
人保转型新动力灵活配置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:中国人保资产管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月24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。

本报告中财务资料经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)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
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	66
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	66
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	66
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
8.12 投资组合报告附注.....	66
§9 基金份额持有人信息.....	67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	68
§10 开放式基金份额变动.....	68
§11 重大事件揭示.....	68
11.1 基金份额持有人大会决议.....	68
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.....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
11.4 基金投资策略的改变.....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
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.....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	69
11.8 其他重大事件.....	71
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
§13 备查文件目录.....	73
13.1 备查文件目录.....	73
13.2 存放地点.....	74
13.3 查阅方式.....	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	人保转型混合	
基金主代码	005953	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年06月21日	
基金管理人	中国人保资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	69,008,034.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	人保转型混合A	人保转型混合C
下属分级基金的交易代码	005953	005954
报告期末下属分级基金的份额总额	60,666,296.34份	8,341,738.14份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过对我国经济结构转型和产业升级进行深入研究，积极投资于符合经济发展趋势、质地优良的优势行业和上市公司，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金将以“转型新动力”作为行业配置和个股挖掘的主要线索，重点投资于受益于经济结构转型和产业升级，符合行业发展趋势并具有良好基本面和持续成长能力的优势行业和上市公司。本基金的债券组合主要作为基金流动性管理的工具。同时，将秉承稳健运作的原则，在保证低风险投资的基础上，积极配置“转型新动力”相关主题债券，以获取较好收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中国人保资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	吕传红	郭明
	联系电话	010-69009696	010-66105799
	电子邮箱	lvch@piccamc.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-820-7999	95588
传真		021-50765598	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大厦1198号20层、21层、22层	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		北京市西城区西长安街88号中国人保大厦8层	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		100031	100140
法定代表人		曾北川	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.piccamc.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	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市延安东路222号外滩中心30楼
注册登记机构	中国人保资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大厦1198号20层、21层、22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	
	人保转型混合A	人保转型混合C	人保转型混合A	人保转型混合C	人保转型混合A	人保转型混合C
本期已实现收益	25,981,707.63	626,540.10	58,168,603.71	848,730.47	1,847,181.69	373,480.55
本期利润	-1,141,909.68	-989,035.29	80,985,102.09	1,381,990.74	14,685,870.39	836,879.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0107	-0.1561	0.7215	0.8699	0.1508	0.1570
本期加权平均净值利润率	-0.60%	-8.81%	53.48%	71.51%	15.34%	15.94%
本期基金份额净值增长率	-3.27%	-3.62%	66.27%	65.53%	15.98%	15.47%
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	37,864,800.74	4,990,545.24	56,008,103.98	337,336.38	-1,195,016.45	-24,684.31
期末可供分配基金份额利润	0.6241	0.5983	0.4322	0.4145	-0.0111	-0.0185
期末基金资产净值	99,643,119.10	13,489,275.83	220,057,634.48	1,365,277.06	115,044,191.68	1,416,093.34
期末基金份额净值	1.6425	1.6171	1.6980	1.6778	1.0684	1.0604
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	71.83%	69.18%	77.64%	75.53%	6.84%	6.04%

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、期末可供分配利润是指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、上述本基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如：基金的申购、赎回费等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

人保转型混合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	-8.47%	1.20%	1.51%	0.47%	-9.98%	0.73%
过去六个月	-11.12%	1.66%	-1.89%	0.61%	-9.23%	1.05%
过去一年	-3.27%	1.64%	-0.60%	0.70%	-2.67%	0.94%
过去三年	86.53%	1.35%	44.13%	0.77%	42.40%	0.58%
自基金合同生效起至今	71.83%	1.29%	31.63%	0.79%	40.20%	0.50%

人保转型混合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	-8.59%	1.20%	1.51%	0.47%	-10.10%	0.73%
过去六个月	-11.33%	1.66%	-1.89%	0.61%	-9.44%	1.05%
过去一年	-3.62%	1.64%	-0.60%	0.70%	-3.02%	0.94%
过去三年	84.23%	1.35%	44.13%	0.77%	40.10%	0.58%
自基金合同生效起至今	69.18%	1.29%	31.63%	0.79%	37.55%	0.50%

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

人保转型混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年06月21日-2021年12月31日)

