余额)。

公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

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

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

第三层次公允价值余额和本期变动金额

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

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

7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 24 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	163,425,732.06	70.74
	其中:股票	163,425,732.06	70.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,031,344.89	9.10
	其中:债券	21,031,344.89	9.10
	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	10,000,000.00	4.33

	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	17,793,970.92	7.70
8	其他各项资产	18,773,785.24	8.13
9	合计	231,024,833.11	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	529,825.00	0.23
B	采矿业	3,688,080.00	1.63
C	制造业	103,628,615.64	45.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,073,671.00	1.81
E	建筑业	3,985,267.22	1.77
F	批发和零售业	3,044,022.77	1.35
G	交通运输、仓储和邮政业	5,241,423.00	2.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,679,378.37	4.73
J	金融业	16,138,290.64	7.15
K	房地产业	3,769,327.98	1.67
L	租赁和商务服务业	2,219,182.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	1,884,649.76	0.84
N	水利、环境和公共设施管理业	580,972.31	0.26
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	659,866.78	0.29
R	文化、体育和娱乐业	2,776,464.59	1.23
S	综合	526,695.00	0.23
	合计	163,425,732.06	72.45

8.2.2 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股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	2,200	4,510,000.00	2.00
2	300750	宁德时代	4,500	2,646,000.00	1.17

3	002142	宁波银行	51,774	1,981,908.72	0.88
4	601728	中国电信	415,111	1,773,789.97	0.79
5	000858	五粮液	7,500	1,669,950.00	0.74
6	601012	隆基股份	16,536	1,425,403.20	0.63
7	002371	北方华创	3,600	1,249,272.00	0.55
8	300059	东方财富	32,172	1,193,902.92	0.53
9	601888	中国中免	5,400	1,184,814.00	0.53
10	300630	普利制药	21,200	1,166,848.00	0.52
11	600030	中信证券	43,700	1,154,117.00	0.51
12	600690	海尔智家	36,200	1,082,018.00	0.48
13	601633	长城汽车	21,300	1,033,902.00	0.46
14	002415	海康威视	19,700	1,030,704.00	0.46
15	600438	通威股份	22,700	1,020,592.00	0.45
16	601318	中国平安	19,700	993,077.00	0.44
17	000156	华数传媒	111,500	943,290.00	0.42
18	600887	伊利股份	22,700	941,142.00	0.42
19	002493	荣盛石化	51,000	926,160.00	0.41
20	000090	天健集团	157,200	922,764.00	0.41
21	000988	华工科技	33,000	919,380.00	0.41
22	600862	中航高科	25,300	904,728.00	0.40
23	600380	健康元	70,400	903,936.00	0.40
24	601138	工业富联	75,200	896,384.00	0.40
25	002129	中环股份	21,100	880,925.00	0.39
26	300759	康龙化成	6,100	861,747.00	0.38
27	600660	福耀玻璃	17,900	843,806.00	0.37
28	002396	星网锐捷	35,700	841,449.00	0.37
29	002049	紫光国微	3,700	832,500.00	0.37
30	000002	万科A	41,900	827,944.00	0.37
31	002050	三花智控	32,700	827,310.00	0.37
32	300122	智飞生物	6,500	809,900.00	0.36
33	300316	晶盛机电	11,600	806,200.00	0.36
34	601877	正泰电器	14,500	781,405.00	0.35
35	000725	京东方A	152,800	771,640.00	0.34
36	603806	福斯特	5,800	757,190.00	0.34
37	600170	上海建工	202,500	729,000.00	0.32
38	300347	泰格医药	5,700	728,460.00	0.32
39	603606	东方电缆	13,800	706,008.00	0.31
40	300432	富临精工	23,800	699,720.00	0.31
41	000333	美的集团	9,375	691,968.75	0.31
42	600809	山西汾酒	2,180	688,400.40	0.31
43	000568	泸州老窖	2,700	685,449.00	0.30
44	600765	中航重机	13,500	681,615.00	0.30

45	002594	比亚迪	2,500	670,300.00	0.30
46	601228	广州港	197,000	656,010.00	0.29
47	002352	顺丰控股	9,500	654,740.00	0.29
48	600529	山东药玻	14,800	649,720.00	0.29
49	600018	上港集团	117,500	643,900.00	0.29
50	300699	光威复材	7,600	642,048.00	0.28
51	000778	新兴铸管	147,500	638,675.00	0.28
52	600171	上海贝岭	24,800	636,368.00	0.28
53	600339	中油工程	205,500	632,940.00	0.28
54	002065	东华软件	80,900	631,020.00	0.28
55	002268	卫士通	11,237	628,597.78	0.28
56	600845	宝信软件	10,300	626,549.00	0.28
57	300014	亿纬锂能	5,300	626,354.00	0.28
58	600309	万华化学	6,200	626,200.00	0.28
59	002434	万里扬	42,400	624,976.00	0.28
60	600728	佳都科技	74,700	622,251.00	0.28
61	601801	皖新传媒	119,100	618,129.00	0.27
62	603799	华友钴业	5,600	617,736.00	0.27
63	600160	巨化股份	47,500	613,225.00	0.27
64	601288	农业银行	207,900	611,226.00	0.27
65	603659	璞泰来	3,800	610,318.00	0.27
66	002946	新乳业	38,100	607,314.00	0.27
67	600325	华发股份	100,540	605,250.80	0.27
68	688002	睿创微纳	7,700	604,989.00	0.27
69	600120	浙江东方	135,600	599,352.00	0.27
70	601992	金隅集团	209,800	595,832.00	0.26
71	600183	生益科技	25,300	595,815.00	0.26
72	688029	南微医学	2,800	595,476.00	0.26
73	600019	宝钢股份	83,100	594,996.00	0.26
74	601899	紫金矿业	61,000	591,700.00	0.26
75	600383	金地集团	45,600	591,432.00	0.26
76	603833	欧派家居	4,000	590,000.00	0.26
77	600521	华海药业	27,200	589,152.00	0.26
78	603650	彤程新材	11,700	588,744.00	0.26
79	600900	长江电力	25,900	587,930.00	0.26
80	603712	七一二	13,400	580,220.00	0.26
81	300474	景嘉微	3,800	578,360.00	0.26
82	601601	中国太保	21,200	574,944.00	0.25
83	600111	北方稀土	12,500	572,500.00	0.25
84	000661	长春高新	2,100	569,940.00	0.25
85	600085	同仁堂	12,600	566,748.00	0.25
86	601928	凤凰传媒	69,800	564,682.00	0.25