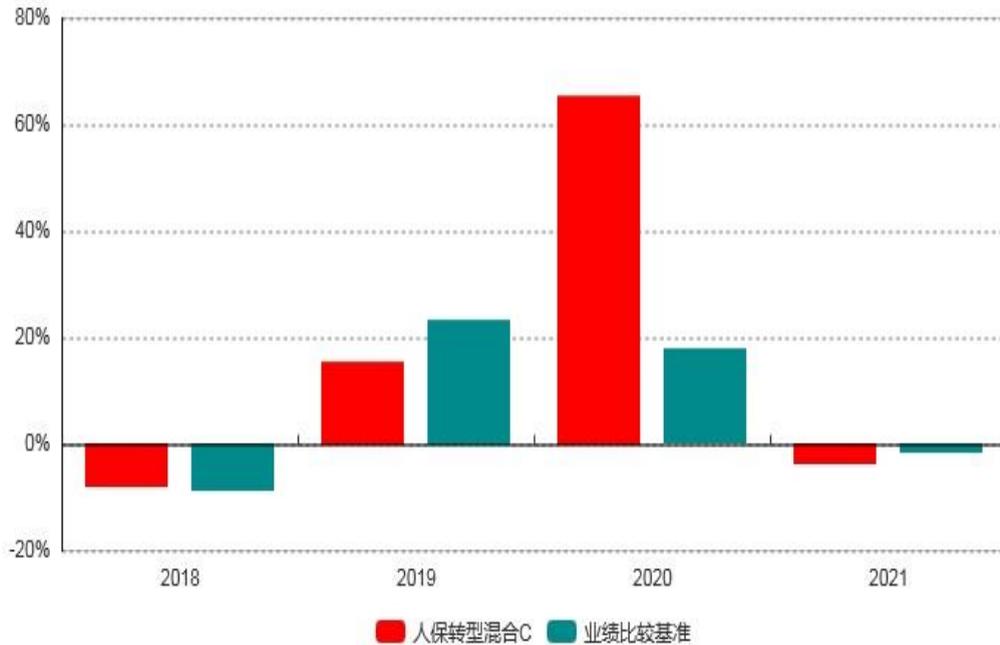
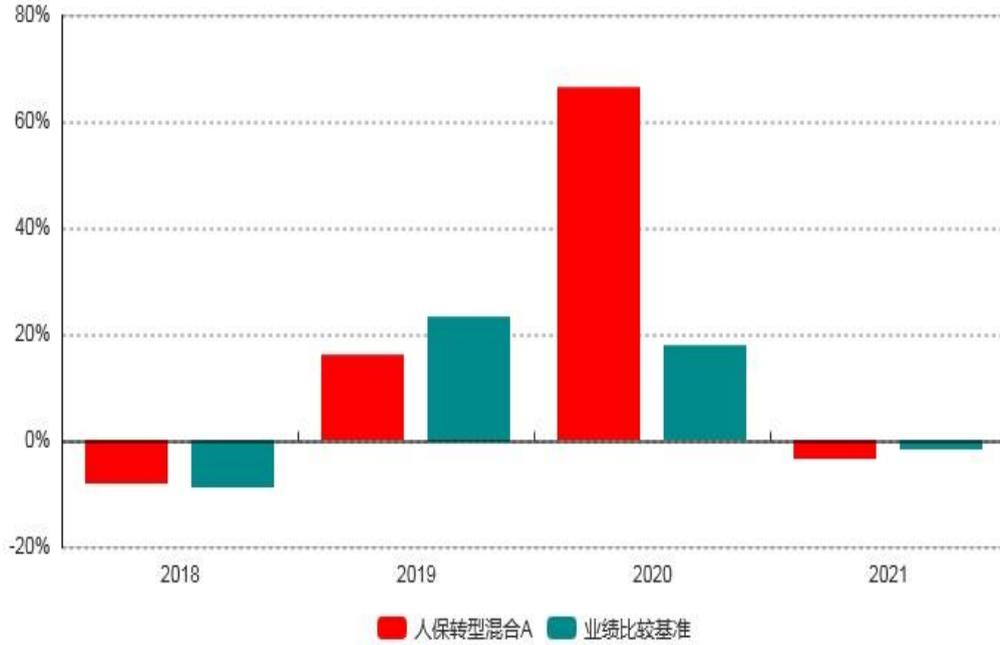


人保转型混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年06月21日-2021年12月31日)



注：1、本基金基金合同于 2018 年 06 月 21 日生效。根据基金合同规定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束，本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。
2、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中证全债指数收益率×40%。

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

人保转型混合A

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
2020年	0.756	63,235.93	8,865,894.78	8,929,130.71	-
合计	0.756	63,235.93	8,865,894.78	8,929,130.71	-

人保转型混合C

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
2020年	0.747	48,856.67	1,152.27	50,008.94	-
合计	0.747	48,856.67	1,152.27	50,008.94	-

§ 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

中国人保资产管理有限公司（简称人保资产）成立于2003年7月16日，是经国务院同意、原中国保监会批准设立的境内第一家保险资产管理公司，由中国人民保险集团股份有限公司（股票代码：601319.SH, 1339.HK）发起。目前管理资产逾万亿元人民币，具备银保监会核准的股票投资能力、无担保债券投资能力、股权投资能力、基础设施投资计划产品创新能力、不动产投资计划产品创新能力、衍生品运用能力和信托产品投资能力，具有国家外管局批准的经营外汇业务资格，获选基本养老保险基金证券投资基金管理机构，获准发行投资理财产品和受托管理合格投资者资金，获批开展公募基金业务，是中国资本市场秉持价值投资理念、为客户创造绝对收益的重要机构投资者之一。

成立十八年来，人保资产以保险资金运用为主业，基于资产负债匹配管理理念，探索建立了从资产战略配置、资产战术配置、资产交易配置到集中交易和全流程风险管控的资产管理价值链，并着眼于构建能够获得持续稳定收益的资产组合，坚持以绝对收益为核心的收益缺口管理原则，为委托人贡献了长期稳定的投资收益。

十八年来，中国金融市场日趋成熟，财富管理行业日渐交融。人保资产科学筹划发展战略，积极把握第三方业务的发展机遇和另类资产的投资机会，在国内保险资产管理机构中较早开展了第三方保险机构的专户管理业务，并积极创新和开展股权投资、基础

设施债权投资业务、资产管理产品等业务，积极筹备公募基金业务，形成了专户管理、资产管理产品、债权投资计划、股权投资计划、不动产投资计划和外汇投资等业务多元化发展的格局，与国内各主要金融机构和大中型龙头企业建立了良好的合作关系。

自成立以来，人保资产始终坚持专业化发展、市场化经营、规范化运作，是第一家建立“委托-受托-托管”资金三方存管机制的保险资产管理机构，并探索建立了覆盖投资全流程的风险防控体系；十八年来，人保资产还培养了具备国际投资视野、历经市场多周期磨练的投研管理和业务执行团队，忠实履行了对各委托人的价值创造承诺。

面向潜力无限、变革加快、竞争激烈的财富管理市场，人保资产将始终坚持人民至上，牢记“人民保险，服务人民”的企业使命，恪守“诚信、专业、创新、卓越”的企业核心价值观，实现“建设全球卓越保险集团”的企业愿景。

人保资产于2017年1月11日获得中国证监会《关于核准中国人保资产管理有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复》（证监许可[2017]107号），于2017年3月29日获得中国证监会颁发的《经营证券期货业务许可证》。截至2021年12月31日，本公司旗下基金产品线逐渐丰富，涵盖了股票指数型、债券型、混合型、货币型产品，管理的基金产品分别为人保货币市场基金、人保双利优选混合型证券投资基金、人保研究精选混合型证券投资基金、人保纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、人保鑫利回报债券型证券投资基金、人保鑫瑞中短债债券型证券投资基金、人保量化基本面混合型证券投资基金、人保鑫裕增强债券型证券投资基金、人保中证500指数型证券投资基金、人保福泽纯债一年定期开放债券型证券投资基金、人保优势产业混合型证券投资基金、人保鑫盛纯债债券型证券投资基金、人保沪深300指数型证券投资基金、人保鑫泽纯债债券型证券投资基金、人保福睿18个月定期开放债券型证券投资基金、人保行业轮动混合型证券投资基金、人保中高等级信用债债券型证券投资基金、人保稳进配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、人保量化锐进混合型发起式证券投资基金和人保福欣3个月定期开放债券型证券投资基金等。

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		
张丽华	基金经理	2018-10-16	-	14年	中国人民大学经济学硕士。曾任天相投资顾问公司投资分析部行业分析师、中国民族证券有限公司研究部行业分析师、益民基金管

					理有限公司研究部行业分析师、投资部基金经理助理。2017年4月加入中国人保资产管理有限公司公募基金事业部，2018年8月9日起任人保鑫利回报债券型证券投资基金基金经理，2018年10月16日起任人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2018年11月13日起任人保鑫裕增强债券型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

- 1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为本基金合同生效日。
- 2、非首任基金经理，其“任职日期”为公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在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》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有公募基金投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各公募基金投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有公募基金投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人公平对待旗下所有公募基金投资组合，建立了公平交易制度和流程。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》

和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有公募基金投资组合，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021年，权益市场整体波动较大，呈现结构性行情，“双碳”主线贯穿全年。

组合操作层面，由于对市场相对乐观，仓位全年维持较高水平，因此在市场上涨时分享了上涨带来的净值增加，而市场急速下跌时又承受了一定幅度的回撤，产品净值波动较大，尤其春节后2、3月以及三季度末及四季度，产品表现不佳。2021年，年初仓位较重的消费及新能源行业大幅回撤，基金经理经过研究认为消费行业基本面产生了一定的变化，及时进行减仓，但新能源行业在双碳背景下，基本面依然强劲，因此仓位上相对激进。2021年四季度，市场风格变化，在此背景下，产品部分重仓表现不佳，未有效控制回撤。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末人保转型混合A基金份额净值为1.6425元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.27%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%；截至报告期末人保转型混合C基金份额净值为1.6171元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-3.62%，同期业绩比较基准收益率为-0.60%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，从政策端分析，市场依然有望保持流动性相对宽裕，同时财政政策或将发挥更大作用，有望从紧信用逐渐转为宽信用。2022年在新基建和老基建共同作用下，经济有望逐步企稳。但是从企业盈利端分析，盈利高点或在一季度出现，全年存在下行压力。

宏观政策相对友好叠加微观层面企业盈利预期变化，多重因素共同作用下，我们判断市场存在结构性及阶段性行情，但2022年产品操作难度加大。在操作中，基金经理将立足于中长线角度，对组合进行配置，自下而上选择估值与业绩相匹配的标的，努力为投资者继续创造价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，主要采取了如下监察稽核工作：公司紧密跟踪法律法规和监管要求，防控各类合规风险，促进公司各项业务合法合规；进一步完善内部控制制度体系建设，对公募基金业务制度进行了全面的梳理，细化风险管理的相关规章制度及流程，进一步明确岗位职责及操作规程；开展多种形式的合规培训，重点加强了投资研究和基金销售业务条线的合规教育，不断提升员工的合规守法意识；强化事前事中合规风险管理，严格审核信息披露文件、基金宣传推介材料，防范各类合规风险；公司秉承全员风险管理的理念，采取事前防范、事中控制和事后监督检查等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理、监控及提示，督促投研交易业务的合规开展；定期和不定期开展多项内部稽核，特别是对投资研究、基金交易等关键业务和岗位进行检查监督，促进公司业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继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

本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所管理人在管理人改变估值技术导致基金资产净值的变化在0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本基金管理人设立估值委员会，成员主要由投资部门、研究部门、合规风控部门、运营管理部门人员组成，以上人员均具有专业胜任能力和相关工作经验。基金经理列席会议，但不参与具体决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--中国人保资产管理管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中国人保资产管理管理有限公司编制和披露的本基金2021年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	德师报(审)字(22)第P00025号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了人保转型新动力灵活配置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)变动表以及财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，公允反映了人保

	转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。
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，我们独立于人保转型新动力灵活配置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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	中国人保资产管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021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。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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而导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估人保转型新动力灵活配置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，除非基金管理人管理层计划清算人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
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

	<p>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）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和做出会计估计及相关披露的合理性。（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对人保转型新动力灵活配置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人保转型新动力灵活配置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。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	史曼	何淑婷
会计师事务所的地址	上海市延安东路222号外滩中心30楼	
审计报告日期	2022-03-28	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：人保转型新动力灵活配置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	15,623,654.64	12,876,319.27
结算备付金		2,448,459.07	798,366.63
存出保证金		95,942.89	72,151.39
交易性金融资产	7.4.7.2	98,111,594.51	208,317,552.86
其中：股票投资		98,111,594.51	199,318,452.86
基金投资		-	-
债券投资		-	8,999,100.00
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		448,255.23	126,093.38
应收利息	7.4.7.5	5,595.44	199,892.03
应收股利		-	-
应收申购款		7,780.80	2,396.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		116,741,282.58	222,392,771.96
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		2,334,661.28	83,314.61
应付赎回款		-	219,847.72
应付管理人报酬		216,993.81	243,939.47
应付托管费		36,165.61	40,656.58
应付销售服务费		5,863.81	428.03
应付交易费用	7.4.7.7	966,203.14	346,673.82
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	49,000.00	35,000.19
负债合计		3,608,887.65	969,860.42
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	69,008,034.48	130,414,833.73
未分配利润	7.4.7.10	44,124,360.45	91,008,077.81
所有者权益合计		113,132,394.93	221,422,911.54
负债和所有者权益总计		116,741,282.58	222,392,771.96

注：报告截止日2021年12月31日，人保转型混合A份额净人民币1.6425元，基金份额总额60,666,296.34份；人保转型混合C份额净值人民币1.6171元，基金份额总额8,341,738.14份；总份额合计69,008,034.48份。

7.2 利润表

会计主体：人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		7,122,351.86	87,647,950.14
1. 利息收入		361,280.23	292,499.27
其中：存款利息收入	7.4.7.11	77,062.04	47,112.44