87	601668	中国建筑	111,900	559,500.00	0.25
88	601766	中国中车	91,200	555,408.00	0.25
89	300037	新宙邦	4,900	553,700.00	0.25
90	002812	恩捷股份	2,200	550,880.00	0.24
91	000063	中兴通讯	16,400	549,400.00	0.24
92	600048	保利发展	35,000	547,050.00	0.24
93	002368	太极股份	19,800	545,292.00	0.24
94	002460	赣锋锂业	3,800	542,830.00	0.24
95	002815	崇达技术	32,100	540,885.00	0.24
96	300680	隆盛科技	17,300	539,760.00	0.24
97	002475	立讯精密	10,900	536,280.00	0.24
98	600760	中航沈飞	7,800	530,712.00	0.24
99	601166	兴业银行	27,800	529,312.00	0.23
100	002311	海大集团	7,200	527,760.00	0.23
101	000009	中国宝安	36,500	526,695.00	0.23
102	600536	中国软件	10,400	519,272.00	0.23
103	600132	重庆啤酒	3,400	514,488.00	0.23
104	002736	国信证券	44,400	509,712.00	0.23
105	300382	斯莱克	21,500	495,360.00	0.22
106	600219	南山铝业	105,100	495,021.00	0.22
107	600016	民生银行	126,700	494,130.00	0.22
108	002010	传化智联	56,100	488,070.00	0.22
109	600732	爱旭股份	20,700	483,552.00	0.21
110	002709	天赐材料	4,200	481,530.00	0.21
111	300628	亿联网络	5,900	480,555.00	0.21
112	603077	和邦生物	140,900	480,469.00	0.21
113	000651	格力电器	12,900	477,687.00	0.21
114	300294	博雅生物	12,400	475,540.00	0.21
115	600872	中炬高新	12,500	474,625.00	0.21
116	603369	今世缘	8,700	473,280.00	0.21
117	300450	先导智能	6,360	472,993.20	0.21
118	600377	宁沪高速	54,200	467,204.00	0.21
119	002241	歌尔股份	8,600	465,260.00	0.21
120	603613	国联股份	4,300	462,250.00	0.20
121	002916	深南电路	3,700	450,734.00	0.20
122	603517	绝味食品	6,500	444,145.00	0.20
123	603986	兆易创新	2,500	439,625.00	0.19
124	603501	韦尔股份	1,400	435,078.00	0.19
125	600801	华新水泥	22,400	432,320.00	0.19
126	002252	上海莱士	62,400	425,568.00	0.19
127	600959	江苏有线	127,600	419,804.00	0.19
128	688012	中微公司	3,300	417,780.00	0.19

129	601398	工商银行	89,600	414,848.00	0.18
130	000938	紫光股份	18,100	413,585.00	0.18
131	300558	贝达药业	5,100	407,133.00	0.18
132	601958	金钼股份	58,600	401,410.00	0.18
133	002701	奥瑞金	57,300	401,100.00	0.18
134	000883	湖北能源	75,700	396,668.00	0.18
135	002304	洋河股份	2,400	395,352.00	0.18
136	002821	凯莱英	900	391,500.00	0.17
137	601808	中海油服	25,700	385,500.00	0.17
138	601211	国泰君安	21,200	379,268.00	0.17
139	300124	汇川技术	5,500	377,300.00	0.17
140	002244	滨江集团	80,900	376,994.00	0.17
141	002273	水晶光电	21,000	365,190.00	0.16
142	603486	科沃斯	2,400	362,280.00	0.16
143	002271	东方雨虹	6,800	358,224.00	0.16
144	002624	完美世界	17,600	357,456.00	0.16
145	000100	TCL 科技	57,400	354,158.00	0.16
146	600436	片仔癀	800	349,720.00	0.16
147	002001	新 和 成	11,200	348,544.00	0.15
148	688005	容百科技	3,000	346,740.00	0.15
149	300253	卫宁健康	20,500	343,580.00	0.15
150	300777	中简科技	5,500	340,340.00	0.15
151	000887	中鼎股份	15,300	333,693.00	0.15
152	002212	天融信	17,400	333,558.00	0.15
153	002867	周大生	18,700	332,486.00	0.15
154	600426	华鲁恒升	10,600	331,780.00	0.15
155	002518	科士达	13,200	331,320.00	0.15
156	000960	锡业股份	16,800	328,104.00	0.15
157	002223	鱼跃医疗	8,600	325,080.00	0.14
158	000039	中集集团	18,700	320,892.00	0.14
159	603260	合盛硅业	2,400	316,728.00	0.14
160	603288	海天味业	3,000	315,330.00	0.14
161	002120	韵达股份	15,400	315,084.00	0.14
162	600585	海螺水泥	7,800	314,340.00	0.14
163	600705	中航产融	78,600	312,042.00	0.14
164	601658	邮储银行	60,500	308,550.00	0.14
165	000999	华润三九	9,000	308,160.00	0.14
166	300418	昆仑万维	13,300	307,895.00	0.14
167	601717	郑煤机	26,500	307,135.00	0.14
168	600803	新奥股份	16,700	306,612.00	0.14
169	300182	捷成股份	48,400	306,372.00	0.14
170	601985	中国核电	36,900	306,270.00	0.14

171	000012	南 玻 A	30,700	304,851.00	0.14
172	600062	华润双鹤	22,800	304,836.00	0.14
173	600271	航天信息	22,600	302,614.00	0.13
174	601156	东航物流	13,800	301,944.00	0.13
175	688586	江航装备	8,900	301,710.00	0.13
176	002019	亿帆医药	17,100	301,302.00	0.13
177	002281	光迅科技	12,900	300,441.00	0.13
178	600037	歌华有线	34,600	300,328.00	0.13
179	002768	国恩股份	11,600	299,976.00	0.13
180	600582	天地科技	68,400	299,592.00	0.13
181	688099	晶晨股份	2,300	299,460.00	0.13
182	600446	金证股份	20,900	299,288.00	0.13
183	601328	交通银行	64,800	298,728.00	0.13
184	601688	华泰证券	16,800	298,368.00	0.13
185	601225	陕西煤业	24,400	297,680.00	0.13
186	603225	新凤鸣	20,000	297,000.00	0.13
187	600623	华谊集团	32,600	296,660.00	0.13
188	002408	齐翔腾达	28,200	296,100.00	0.13
189	688289	圣湘生物	5,000	295,000.00	0.13
190	600415	小商品城	60,700	294,395.00	0.13
191	002078	太阳纸业	25,500	292,995.00	0.13
192	688055	龙腾光电	42,700	292,495.00	0.13
193	600153	建发股份	32,200	292,054.00	0.13
194	002422	科伦药业	15,400	291,522.00	0.13
195	600755	厦门国贸	40,400	291,284.00	0.13
196	002430	杭氧股份	9,700	291,097.00	0.13
197	600885	宏发股份	3,900	291,096.00	0.13
198	600667	太极实业	36,000	290,880.00	0.13
199	002465	海格通信	26,600	290,472.00	0.13
200	603256	宏和科技	33,900	290,184.00	0.13
201	600511	国药股份	9,200	290,076.00	0.13
202	600998	九州通	19,700	289,984.00	0.13
203	300070	碧水源	40,300	289,757.00	0.13
204	603566	普莱柯	13,100	289,510.00	0.13
205	601598	中国外运	64,600	289,408.00	0.13
206	002745	木林森	19,100	288,983.00	0.13
207	002636	金安国纪	19,200	288,960.00	0.13
208	002233	塔牌集团	27,300	288,834.00	0.13
209	600008	首创环保	84,700	288,827.00	0.13
210	002429	兆驰股份	59,400	288,684.00	0.13
211	000685	中山公用	32,600	288,510.00	0.13
212	002690	美亚光电	7,700	288,442.00	0.13