债券利息收入		266,849.73	245,386.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,368.46	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,339,545.07	63,996,081.04
其中：股票投资收益	7.4.7.12	34,531,447.69	63,027,223.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-106,669.51	-36,951.89
资产支持证券投资 收益	7.4.7.1 3.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	914,766.89	1,005,809.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-28,739,192.70	23,349,758.65
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	160,719.26	9,611.18
减：二、费用		9,253,296.83	5,280,857.31
1. 管理人报酬	7.4.10. 2.1	3,042,092.62	2,282,598.45
2. 托管费	7.4.10. 2.2	507,015.41	380,433.04
3. 销售服务费	7.4.10. 2.3	55,687.45	9,820.42
4. 交易费用	7.4.7.19	5,457,308.55	2,439,495.40
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		62.80	-
7. 其他费用	7.4.7.20	191,130.00	168,510.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,130,944.97	82,367,092.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,130,944.97	82,367,092.83

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	130,414,833.73	91,008,077.81	221,422,911.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,130,944.97	-2,130,944.97
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）	-61,406,799.25	-44,752,772.39	-106,159,571.64
其中：1. 基金申购款	30,350,716.18	24,578,109.42	54,928,825.60
2. 基金赎回款	-91,757,515.43	-69,330,881.81	-161,088,397.24
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）	69,008,034.48	44,124,360.45	113,132,394.93

项 目	上年度可比期间 2020年01月01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)	109,012,016.23	7,448,268.79	116,460,285.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	82,367,092.83	82,367,092.83
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)	21,402,817.50	10,171,855.84	31,574,673.34
其中：1. 基金申购款	32,756,454.47	12,820,712.31	45,577,166.78
2. 基金赎回款	-11,353,636.97	-2,648,856.47	-14,002,493.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-8,979,139.65	-8,979,139.65
五、期末所有者权益(基金净值)	130,414,833.73	91,008,077.81	221,422,911.54

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：

曾北川

韩松

沈静

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

人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人中国人保资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)以证监许可[2018]716号文批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限为不定期,首次设立募集基金份额为247,795,406.38份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具

了编号为德师报(验)字(18)第00100号验资报告。基金合同于2018年6月21日正式生效。本基金的基金管理人为中国人保资产管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同相关规定,本基金份额分为A类基金份额(以下简称“人保转型混合A”)和C类基金份额(以下简称“人保转型混合C”)两类份额。其中,人保转型混合A是指在投资者认购、申购时收取认购、申购费用,在赎回时收取赎回费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额;人保转型混合C是指在投资者认购、申购时不收取认购、申购费用,但赎回时收取赎回费,并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、截至报告期末最新公告的基金合同及本基金招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票)、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0-95%,本基金投资于转型新动力相关主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资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、存出保证应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率 \times 60%+中证全债指数收益率 \times 40%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时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发布的若干基金行业实务操作。

本财务报告以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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和贷款及应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分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。本基金暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。贷款及应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，贷款及应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层次的输入值确定公允价值计量层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是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；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 对于银行间市场交易的固定收益品种，以及交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照第三方估值机构提供的估值确定公允价值。

2) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日有市价的，采用市价确定公允价值；估值日无市价，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，采用最近交易市价确定公允价值；对于发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。

3) 对存在活跃市场的其他投资品种，如估值日无市价且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或基金管理人估值委员会认为必要时，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价，确定公允价值。

4) 当投资品种不再存在活跃市场，基金管理人估值委员会认为必要时，采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术，确定投资品种的公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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，且目前可执行该种法定权利，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基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入。

资产支持证券利息收入在持有期内，按摊余成本和实际收益率计算确认利息收入。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

债券投资收益为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资摊余成本与应收利息(若有)后的差额确认。

资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券摊余成本与应收利息(若有)后的差额确认。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金确认由上市公司代扣代缴的个人所得税后于卖出交易日按实际代扣代缴金额确认。

公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

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按前一日C类基金份额资产净值0.50%的年费率逐日计提。

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。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率逐日计提。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的10%，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；

2) 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自动转为相应类别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；

3) 基金收益分配后各类基金份额的基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策与计量基础一致。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1) 对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号），在估值日按照该通知规定的流通受限股票公允价值计算模型进行估值。

2) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，根据《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》（中国证监会公告[2017]13号）及《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）相关规定，本基金根据情况决定使用指数收益法、可比公司法、市场价格模型法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

3) 根据《关于发布〈中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协发[2014]24号），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140

号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1) 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、债券免征增值税；公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2) 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，暂不缴纳企业所得税。

3) 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4) 对于基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

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	15,623,654.64	12,876,319.27
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	15,623,654.64	12,876,319.27

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		94,135,140.47	98,111,594.51	3,976,454.04
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		94,135,140.47	98,111,594.51	3,976,454.04
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		166,579,406.12	199,318,452.86	32,739,046.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	9,022,500.00	8,999,100.00	-23,400.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	9,022,500.00	8,999,100.00	-23,400.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		175,601,906.12	208,317,552.86	32,715,646.74

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无衍生金融工具。

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无各项买入返售金融资产。

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无因买断式逆回购交易而取得的债券。

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	4,335.94	1,399.41
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	1,211.98	395.23
应收债券利息	-	198,061.64
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	47.52	35.75
合计	5,595.44	199,892.03

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	966,203.14	346,673.82
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	966,203.14	346,673.82

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	-	500.19
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	49,000.00	34,500.00
合计	49,000.00	35,000.19

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 人保转型混合A

金额单位：人民币元

项目 (人保转型混合A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	129,601,083.02	129,601,083.02
本期申购	14,633,571.60	14,633,571.60
本期赎回(以“-”号填列)	-83,568,358.28	-83,568,358.28
本期末	60,666,296.34	60,666,296.34

7.4.7.9.2 人保转型混合C

金额单位：人民币元

项目 (人保转型混合C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	813,750.71	813,750.71
本期申购	15,717,144.58	15,717,144.58
本期赎回(以“-”号填列)	-8,189,157.15	-8,189,157.15
本期末	8,341,738.14	8,341,738.14

注：本期申购含红利再投、转换入份(金)额，本期赎回含转换出份(金)额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 人保转型混合A

单位：人民币元

项目 (人保转型混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	56,008,103.98	34,448,447.48	90,456,551.46
本期利润	25,981,707.63	-27,123,617.31	-1,141,909.68
本期基金份额交易产生的变动数	-44,125,010.87	-6,212,808.15	-50,337,819.02
其中：基金申购款	8,613,668.91	3,520,488.58	12,134,157.49
基金赎回款	-52,738,679.78	-9,733,296.73	-62,471,976.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	37,864,800.74	1,112,022.02	38,976,822.76

7.4.7.10.2 人保转型混合C

单位：人民币元

项目 (人保转型混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	337,336.38	214,189.97	551,526.35
本期利润	626,540.10	-1,615,575.39	-989,035.29
本期基金份额交易产生的变动数	4,026,668.76	1,558,377.87	5,585,046.63
其中：基金申购款	9,175,737.38	3,268,214.55	12,443,951.93
基金赎回款	-5,149,068.62	-1,709,836.68	-6,858,905.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,990,545.24	156,992.45	5,147,537.69

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	51,199.50	35,850.90

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	24,419.09	10,424.84
其他	1,443.45	836.70
合计	77,062.04	47,112.44

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	2,097,414,687.70	910,221,603.40
减：卖出股票成本总额	2,062,883,240.01	847,194,379.72
买卖股票差价收入	34,531,447.69	63,027,223.68

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至202 1年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01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	-106,669.51	-36,951.89
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	-106,669.51	-36,951.89

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年1
----	------------------------	-------------------------------

	年12月31日	2月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	28,600,616.56	8,320,087.58
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	28,129,983.11	8,077,837.30
减：应收利息总额	577,302.96	279,202.17
买卖债券差价收入	-106,669.51	-36,951.89

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	914,766.89	1,005,809.25
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	914,766.89	1,005,809.25

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
1. 交易性金融资产	-28,739,192.70	23,349,758.65

——股票投资	-28,762,592.70	23,388,321.35
——债券投资	23,400.00	-38,562.70
——资产支持证券投资	-	-
——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	-28,739,192.70	23,349,758.65

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	160,719.26	9,611.18
合计	160,719.26	9,611.18

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	5,457,151.05	2,439,495.40
银行间市场交易费用	157.50	-
合计	5,457,308.55	2,439,495.40

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	40,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	630.00	510.00
账户维护费	30,500.00	18,000.00
合计	191,130.00	168,510.00

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

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国人保资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国人民保险集团股份有限公司	基金管理人控股股东
深圳市保腾盛基金管理有限公司	基金管理人控股子公司
大成创新资本管理有限公司	基金管理人联营公司

注：下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，与本基金管理人同受一方控制的关联方发生的交易已经根据实际发生情况于下文分别列示。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,042,092.62	2,282,598.45
其中：支付销售机构的客户维护费	133,590.13	27,141.10

注：支付基金管理人中国人保资产管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%÷当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	507,015.41	380,433.04

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值×0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保转型混合A	人保转型混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	3,732.68	3,732.68
中国人保资产管理有限公司	0.00	298.79	298.79
合计	0.00	4,031.47	4,031.47
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	人保转型混合A	人保转型混合C	合计
中国工商银行股份有限公司	0.00	2,796.53	2,796.53
中国人保资产管理有限公司	0.00	5,336.19	5,336.19
合计	0.00	8,132.72	8,132.72

注：本基金实行销售服务费分级收费方式，分设A、C两类基金份额：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按前一日C类基金份额的资产净值×0.50%的年费率来计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：C类基金份额每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

人保转型混合A

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国人民人寿保险股份有限公司	52,323,480.56	86.25%	52,323,480.56	40.37%

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方无投资人保转型混合C的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	15,623,654.64	51,199.50	12,876,319.27	35,850.90

注：本基金由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管的银行存款利息收入，按银行同业或协议利率计算。

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内无利润分配的情况。

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
688670	金迪克	2021-07-23	2022-02-07	限售期股票	55.18	74.11	1,276	70,409.68	94,564.36	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	限售期股票	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
688038	中科通达	2021-07-05	2022-01-13	限售期股票	8.60	18.72	2,132	18,335.20	39,911.04	-
688701	卓锦股份	2021-09-08	2022-03-16	限售期股票	7.48	13.50	2,340	17,503.20	31,590.00	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	限售期股票	60.64	234.74	117	7,094.88	27,464.58	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	限售期股票	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301069	凯盛新材	2021-09-01	2022-03-01	限售期股票	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.1	-

		16	28	票					9	
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	限售 期股 票	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	限售 期股 票	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,8 15.2 4	-
3010 26	浩通 科技	2021 -07- 08	2022 -01- 17	限售 期股 票	18.0 3	62.7 3	203	3,66 0.09	12,7 34.1 9	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	限售 期股 票	19.1 1	67.9 3	149	2,84 7.39	10,1 21.5 7	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	限售 期股 票	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 87	可孚 医疗	2021 -10- 15	2022 -04- 25	限售 期股 票	93.0 9	75.3 4	118	10,9 84.6 2	8,89 0.12	-
3010 90	华润 材料	2021 -10- 19	2022 -04- 26	限售 期股 票	10.4 5	11.2 2	763	7,97 3.35	8,56 0.86	-
3010 52	果麦 文化	2021 -08- 23	2022 -02- 28	限售 期股 票	8.11	33.6 4	252	2,04 3.72	8,47 7.28	-
3008 14	中富 电路	2021 -08- 04	2022 -02- 14	限售 期股 票	8.40	23.8 8	328	2,75 5.20	7,83 2.64	-
3010 81	严牌 股份	2021 -10- 13	2022 -04- 20	限售 期股 票	12.9 5	17.4 4	403	5,21 8.85	7,02 8.32	-
3010 33	迈普 医学	2021 -07- 01	2022 -01- 01	限售 期股	15.1 4	59.9 7	108	1,63 5.12	6,47 6.76	-

		15	26	票						
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	限售期股票	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	限售期股票	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	限售期股票	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	限售期股票	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	限售期股票	43.99	50.77	113	4,970.87	5,737.01	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	限售期股票	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	限售期股票	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	限售期股票	36.50	31.31	171	6,241.50	5,354.01	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-06	限售期股票	58.08	49.85	107	6,214.56	5,333.95	-
301092	争光股份	2021-10-	2022-05-	限售期股	36.31	35.52	144	5,228.64	5,114.88	-