213	001965	招商公路	37,600	288,392.00	0.13
214	002004	华邦健康	39,800	288,152.00	0.13
215	002410	广联达	4,500	287,910.00	0.13
216	600820	隧道股份	53,500	287,830.00	0.13
217	600528	中铁工业	35,000	287,350.00	0.13
218	603927	中科软	10,500	287,280.00	0.13
219	600517	国网英大	39,400	287,226.00	0.13
220	603877	太平鸟	10,300	287,164.00	0.13
221	600968	海油发展	98,000	287,140.00	0.13
222	601139	深圳燃气	32,500	286,975.00	0.13
223	000060	中金岭南	58,400	286,744.00	0.13
224	600567	山鹰国际	87,100	286,559.00	0.13
225	601000	唐山港	104,200	286,550.00	0.13
226	603515	欧普照明	13,800	286,488.00	0.13
227	000581	威孚高科	13,300	286,482.00	0.13
228	002555	三七互娱	10,600	286,412.00	0.13
229	600297	广汇汽车	107,200	286,224.00	0.13
230	601568	北元集团	35,200	286,176.00	0.13
231	000709	河钢股份	116,300	286,098.00	0.13
232	002595	豪迈科技	10,300	285,928.00	0.13
233	601880	辽港股份	165,100	285,623.00	0.13
234	000513	丽珠集团	7,100	285,491.00	0.13
235	600704	物产中大	48,200	285,344.00	0.13
236	002423	中粮资本	35,200	285,120.00	0.13
237	600919	江苏银行	48,900	285,087.00	0.13
238	000990	诚志股份	18,000	284,760.00	0.13
239	002203	海亮股份	22,900	284,647.00	0.13
240	002081	金螳螂	46,800	284,544.00	0.13
241	000598	兴蓉环境	45,000	284,400.00	0.13
242	600022	山东钢铁	158,700	284,073.00	0.13
243	601066	中信建投	9,700	283,725.00	0.13
244	600903	贵州燃气	29,200	282,656.00	0.13
245	601600	中国铝业	46,300	281,967.00	0.12
246	300223	北京君正	2,100	281,400.00	0.12
247	000690	宝新能源	47,500	281,200.00	0.12
248	600157	永泰能源	154,500	281,190.00	0.12
249	603355	莱克电气	9,500	278,540.00	0.12
250	601916	浙商银行	79,500	278,250.00	0.12
251	601989	中国重工	65,900	278,098.00	0.12
252	300274	阳光电源	1,900	277,020.00	0.12
253	300601	康泰生物	2,800	275,912.00	0.12
254	601939	建设银行	46,300	271,318.00	0.12

255	601881	中国银河	24,000	268,560.00	0.12
256	002230	科大讯飞	5,100	267,801.00	0.12
257	600600	青岛啤酒	2,700	267,300.00	0.12
258	603882	金城医学	2,400	267,288.00	0.12
259	603786	科博达	3,300	264,990.00	0.12
260	600958	东方证券	17,700	260,898.00	0.12
261	600282	南钢股份	70,100	259,370.00	0.11
262	300408	三环集团	5,800	258,680.00	0.11
263	600795	国电电力	81,300	257,721.00	0.11
264	002568	百润股份	4,300	257,269.00	0.11
265	601009	南京银行	28,600	256,256.00	0.11
266	000001	平安银行	15,300	252,144.00	0.11
267	000538	云南白药	2,400	251,160.00	0.11
268	000826	启迪环境	56,200	250,090.00	0.11
269	600332	白云山	7,300	249,660.00	0.11
270	000069	华侨城A	35,200	247,808.00	0.11
271	000596	古井贡酒	1,000	244,000.00	0.11
272	600570	恒生电子	3,900	242,385.00	0.11
273	000338	潍柴动力	13,400	239,726.00	0.11
274	601390	中国中铁	41,400	239,706.00	0.11
275	601155	新城控股	7,886	229,719.18	0.10
276	600926	杭州银行	17,900	229,478.00	0.10
277	300760	迈瑞医疗	600	228,480.00	0.10
278	601857	中国石油	46,100	226,351.00	0.10
279	300413	芒果超媒	3,900	223,158.00	0.10
280	600456	宝钛股份	3,100	222,518.00	0.10
281	601238	广汽集团	14,500	220,255.00	0.10
282	600999	招商证券	12,400	218,860.00	0.10
283	300745	欣锐科技	3,400	218,280.00	0.10
284	300595	欧普康视	3,800	218,006.00	0.10
285	601236	红塔证券	18,200	216,944.00	0.10
286	601006	大秦铁路	33,700	215,680.00	0.10
287	601901	方正证券	27,500	215,600.00	0.10
288	601169	北京银行	48,500	215,340.00	0.10
289	000166	申万宏源	42,000	215,040.00	0.10
290	600050	中国联通	54,500	214,185.00	0.09
291	603456	九洲药业	3,800	213,788.00	0.09
292	601988	中国银行	70,000	213,500.00	0.09
293	000895	双汇发展	6,700	211,385.00	0.09
294	601898	中煤能源	33,500	210,715.00	0.09
295	300015	爱尔眼科	4,900	207,172.00	0.09
296	601319	中国人保	44,000	206,800.00	0.09

297	002860	星帅尔	8,400	204,960.00	0.09
298	600779	水井坊	1,700	203,983.00	0.09
299	603317	天味食品	7,600	203,756.00	0.09
300	002714	牧原股份	3,800	202,768.00	0.09
301	603899	晨光文具	3,100	199,981.00	0.09
302	600499	科达制造	8,000	198,560.00	0.09
303	000876	新希望	13,000	197,730.00	0.09
304	600893	航发动力	3,000	190,380.00	0.08
305	600176	中国巨石	10,300	187,460.00	0.08
306	603915	国茂股份	4,800	186,720.00	0.08
307	300433	蓝思科技	8,000	183,840.00	0.08
308	603185	上机数控	1,100	183,678.00	0.08
309	600482	中国动力	9,300	183,210.00	0.08
310	002556	辉隆股份	14,200	182,754.00	0.08
311	002299	圣农发展	7,500	181,275.00	0.08
312	002500	山西证券	27,400	180,840.00	0.08
313	002236	大华股份	7,700	180,796.00	0.08
314	600662	外服控股	25,100	179,716.00	0.08
315	600497	驰宏锌锗	35,300	176,147.00	0.08
316	002841	视源股份	2,158	175,661.20	0.08
317	688083	中望软件	500	174,915.00	0.08
318	688396	华润微	2,700	174,420.00	0.08
319	600399	抚顺特钢	6,700	165,959.00	0.07
320	688019	安集科技	600	163,920.00	0.07
321	688007	光峰科技	4,700	161,445.00	0.07
322	300896	爱美客	300	160,833.00	0.07
323	000963	华东医药	4,000	160,800.00	0.07
324	601111	中国国航	17,600	160,688.00	0.07
325	002918	蒙娜丽莎	5,600	160,328.00	0.07
326	002859	洁美科技	4,300	159,960.00	0.07
327	002263	大东南	40,900	159,919.00	0.07
328	003021	兆威机电	2,000	159,700.00	0.07
329	603707	健友股份	3,800	159,600.00	0.07
330	300415	伊之密	7,500	159,300.00	0.07
331	600702	舍得酒业	700	159,110.00	0.07
332	000807	云铝股份	14,200	158,614.00	0.07
333	000930	中粮科技	14,500	157,615.00	0.07
334	300394	天孚通信	4,300	157,380.00	0.07
335	603181	皇马科技	8,200	157,276.00	0.07
336	002968	新大正	4,400	155,892.00	0.07
337	002541	鸿路钢构	2,900	155,266.00	0.07
338	300596	利安隆	3,458	154,780.08	0.07

339	603816	顾家家居	2,000	154,320.00	0.07
340	002727	一心堂	4,000	154,040.00	0.07
341	603300	华铁应急	11,300	151,985.00	0.07
342	300657	弘信电子	9,200	151,892.00	0.07
343	000062	深圳华强	8,800	151,624.00	0.07
344	000932	华菱钢铁	29,600	151,256.00	0.07
345	688087	英科再生	1,600	151,136.00	0.07
346	605555	德昌股份	3,700	150,960.00	0.07
347	000739	普洛药业	4,300	150,887.00	0.07
348	002202	金风科技	9,100	149,877.00	0.07
349	000973	佛塑科技	29,000	149,350.00	0.07
350	000425	徐工机械	24,800	148,552.00	0.07
351	600348	华阳股份	12,500	148,125.00	0.07
352	002507	涪陵榨菜	3,900	147,420.00	0.07
353	600933	爱柯迪	7,600	146,528.00	0.06
354	601666	平煤股份	17,500	146,475.00	0.06
355	000800	一汽解放	14,200	146,118.00	0.06
356	601611	中国核建	14,600	145,562.00	0.06
357	001215	千味央厨	2,500	145,525.00	0.06
358	300973	立高食品	1,100	145,288.00	0.06
359	000498	山东路桥	23,500	145,230.00	0.06
360	002545	东方铁塔	15,900	145,008.00	0.06
361	300737	科顺股份	8,900	144,625.00	0.06
362	000987	越秀金控	16,600	144,420.00	0.06
363	002011	盾安环境	10,500	143,850.00	0.06
364	601615	明阳智能	5,500	143,550.00	0.06
365	600717	天津港	33,800	141,622.00	0.06
366	300110	华仁药业	29,400	141,120.00	0.06
367	300982	苏文电能	1,917	141,072.03	0.06
368	603997	继峰股份	8,700	139,896.00	0.06
369	300207	欣旺达	3,300	139,128.00	0.06
370	603233	大参林	3,300	138,963.00	0.06
371	688285	高铁电气	15,159	138,553.26	0.06
372	300755	华致酒行	2,700	135,216.00	0.06
373	600596	新安股份	5,400	134,946.00	0.06
374	002156	通富微电	6,900	134,067.00	0.06
375	601607	上海医药	6,700	133,129.00	0.06
376	600837	海通证券	10,800	132,408.00	0.06
377	300587	天铁股份	6,600	131,802.00	0.06
378	001979	招商蛇口	9,800	130,732.00	0.06
379	000507	珠海港	19,900	128,554.00	0.06
380	688408	中信博	720	127,087.20	0.06

381	600161	天坛生物	4,200	121,632.00	0.05
382	601816	京沪高铁	25,100	121,233.00	0.05
383	002157	正邦科技	12,300	118,818.00	0.05
384	688227	品高股份	3,643	112,058.68	0.05
385	002601	龙佰集团	3,900	111,501.00	0.05
386	600741	华域汽车	3,900	110,370.00	0.05
387	002508	老板电器	3,000	108,060.00	0.05
388	002044	美年健康	13,700	107,545.00	0.05
389	002732	燕塘乳业	4,000	107,360.00	0.05
390	603259	药明康德	900	106,722.00	0.05
391	603638	艾迪精密	3,340	106,612.80	0.05
392	601933	永辉超市	25,500	103,275.00	0.05
393	002027	分众传媒	12,200	99,918.00	0.04
394	600642	申能股份	13,300	98,021.00	0.04
395	600372	中航电子	4,200	94,038.00	0.04
396	603127	昭衍新药	800	92,344.00	0.04
397	600745	闻泰科技	700	90,510.00	0.04
398	603392	万泰生物	400	88,600.00	0.04
399	600025	华能水电	13,400	88,306.00	0.04
400	601878	浙商证券	6,600	86,988.00	0.04
401	688262	国芯科技	2,043	85,765.14	0.04
402	002028	思源电气	1,700	83,657.00	0.04
403	603195	公牛集团	500	83,650.00	0.04
404	601618	中国中冶	21,500	82,345.00	0.04
405	601799	星宇股份	400	81,700.00	0.04
406	600703	三安光电	2,100	78,876.00	0.03
407	600276	恒瑞医药	1,500	76,065.00	0.03
408	000977	浪潮信息	2,000	71,660.00	0.03
409	600588	用友网络	1,900	68,172.00	0.03
410	600547	山东黄金	3,500	65,870.00	0.03
411	601100	恒立液压	800	65,440.00	0.03
412	600606	绿地控股	15,000	65,100.00	0.03
413	600233	圆通速递	3,800	63,384.00	0.03
414	601231	环旭电子	3,800	61,028.00	0.03
415	600763	通策医疗	300	59,700.00	0.03
416	600584	长电科技	1,900	58,938.00	0.03
417	300033	同花顺	400	57,832.00	0.03
418	600346	恒力石化	2,500	57,425.00	0.03
419	002955	鸿合科技	2,600	56,732.00	0.03
420	600848	上海临港	3,800	56,506.00	0.03
421	603087	甘李药业	800	56,272.00	0.02
422	601818	光大银行	16,900	56,108.00	0.02