		21	06	票						
3010 59	金三 江	2021 -09- 03	2022 -03- 14	限售 期股 票	8.09	19.3 0	259	2,09 5.31	4,99 8.70	-
3010 73	君亭 酒店	2021 -09- 22	2022 -03- 30	限售 期股 票	12.2 4	32.0 0	144	1,76 2.56	4,60 8.00	-
3010 68	大地 海洋	2021 -09- 16	2022 -03- 28	限售 期股 票	13.9 8	28.3 8	144	2,01 3.12	4,08 6.72	-
3010 79	邵阳 液压	2021 -10- 11	2022 -04- 19	限售 期股 票	11.9 2	24.8 2	140	1,66 8.80	3,47 4.80	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务而出借的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。与本基金相关的市场风险主要包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在力求基金资产安全性、较高流动性的基础上，追求超过业绩比较基准的稳定收益。

本基金的基金管理人建立了由董事会负最终责任、管理层直接领导、内部控制职能部门统筹协调、内部控制评价部门监察监督、业务职能部门负首要责任的分工明确、路线清晰、相互协作、有效执行的内部控制组织体系。公募基金事业部部务会为公募基金业务日常运行管理的议事机构，负责事业部经营管理重要事项的研究与决定，以及拟提交公司审批事项的审核。

为加强公募基金管理的内部控制，防范和化解经营风险，提高经营管理效益，保障基金持有人利益，基金管理人遵照中国法律和公司章程的规定履行职责，建立健全公司授权标准和程序，确保授权制度的贯彻执行；公募基金事业部及各职能部门根据既定的业务规范、制度执行具体业务；董事会下设风险管理与消费者权益保护委员会、监事会、总裁室下设风险合规委员会、风险管理部/法律合规部为公司不同层面的监督机构，构成公司相对独立的监督系统。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金所投资证券的发行人出现违约或拒绝支付到期利息、本金，或基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任等，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在进行银行间同业市场债券交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

本基金报告期末债券投资按短期信用评级及长期信用评级列示的情况如下，其中不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险指因市场交易相对不活跃导致基金投资资产无法以适当价格及时变现，进而无法应对债务到期偿付或投资者赎回款按时支付的风险。

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。

本报告期内，基金管理人坚持组合管理、分散投资的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，本基金所持大部分证券在证券交易所上市或银行间同业市场交易，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

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，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。

截至本报告期末及上年度末，本基金无重大流动性风险。

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，主要包括利率风险、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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人日常通过对持仓品种组合的久期分析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	15,623,654.64	-	-	-	15,623,654.64
结算备付金	2,448,459.07	-	-	-	2,448,459.07
存出保证金	95,942.89	-	-	-	95,942.89
交易性金融资产	-	-	-	98,111,594.51	98,111,594.51
应收证券清算款	-	-	-	448,255.23	448,255.23
应收利息	-	-	-	5,595.44	5,595.44
应收申购款	-	-	-	7,780.80	7,780.80
资产总计	18,168,056.60	-	-	98,573,225.98	116,741,282.58
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,334,661.28	2,334,661.28
应付管理人报酬	-	-	-	216,993.81	216,993.81
应付托管费	-	-	-	36,165.61	36,165.61
应付销售服务费	-	-	-	5,863.81	5,863.81
应付交易费用	-	-	-	966,203.14	966,203.14
其他负债	-	-	-	49,000.00	49,000.00
负债总计	-	-	-	3,608,887.65	3,608,887.65
利率敏感度缺口	18,168,056.60	-	-	94,964,338.33	113,132,394.93
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	12,876,319.27	-	-	-	12,876,319.27
结算备付金	798,366.63	-	-	-	798,366.63
存出保证金	72,151.39	-	-	-	72,151.39
交易性金融资产	8,999,100.00	-	-	199,318,452.86	208,317,552.86
应收证券清算款	-	-	-	126,093.38	126,093.38
应收利息	-	-	-	199,892.03	199,892.03

应收申购款	-	-	-	2,396.40	2,396.40
资产总计	22,745,937.29	-	-	199,646,834.67	222,392,771.96
负债					
应付证券清算款	-	-	-	83,314.61	83,314.61
应付赎回款	-	-	-	219,847.72	219,847.72
应付管理人报酬	-	-	-	243,939.47	243,939.47
应付托管费	-	-	-	40,656.58	40,656.58
应付销售服务费	-	-	-	428.03	428.03
应付交易费用	-	-	-	346,673.82	346,673.82
其他负债	-	-	-	35,000.19	35,000.19
负债总计	-	-	-	969,860.42	969,860.42
利率敏感度缺口	22,745,937.29	-	-	198,676,974.25	221,422,911.54

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

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		
假设	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率上升25个基点	-	-549.81
	2. 市场利率下降25个基点	-	551.21

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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

于12月31日，本基金面临的其他市场价格风险列示如下：

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	98,111,594.51	86.72	199,318,452.86	90.02
交易性金融资产 — 基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产 — 贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产— 权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	98,111,594.51	86.72	199,318,452.86	90.02

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
	用期末时点比较基准浮动5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险		
	Beta系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日

	1. 业绩比较基准增加5%	4,996,395.74	11,630,770.87
	2. 业绩比较基准减少5%	-4,996,395.74	-11,630,770.87

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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银行存款、买入返售金融资产和其他金融负债等，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币97,635,986.72元，第二层次的余额为人民币5,504.49元，第三层次的余额为人民币470,103.30元(2020年12月31日：第一层次的余额为人民币196,116,212.35元，第二层次的余额为人民币9,080,680.92元，第三层次的余额为人民币3,120,659.59元)。

(ii) 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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金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根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	98,111,594.51	84.04
	其中：股票	98,111,594.51	84.04
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	18,072,113.71	15.48
8	其他各项资产	557,574.36	0.48
9	合计	116,741,282.58	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,318,305.91	63.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,456,000.00	1.29
E	建筑业	1,943,913.80	1.72
F	批发和零售业	1,005,000.00	0.89
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,677,398.05	9.44
J	金融业	2,597,700.00	2.30
K	房地产业	6,398,100.00	5.66
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	86,241.95	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	40,949.52	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,583,377.28	2.28
S	综合	-	-