423	603938	三孚股份	1,500	55,185.00	0.02
424	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.02
425	600655	豫园股份	5,200	53,560.00	0.02
426	601088	中国神华	2,300	51,796.00	0.02
427	002938	鹏鼎控股	1,200	50,916.00	0.02
428	601838	成都银行	4,000	48,000.00	0.02
429	600089	特变电工	2,200	46,574.00	0.02
430	600563	法拉电子	200	46,480.00	0.02
431	600566	济川药业	1,600	45,344.00	0.02
432	300142	沃森生物	800	44,960.00	0.02
433	601698	中国卫通	3,100	44,609.00	0.02
434	002539	云图控股	3,300	43,791.00	0.02
435	000799	酒鬼酒	200	42,500.00	0.02
436	301029	怡合达	462	41,519.94	0.02
437	300088	长信科技	3,100	41,168.00	0.02
438	300573	兴齐眼药	300	41,040.00	0.02
439	000627	天茂集团	12,300	40,713.00	0.02
440	002558	巨人网络	3,400	40,698.00	0.02
441	603338	浙江鼎力	500	40,130.00	0.02
442	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.02
443	002839	张家港行	6,800	39,168.00	0.02
444	600908	无锡银行	6,900	39,123.00	0.02
445	600028	中国石化	9,200	38,916.00	0.02
446	002739	万达电影	2,500	38,700.00	0.02
447	601778	晶科科技	4,500	38,385.00	0.02
448	600460	士兰微	700	37,940.00	0.02
449	600329	中新药业	1,200	37,692.00	0.02
450	002032	苏泊尔	600	37,344.00	0.02
451	300529	健帆生物	700	37,310.00	0.02
452	002064	华峰化学	3,500	36,540.00	0.02
453	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.02
454	600039	四川路桥	3,000	36,120.00	0.02
455	601186	中国铁建	4,600	35,880.00	0.02
456	601336	新华保险	900	34,992.00	0.02
457	300677	英科医疗	600	34,704.00	0.02
458	000776	广发证券	1,400	34,426.00	0.02
459	300115	长盈精密	1,700	33,728.00	0.01
460	603658	安图生物	600	33,036.00	0.01
461	300136	信维通信	1,300	32,916.00	0.01
462	601788	光大证券	2,200	32,846.00	0.01
463	300782	卓胜微	100	32,680.00	0.01
464	000686	东北证券	3,700	32,486.00	0.01

465	000786	北新建材	900	32,247.00	0.01
466	600597	光明乳业	2,200	31,944.00	0.01
467	600115	中国东航	6,100	31,476.00	0.01
468	002075	沙钢股份	5,200	30,316.00	0.01
469	000783	长江证券	4,000	30,160.00	0.01
470	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
471	601865	福莱特	500	28,970.00	0.01
472	688686	奥普特	100	28,217.00	0.01
473	002648	卫星化学	700	28,021.00	0.01
474	301211	亨迪药业	832	27,996.80	0.01
475	002294	信立泰	1,000	27,320.00	0.01
476	002008	大族激光	500	27,000.00	0.01
477	300498	温氏股份	1,400	26,964.00	0.01
478	600737	中粮糖业	2,800	26,320.00	0.01
479	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.01
480	300251	光线传媒	2,000	25,700.00	0.01
481	601636	旗滨集团	1,500	25,650.00	0.01
482	002254	泰和新材	1,300	25,493.00	0.01
483	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
484	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.01
485	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
486	301087	可孚医疗	300	22,602.00	0.01
487	600989	宝丰能源	1,300	22,568.00	0.01
488	002024	苏宁易购	5,300	21,836.00	0.01
489	301221	光庭信息	244	21,647.68	0.01
490	002007	华兰生物	700	20,398.00	0.01
491	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.01
492	600079	人福医药	900	20,268.00	0.01
493	301127	天源环保	1,155	19,773.60	0.01
494	301090	华润材料	1,757	19,713.54	0.01
495	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.01
496	601162	天风证券	4,800	19,440.00	0.01
497	002414	高德红外	800	19,368.00	0.01
498	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.01
499	002459	晶澳科技	200	18,540.00	0.01
500	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
501	300568	星源材质	500	18,365.00	0.01
502	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.01
503	300676	华大基因	200	17,560.00	0.01
504	000625	长安汽车	1,100	16,709.00	0.01
505	600295	鄂尔多斯	700	16,513.00	0.01
506	301091	深城交	524	16,406.44	0.01

507	002409	雅克科技	200	16,234.00	0.01
508	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.01
509	301093	华兰股份	315	15,702.75	0.01
510	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.01
511	301100	风光股份	487	15,165.18	0.01
512	603993	洛阳钼业	2,700	15,066.00	0.01
513	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.01
514	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.01
515	301190	善水科技	541	14,855.86	0.01
516	301166	优宁维	156	14,742.00	0.01
517	601995	中金公司	300	14,709.00	0.01
518	301179	泽宇智能	280	14,215.60	0.01
519	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.01
520	603379	三美股份	600	13,668.00	0.01
521	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.01
522	601669	中国电建	1,600	12,928.00	0.01
523	301138	华研精机	285	12,785.10	0.01
524	000066	中国长城	900	12,744.00	0.01
525	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
526	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.01
527	601168	西部矿业	900	12,249.00	0.01
528	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.01
529	301088	戎美股份	493	12,162.31	0.01
530	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
531	301096	百诚医药	150	11,779.50	0.01
532	301092	争光股份	323	11,472.96	0.01
533	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
534	301108	洁雅股份	194	10,419.74	0.00
535	600029	南方航空	1,500	10,215.00	0.00
536	300144	宋城演艺	700	10,024.00	0.00
537	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
538	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
539	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
540	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
541	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
542	688561	奇安信	100	8,792.00	0.00
543	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
544	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
545	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
546	688599	天合光能	100	7,890.00	0.00
547	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
548	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00

549	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
550	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
551	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
552	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
553	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
554	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
555	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
556	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
557	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
558	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
559	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
560	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
561	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
562	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
563	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
564	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
565	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
566	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
567	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
568	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	83,051,153.86	17.09
2	300059	东方财富	52,982,881.40	10.90
3	000858	五粮液	50,951,831.48	10.48
4	600809	山西汾酒	49,697,826.91	10.23
5	601318	中国平安	49,139,091.36	10.11
6	601398	工商银行	41,460,469.00	8.53
7	601012	隆基股份	38,075,730.18	7.83
8	601166	兴业银行	37,822,368.00	7.78
9	000333	美的集团	36,234,410.58	7.46
10	600887	伊利股份	34,451,728.15	7.09
11	600690	海尔智家	32,093,945.34	6.60
12	000568	泸州老窖	31,297,537.98	6.44
13	002142	宁波银行	31,272,688.05	6.44
14	000651	格力电器	31,084,930.41	6.40
15	300122	智飞生物	30,778,514.05	6.33
16	000001	平安银行	30,409,231.00	6.26
17	603501	韦尔股份	30,236,859.06	6.22

18	000725	京东方 A	30,048,976.00	6.18
19	600309	万华化学	29,889,274.89	6.15
20	002415	海康威视	29,030,342.15	5.97
21	600600	青岛啤酒	28,639,167.00	5.89
22	601888	中国中免	28,572,841.84	5.88
23	600900	长江电力	28,439,566.71	5.85
24	600030	中信证券	28,216,277.56	5.81
25	601899	紫金矿业	27,636,007.59	5.69
26	300015	爱尔眼科	27,525,498.07	5.66
27	600438	通威股份	26,363,630.17	5.42
28	601668	中国建筑	25,647,402.40	5.28
29	300124	汇川技术	24,722,773.22	5.09
30	002304	洋河股份	23,849,867.32	4.91
31	002475	立讯精密	23,570,966.78	4.85
32	000002	万 科 A	23,512,702.64	4.84
33	603259	药明康德	23,477,407.14	4.83
34	600276	恒瑞医药	23,473,314.20	4.83
35	601633	长城汽车	23,444,203.00	4.82
36	601211	国泰君安	23,386,959.24	4.81
37	601628	中国人寿	23,354,286.00	4.81
38	600176	中国巨石	23,284,550.34	4.79
39	601288	农业银行	23,034,540.00	4.74
40	002594	比亚迪	22,545,174.00	4.64
41	600048	保利发展	22,514,100.44	4.63
42	002230	科大讯飞	22,493,950.00	4.63
43	000100	TCL 科技	22,134,578.00	4.55
44	603799	华友钴业	22,012,983.00	4.53
45	300408	三环集团	21,491,670.11	4.42
46	601336	新华保险	20,652,435.42	4.25
47	601601	中国太保	20,438,381.41	4.21
48	600031	三一重工	20,292,617.98	4.18
49	300014	亿纬锂能	20,283,160.75	4.17
50	601688	华泰证券	20,200,301.62	4.16
51	000661	长春高新	19,713,682.51	4.06
52	002049	紫光国微	19,465,294.00	4.01
53	002027	分众传媒	19,395,872.89	3.99
54	002129	中环股份	19,381,436.92	3.99
55	002311	海大集团	18,686,682.94	3.85
56	000063	中兴通讯	18,628,341.71	3.83
57	002714	牧原股份	18,579,762.60	3.82
58	601328	交通银行	18,461,000.00	3.80
59	300529	健帆生物	18,430,735.90	3.79

60	600570	恒生电子	18,275,177.19	3.76
61	601377	兴业证券	18,258,831.50	3.76
62	300750	宁德时代	17,872,316.00	3.68
63	000776	广发证券	17,859,619.34	3.68
64	600660	福耀玻璃	17,851,108.05	3.67
65	002271	东方雨虹	17,508,460.17	3.60
66	603986	兆易创新	17,462,219.00	3.59
67	002179	中航光电	17,279,204.00	3.56
68	300142	沃森生物	17,144,880.00	3.53
69	600837	海通证券	17,089,927.00	3.52
70	002241	歌尔股份	16,921,647.41	3.48
71	600741	华域汽车	16,918,828.00	3.48
72	600763	通策医疗	16,813,791.00	3.46
73	600104	上汽集团	16,726,697.89	3.44
74	601100	恒立液压	16,548,696.79	3.41
75	600999	招商证券	16,378,941.90	3.37
76	601939	建设银行	16,350,183.00	3.36
77	600585	海螺水泥	16,326,889.38	3.36
78	600958	东方证券	16,286,808.68	3.35
79	600893	航发动力	16,225,638.94	3.34
80	601225	陕西煤业	16,114,715.39	3.32
81	600028	中国石化	16,094,214.51	3.31
82	002460	赣锋锂业	16,079,411.00	3.31
83	600019	宝钢股份	15,921,475.20	3.28
84	002812	恩捷股份	15,693,975.50	3.23
85	601390	中国中铁	15,659,602.00	3.22
86	300033	同花顺	15,642,871.12	3.22
87	002601	龙佰集团	15,535,489.00	3.20
88	601009	南京银行	15,534,721.47	3.20
89	600436	片仔癀	15,457,226.28	3.18
90	002493	荣盛石化	15,324,352.42	3.15
91	600919	江苏银行	15,304,002.90	3.15
92	002371	北方华创	15,260,032.93	3.14
93	600383	金地集团	15,181,730.49	3.12
94	601088	中国神华	15,178,179.00	3.12
95	300347	泰格医药	15,090,655.00	3.11
96	601877	正泰电器	14,977,137.42	3.08
97	002508	老板电器	14,798,095.00	3.05
98	002624	完美世界	14,780,605.00	3.04
99	603288	海天味业	14,397,126.08	2.96
100	601838	成都银行	14,246,749.25	2.93
101	600111	北方稀土	13,909,193.72	2.86

102	002821	凯莱英	13,849,489.11	2.85
103	000786	北新建材	13,668,091.40	2.81
104	603833	欧派家居	13,621,208.02	2.80
105	600183	生益科技	13,559,441.46	2.79
106	000977	浪潮信息	13,535,826.00	2.79
107	002236	大华股份	13,309,943.00	2.74
108	600926	杭州银行	13,184,664.00	2.71
109	600845	宝信软件	13,159,350.70	2.71
110	300413	芒果超媒	12,943,882.95	2.66
111	601238	广汽集团	12,922,847.00	2.66
112	600132	重庆啤酒	12,833,751.00	2.64
113	002410	广联达	12,768,289.48	2.63
114	002050	三花智控	12,619,862.47	2.60
115	601985	中国核电	12,340,992.00	2.54
116	002008	大族激光	12,321,030.13	2.54
117	600000	浦发银行	12,205,271.00	2.51
118	600745	闻泰科技	12,142,237.25	2.50
119	300601	康泰生物	12,061,776.56	2.48
120	600196	复星医药	11,937,818.22	2.46
121	300760	迈瑞医疗	11,842,339.95	2.44
122	601618	中国中冶	11,823,852.00	2.43
123	601006	大秦铁路	11,802,666.00	2.43
124	601857	中国石油	11,636,841.00	2.39
125	002352	顺丰控股	11,623,843.39	2.39
126	601818	光大银行	11,463,711.00	2.36
127	000596	古井贡酒	11,451,525.60	2.36
128	600872	中炬高新	11,404,279.00	2.35
129	600406	国电南瑞	11,389,086.96	2.34
130	600760	中航沈飞	11,271,635.40	2.32
131	000625	长安汽车	11,082,732.00	2.28
132	000807	云铝股份	10,982,173.00	2.26
133	600346	恒力石化	10,868,415.80	2.24
134	300274	阳光电源	10,741,254.00	2.21
135	600884	杉杉股份	10,735,389.50	2.21
136	000338	潍柴动力	10,711,493.00	2.20
137	300144	宋城演艺	10,710,356.56	2.20
138	300450	先导智能	10,661,603.50	2.19
139	002727	一心堂	10,508,656.00	2.16
140	000513	丽珠集团	10,485,569.00	2.16
141	000538	云南白药	10,409,324.00	2.14
142	601600	中国铝业	10,346,746.80	2.13
143	603899	晨光文具	10,262,060.00	2.11