	合计	98,111,594.51	86.72
--	----	---------------	-------

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	300274	阳光电源	25,000	3,645,000.00	3.22
2	601012	隆基股份	41,000	3,534,200.00	3.12
3	600519	贵州茅台	1,400	2,870,000.00	2.54
4	600893	航发动力	42,000	2,665,320.00	2.36
5	300059	东方财富	70,000	2,597,700.00	2.30
6	300750	宁德时代	4,400	2,587,200.00	2.29
7	300413	芒果超媒	45,000	2,574,900.00	2.28
8	002271	东方雨虹	48,000	2,528,640.00	2.24
9	600600	青岛啤酒	25,000	2,475,000.00	2.19
10	002139	拓邦股份	130,000	2,429,700.00	2.15
11	300260	新莱应材	50,000	2,358,500.00	2.08
12	688390	固德威	5,000	2,297,900.00	2.03
13	002508	老板电器	60,000	2,161,200.00	1.91
14	300014	亿纬锂能	18,000	2,127,240.00	1.88
15	600703	三安光电	55,000	2,065,800.00	1.83
16	000069	华侨城 A	290,000	2,041,600.00	1.80
17	000568	泸州老窖	8,000	2,030,960.00	1.80
18	002475	立讯精密	40,000	1,968,000.00	1.74
19	601669	中国电建	240,000	1,939,200.00	1.71
20	600801	华新水泥	100,000	1,930,000.00	1.71
21	002241	歌尔股份	35,000	1,893,500.00	1.67
22	603806	福斯特	14,000	1,827,700.00	1.62

23	688682	霍莱沃	11,000	1,792,780.00	1.58
24	001979	招商蛇口	130,000	1,734,200.00	1.53
25	300772	运达股份	39,000	1,715,220.00	1.52
26	002436	兴森科技	120,000	1,680,000.00	1.48
27	603997	继峰股份	100,000	1,608,000.00	1.42
28	688201	信安世纪	25,000	1,566,250.00	1.38
29	688303	大全能源	25,000	1,549,000.00	1.37
30	688187	时代电气	18,000	1,476,000.00	1.30
31	000591	太阳能	130,000	1,456,000.00	1.29
32	600048	保利发展	90,000	1,406,700.00	1.24
33	000739	普洛药业	40,000	1,403,600.00	1.24
34	688083	中望软件	4,000	1,399,320.00	1.24
35	688733	壹石通	17,000	1,355,920.00	1.20
36	300183	东软载波	70,000	1,276,100.00	1.13
37	688122	西部超导	13,000	1,260,220.00	1.11
38	002970	锐明技术	30,000	1,234,800.00	1.09
39	001914	招商积余	60,000	1,215,600.00	1.07
40	002191	劲嘉股份	80,000	1,210,400.00	1.07
41	002594	比亚迪	4,500	1,206,540.00	1.07
42	600406	国电南瑞	30,000	1,200,900.00	1.06
43	003031	中瓷电子	14,000	1,173,060.00	1.04
44	002311	海大集团	16,000	1,172,800.00	1.04
45	603599	广信股份	30,000	1,170,000.00	1.03
46	300687	赛意信息	40,000	1,167,200.00	1.03
47	300450	先导智能	15,000	1,115,550.00	0.99
48	000977	浪潮信息	30,000	1,074,900.00	0.95
48	000786	北新建材	30,000	1,074,900.00	0.95
50	002531	天顺风能	55,000	1,066,450.00	0.94
51	300228	富瑞特装	110,000	1,063,700.00	0.94
52	002756	永兴材料	7,000	1,036,140.00	0.92
53	000963	华东医药	25,000	1,005,000.00	0.89

54	600570	恒生电子	16,000	994,400.00	0.88
55	688516	奥特维	4,000	982,880.00	0.87
56	002837	英维克	20,000	817,800.00	0.72
57	301031	中熔电气	5,000	760,600.00	0.67
58	000333	美的集团	8,000	590,480.00	0.52
59	688670	金迪克	1,276	94,564.36	0.08
60	301038	深水规院	2,660	55,607.30	0.05
61	301029	怡合达	462	41,519.94	0.04
62	688038	中科通达	2,132	39,911.04	0.04
63	688701	卓锦股份	2,340	31,590.00	0.03
64	301050	雷电微力	117	27,464.58	0.02
65	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.02
66	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.02
67	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.02
68	001296	长江材料	310	18,376.80	0.02
69	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
70	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
71	301089	拓新药业	149	10,121.57	0.01
72	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.01
73	301087	可孚医疗	118	8,890.12	0.01
74	301090	华润材料	763	8,560.86	0.01
75	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.01
76	300814	中富电路	328	7,832.64	0.01
77	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.01
78	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.01
79	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.01
80	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.01
81	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.01
82	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.01
83	301179	泽宇智能	113	5,737.01	0.01
84	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00

85	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
86	301091	深城交	171	5,354.01	0.00
87	301093	华兰股份	107	5,333.95	0.00
88	301092	争光股份	144	5,114.88	0.00
89	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
90	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.00
91	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
92	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
93	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	601012	隆基股份	32,803,741.09	14.81
2	603259	药明康德	29,116,386.10	13.15
3	002812	恩捷股份	27,388,431.20	12.37
4	000858	五粮液	26,791,462.75	12.10
5	600809	山西汾酒	26,761,544.62	12.09
6	600438	通威股份	26,476,966.44	11.96
7	600036	招商银行	25,921,132.56	11.71
8	300568	星源材质	24,878,753.05	11.24
9	300759	康龙化成	24,004,105.00	10.84
10	601601	中国太保	23,089,261.44	10.43
11	300274	阳光电源	21,816,951.00	9.85
12	600309	万华化学	20,031,498.37	9.05
13	000932	华菱钢铁	19,440,114.98	8.78
14	603799	华友钴业	18,571,861.04	8.39
15	002475	立讯精密	18,533,510.61	8.37
16	600893	航发动力	18,271,219.20	8.25