144	601155	新城控股	10,261,345.36	2.11
145	000166	申万宏源	10,056,064.40	2.07
146	002001	新 和 成	10,042,634.40	2.07
147	600588	用友网络	9,928,597.30	2.04
148	600754	锦江酒店	9,867,497.00	2.03
149	002841	视源股份	9,836,037.38	2.02
150	600703	三安光电	9,798,844.64	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	102,569,721.19	21.11
2	601318	中国平安	62,413,512.96	12.84
3	300059	东方财富	61,152,533.75	12.58
4	000858	五 粮 液	59,071,025.73	12.16
5	600809	山西汾酒	52,051,628.34	10.71
6	601166	兴业银行	46,430,020.75	9.55
7	601012	隆基股份	42,767,446.29	8.80
8	000333	美的集团	41,601,637.12	8.56
9	601398	工商银行	41,149,955.87	8.47
10	600887	伊利股份	37,447,543.07	7.71
11	000001	平安银行	36,896,495.19	7.59
12	603501	韦尔股份	34,821,980.04	7.17
13	000568	泸州老窖	34,620,288.05	7.12
14	000651	格力电器	34,489,249.00	7.10
15	600309	万华化学	34,318,470.10	7.06
16	002142	宁波银行	34,142,592.56	7.03
17	600690	海尔智家	34,036,407.35	7.00
18	000725	京东方 A	33,249,647.00	6.84
19	002415	海康威视	32,367,997.94	6.66
20	601888	中国中免	32,156,161.60	6.62
21	600030	中信证券	32,085,594.69	6.60
22	300122	智飞生物	31,895,018.60	6.56
23	601899	紫金矿业	31,035,055.92	6.39
24	600900	长江电力	30,871,679.87	6.35
25	600438	通威股份	30,014,006.00	6.18
26	600600	青岛啤酒	29,933,227.75	6.16
27	600276	恒瑞医药	29,863,570.97	6.15
28	603259	药明康德	28,676,525.30	5.90

29	601668	中国建筑	27,659,802.00	5.69
30	300015	爱尔眼科	26,811,281.04	5.52
31	002594	比亚迪	26,719,593.23	5.50
32	300124	汇川技术	26,592,029.35	5.47
33	002475	立讯精密	26,511,206.65	5.46
34	002304	洋河股份	26,280,520.60	5.41
35	600048	保利发展	25,707,808.77	5.29
36	000002	万科A	25,496,024.00	5.25
37	002230	科大讯飞	25,232,995.00	5.19
38	601628	中国人寿	24,851,394.52	5.11
39	601633	长城汽车	24,792,849.46	5.10
40	601211	国泰君安	24,641,663.35	5.07
41	600031	三一重工	24,596,012.10	5.06
42	600176	中国巨石	23,609,285.91	4.86
43	300014	亿纬锂能	23,127,396.66	4.76
44	603799	华友钴业	23,101,542.94	4.75
45	601688	华泰证券	23,025,098.84	4.74
46	002027	分众传媒	22,346,030.90	4.60
47	601601	中国太保	22,309,973.09	4.59
48	601288	农业银行	22,115,994.00	4.55
49	000661	长春高新	22,017,724.00	4.53
50	601336	新华保险	21,571,657.51	4.44
51	300408	三环集团	21,545,876.12	4.43
52	000100	TCL 科技	20,622,373.12	4.24
53	002241	歌尔股份	20,215,574.85	4.16
54	002714	牧原股份	19,945,939.09	4.10
55	000063	中兴通讯	19,928,992.12	4.10
56	600570	恒生电子	19,646,691.80	4.04
57	601009	南京银行	19,550,976.11	4.02
58	000776	广发证券	19,549,128.46	4.02
59	002049	紫光国微	19,368,954.48	3.99
60	002311	海大集团	19,223,894.00	3.96
61	002179	中航光电	19,157,301.40	3.94
62	600660	福耀玻璃	18,701,076.85	3.85
63	600104	上汽集团	18,437,015.73	3.79
64	601328	交通银行	18,404,727.15	3.79
65	002129	中环股份	18,324,559.00	3.77
66	600999	招商证券	18,312,323.10	3.77
67	601377	兴业证券	18,292,970.00	3.76
68	300529	健帆生物	18,277,221.33	3.76
69	601225	陕西煤业	18,260,325.90	3.76
70	600837	海通证券	18,101,852.59	3.72

71	600585	海螺水泥	17,960,214.20	3.70
72	600741	华域汽车	17,800,229.39	3.66
73	601939	建设银行	17,656,004.00	3.63
74	603986	兆易创新	17,590,348.80	3.62
75	300142	沃森生物	17,557,908.00	3.61
76	600893	航发动力	17,473,069.90	3.60
77	300750	宁德时代	17,391,356.00	3.58
78	002271	东方雨虹	17,245,122.58	3.55
79	600958	东方证券	17,054,824.09	3.51
80	603288	海天味业	17,024,518.08	3.50
81	002601	龙佰集团	16,974,579.00	3.49
82	600763	通策医疗	16,833,917.80	3.46
83	601390	中国中铁	16,531,105.00	3.40
84	600000	浦发银行	16,412,872.00	3.38
85	601818	光大银行	16,384,213.00	3.37
86	600019	宝钢股份	16,316,549.94	3.36
87	002460	赣锋锂业	16,288,777.49	3.35
88	601100	恒立液压	16,130,652.82	3.32
89	600436	片仔癀	15,991,082.49	3.29
90	600028	中国石化	15,943,495.00	3.28
91	002493	荣盛石化	15,864,640.68	3.26
92	300347	泰格医药	15,835,204.87	3.26
93	600383	金地集团	15,791,987.30	3.25
94	002812	恩捷股份	15,653,167.00	3.22
95	600919	江苏银行	15,448,918.00	3.18
96	601838	成都银行	15,362,911.68	3.16
97	000786	北新建材	15,341,006.00	3.16
98	600196	复星医药	15,188,762.00	3.13
99	300033	同花顺	15,167,853.42	3.12
100	601088	中国神华	15,081,069.14	3.10
101	002508	老板电器	14,820,850.00	3.05
102	002624	完美世界	14,815,480.08	3.05
103	002821	凯莱英	14,767,537.64	3.04
104	002371	北方华创	14,696,374.00	3.02
105	600926	杭州银行	14,641,300.34	3.01
106	601877	正泰电器	14,187,706.00	2.92
107	002410	广联达	14,043,215.04	2.89
108	600111	北方稀土	13,999,099.42	2.88
109	603833	欧派家居	13,760,509.00	2.83
110	601006	大秦铁路	13,703,328.00	2.82
111	000977	浪潮信息	13,571,912.60	2.79
112	002236	大华股份	13,501,400.00	2.78

113	002352	顺丰控股	13,310,516.00	2.74
114	600406	国电南瑞	13,195,319.20	2.72
115	002008	大族激光	13,187,601.00	2.71
116	601238	广汽集团	12,949,734.15	2.66
117	600183	生益科技	12,689,329.28	2.61
118	600845	宝信软件	12,504,940.33	2.57
119	300413	芒果超媒	12,337,318.73	2.54
120	601985	中国核电	12,274,480.00	2.53
121	600346	恒力石化	12,238,016.88	2.52
122	600132	重庆啤酒	12,188,258.98	2.51
123	600703	三安光电	12,109,134.50	2.49
124	600872	中炬高新	12,039,248.00	2.48
125	000625	长安汽车	11,994,297.60	2.47
126	300144	宋城演艺	11,959,802.69	2.46
127	600745	闻泰科技	11,948,397.10	2.46
128	300601	康泰生物	11,816,619.24	2.43
129	002050	三花智控	11,793,160.34	2.43
130	601618	中国中冶	11,704,953.00	2.41
131	000596	古井贡酒	11,535,356.52	2.37
132	600760	中航沈飞	11,531,948.30	2.37
133	300760	迈瑞医疗	11,402,181.00	2.35
134	601857	中国石油	11,321,738.00	2.33
135	000807	云铝股份	11,321,663.00	2.33
136	300274	阳光电源	11,184,940.70	2.30
137	600884	杉杉股份	11,089,589.00	2.28
138	600588	用友网络	10,875,889.30	2.24
139	603993	洛阳钼业	10,570,737.00	2.18
140	002727	一心堂	10,432,748.00	2.15
141	601600	中国铝业	10,400,612.80	2.14
142	300450	先导智能	10,301,452.00	2.12
143	000739	普洛药业	10,247,902.52	2.11
144	000513	丽珠集团	10,163,543.32	2.09
145	000338	潍柴动力	10,142,423.00	2.09
146	603899	晨光文具	9,996,355.00	2.06
147	000166	申万宏源	9,938,254.60	2.05
148	600161	天坛生物	9,883,426.80	2.03
149	600754	锦江酒店	9,742,315.00	2.00
150	000538	云南白药	9,739,773.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,543,051,978.06
卖出股票收入（成交）总额	4,770,087,903.72

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	20,442,890.00	9.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	340,457.70	0.15
	其中：政策性金融债	340,457.70	0.15
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）	247,997.19	0.11
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,031,344.89	9.32

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019654	21 国债 06	113,000	11,303,390.00	5.01
2	010303	03 国债(3)	90,000	9,139,500.00	4.05
3	018006	国开 1702	3,390	340,457.70	0.15
4	113052	兴业转债	2,480	247,997.19	0.11

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
----	----	----------	---------	-----------	------

IC2201	IC2201	-40	-59,022,400.00	-668,560.00	-
IC2202	IC2202	-3	-4,410,360.00	-46,152.00	-
IF2203	IF2203	-52	-77,229,360.00	1,786,897.96	-
公允价值变动总额合计（元）					1,072,185.96
股指期货投资本期收益（元）					-35,155,124.27
股指期货投资本期公允价值变动（元）					24,881,924.27

注：1、股指期货投资主要是用于套期保值，有利于对冲大盘风险，降低组合亏损；

2、该部分投资符合既定的投资政策以及投资目标。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

现阶段本基金主要使用股指期货对冲市场系统性风险。基金经理根据对冲比率、期现市场相关性等因素，计算需要对冲的股指期货合约手数，并对风险敞口进行实时跟踪与动态调整。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

8.11.3 本期国债期货投资评价

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

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 163,425,732.06 元，占基金资产净值的比例为 72.45%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 140,662,120.00 元，占基金资产净值的比例为 62.36%，空头合约市值占股票资产的比例为 86.07%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 30,243,185.97 元，公允价值变动损益为-11,089,332.41 元。

8.13 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除东方财富（股票代码：300059 SZ）、宁波银行（股票代码：002142 SZ）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受

到公开谴责、处罚的情形。

2021 年 7 月 19 日，东方财富信息股份有限公司因未依法履行职责被工信部通报批评，通知整改。

2021 年 7 月 13 日，宁波银行股份有限公司因涉嫌违反法律法规被国家外汇管理局宁波市分局通知整改，没收违法所得，罚款 204.85 万元【甬外管罚（2021）7 号】。

2021 年 7 月 21 日，宁波银行股份有限公司因违反反洗钱法，违规经营被中国人民银行宁波市中心支行警告，罚款 286.20 万元【甬银处罚字（2021）2 号】。

2021 年，宁波银行股份有限公司因违规经营被宁波银保监局罚款，通知整改【甬银保监罚决字（2021）36 号、甬银保监罚决字（2021）57 号、甬银保监罚决字（2021）81 号】。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.13.3 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	18,507,356.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266,429.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,773,785.24

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

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	601728	中国电信	1,682,426.97	0.75	新股锁定

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
安信阿尔法定开混合 A	2,498	58,711.90	60,246,146.42	41.08	86,416,186.63	58.92
安信阿尔法定开混合 C	874	44,298.81	17,113,346.53	44.20	21,603,814.81	55.80
合计	3,327	55,719.72	77,359,492.95	41.73	108,020,001.44	58.27

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信阿尔法定开混合 A	1,249,707.74	0.85
	安信阿尔法定开混合 C	2,757.81	0.01
	合计	1,252,465.55	0.68

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 A	10~50
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	安信阿尔法定开混合 A	10~50
	安信阿尔法定开混合 C	0
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	5.39	10,000,000.00	5.39	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	5.39	10,000,000.00	5.39	-

注：本基金发起资金持有期限已满三年。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 6 日）基金份额总额	10,298,649.48	-
本报告期期初基金份额总额	205,140,936.34	202,500,776.33
本报告期基金总申购份额	227,762,655.44	76,674,527.64
减：本报告期基金总赎回份额	286,241,258.73	240,458,142.63
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	146,662,333.05	38,717,161.34

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第五次会议审议通过：自 2021 年

3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 50,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	4,491,460,730.36	48.37%	3,194,765.10	65.39%	-
安信证券	2	4,297,243,244.89	46.28%	1,337,738.48	27.38%	-
开源证券	2	317,106,772.41	3.42%	225,557.37	4.62%	-
长城证券	1	178,949,494.04	1.93%	127,286.88	2.61%	新租
东方证券	2	-	-	-	-	新租

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	158,847,779.93	33.37%	3,857,500,000.00	22.45%	-	-
安信证券	309,110,903.91	64.94%	12,894,600,000.00	75.04%	-	-
开源证券	8,032,000.00	1.69%	431,000,000.00	2.51%	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-22
2	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
3	安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金投资范围并相应修改法律文件的公告	上海证券报、证券时报	2021-01-29
4	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
5	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2021-02-10
6	关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购采取比例确认的提示性公告	上海证券报	2021-03-06
7	关于安信价值精选股票型证券投资基金等 10 只基金新增华林证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-10
8	安信基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金申购、追加申购起点金额的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-10
9	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 16 只基金新增华金证券股份有限公司为基金销售服务机构	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-15

	的公告		
10	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告	上海证券报	2021-03-16
11	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告	上海证券报	2021-03-17
12	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告	上海证券报	2021-03-18
13	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告	上海证券报	2021-03-19
14	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-19
15	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金申购申请比例确认的公告	上海证券报	2021-03-20
16	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-23
17	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-29
18	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-21
19	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增爱建证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-30
20	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-05-20
21	关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金取消规模限制的提示性公告	上海证券报	2021-06-01
22	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2021-06-02
23	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-06-26
24	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华融证券股份有	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-15

	限公司为基金销售服务机构的公告		
25	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增英大证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-15
26	安信基金管理有限责任公司旗下 66 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-07-20
27	安信基金管理有限责任公司旗下 69 只基中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-08-27
28	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年度第三次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2021-08-28
29	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-03
30	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
31	安信基金管理有限责任公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-09-22
32	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2021-10-26
33	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年度第四次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2021-11-26

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；

- 4、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2022年3月31日