17	600176	中国巨石	17,955,576.54	8.11
18	002415	海康威视	17,925,659.00	8.10
19	601633	长城汽车	17,061,175.00	7.71
20	600519	贵州茅台	16,968,587.00	7.66
21	300760	迈瑞医疗	16,807,605.64	7.59
22	300450	先导智能	16,195,251.22	7.31
23	688388	嘉元科技	15,929,193.00	7.19
24	300122	智飞生物	15,856,688.00	7.16
25	000002	万科A	15,565,783.28	7.03
26	688598	金博股份	15,460,387.01	6.98
27	600660	福耀玻璃	15,333,104.00	6.92
28	002594	比亚迪	15,063,478.46	6.80
29	002466	天齐锂业	14,923,888.34	6.74
30	000301	东方盛虹	14,530,037.00	6.56
31	002142	宁波银行	14,336,263.00	6.47
32	600132	重庆啤酒	13,945,905.15	6.30
33	688390	固德威	13,844,244.72	6.25
34	603690	至纯科技	13,596,157.00	6.14
35	300059	东方财富	13,550,399.06	6.12
36	688363	华熙生物	13,538,003.26	6.11
37	300750	宁德时代	13,379,672.75	6.04
38	000568	泸州老窖	13,247,666.00	5.98
39	000333	美的集团	13,112,816.00	5.92
40	688012	中微公司	12,777,196.98	5.77
41	002460	赣锋锂业	12,733,844.00	5.75
42	003022	联泓新科	12,542,563.40	5.66
43	600600	青岛啤酒	12,459,234.15	5.63
44	001914	招商积余	12,144,708.88	5.48
45	002241	歌尔股份	11,972,469.97	5.41
46	688006	杭可科技	11,606,607.73	5.24
47	300014	亿纬锂能	11,362,163.28	5.13

48	688122	西部超导	11,279,045.92	5.09
49	300413	芒果超媒	10,715,430.12	4.84
50	600690	海尔智家	10,415,573.00	4.70
51	600570	恒生电子	10,396,282.57	4.70
52	000933	神火股份	10,231,870.00	4.62
53	600702	舍得酒业	9,989,539.00	4.51
54	002601	龙佰集团	9,986,466.00	4.51
55	000001	平安银行	9,665,106.58	4.36
56	600110	诺德股份	9,655,981.00	4.36
57	603806	福斯特	9,645,684.62	4.36
58	688599	天合光能	9,617,199.53	4.34
59	603659	璞泰来	9,475,825.21	4.28
60	600048	保利发展	9,398,119.00	4.24
61	002064	华峰化学	9,326,811.69	4.21
62	600887	伊利股份	9,165,604.00	4.14
63	601225	陕西煤业	9,127,143.00	4.12
64	002709	天赐材料	9,119,548.68	4.12
65	688499	利元亨	9,117,697.03	4.12
66	688116	天奈科技	8,893,384.54	4.02
67	000739	普洛药业	8,863,833.93	4.00
68	300316	晶盛机电	8,813,366.00	3.98
69	002371	北方华创	8,760,601.00	3.96
70	688037	芯源微	8,562,835.88	3.87
71	601818	光大银行	8,043,600.00	3.63
72	600958	东方证券	7,839,502.00	3.54
73	000651	格力电器	7,832,521.02	3.54
74	300132	青松股份	7,793,521.00	3.52
75	603218	日月股份	7,754,114.25	3.50
76	002304	洋河股份	7,604,869.00	3.43
77	601877	正泰电器	7,569,943.46	3.42
78	603816	顾家家居	7,433,590.02	3.36

79	300896	爱美客	7,290,905.60	3.29
80	000887	中鼎股份	7,241,255.00	3.27
81	688186	广大特材	7,023,414.44	3.17
82	300357	我武生物	6,914,106.00	3.12
83	002497	雅化集团	6,820,758.26	3.08
84	688063	派能科技	6,810,662.62	3.08
85	300604	长川科技	6,707,596.00	3.03
86	000625	长安汽车	6,695,328.00	3.02
87	002078	太阳纸业	6,687,380.12	3.02
88	601336	新华保险	6,600,039.00	2.98
89	600276	恒瑞医药	6,598,293.40	2.98
90	600019	宝钢股份	6,592,549.84	2.98
91	002597	金禾实业	6,509,399.47	2.94
92	601318	中国平安	6,366,499.00	2.88
93	601995	中金公司	6,338,269.00	2.86
94	000799	酒鬼酒	6,301,057.00	2.85
95	300772	运达股份	6,299,262.00	2.84
96	000596	古井贡酒	6,251,290.00	2.82
97	002541	鸿路钢构	6,167,227.00	2.79
98	002459	晶澳科技	6,126,921.00	2.77
99	002531	天顺风能	5,945,582.00	2.69
100	300363	博腾股份	5,918,879.00	2.67
101	688005	容百科技	5,858,954.77	2.65
102	000830	鲁西化工	5,824,170.00	2.63
103	601966	玲珑轮胎	5,818,396.51	2.63
104	600486	扬农化工	5,784,180.32	2.61
105	601865	福莱特	5,731,603.00	2.59
106	688126	沪硅产业	5,637,451.51	2.55
107	600703	三安光电	5,570,418.00	2.52
108	600882	妙可蓝多	5,555,651.00	2.51
109	300661	圣邦股份	5,529,152.00	2.50

110	002727	一心堂	5,446,397.24	2.46
111	002714	牧原股份	5,427,473.14	2.45
112	600760	中航沈飞	5,246,104.03	2.37
113	601238	广汽集团	5,192,391.01	2.35
114	600711	盛屯矿业	5,145,038.00	2.32
115	601233	桐昆股份	5,053,416.10	2.28
116	601939	建设银行	5,040,285.00	2.28
117	002080	中材科技	5,020,822.30	2.27
118	000906	浙商中拓	4,999,656.94	2.26
119	002271	东方雨虹	4,972,466.00	2.25
120	600409	三友化工	4,971,962.00	2.25
121	000831	五矿稀土	4,956,463.98	2.24
122	603993	洛阳钼业	4,915,012.00	2.22
123	001979	招商蛇口	4,910,185.00	2.22
124	002572	索菲亚	4,893,007.00	2.21
125	601636	旗滨集团	4,866,878.00	2.20
126	603877	太平鸟	4,862,509.00	2.20
127	688733	壹石通	4,790,431.20	2.16
128	605111	新洁能	4,781,827.00	2.16
129	600392	盛和资源	4,774,934.46	2.16
130	002414	高德红外	4,746,410.55	2.14
131	003031	中瓷电子	4,724,450.00	2.13
132	002179	中航光电	4,684,766.00	2.12
133	300655	晶瑞电材	4,666,793.00	2.11
134	600763	通策医疗	4,645,288.00	2.10
135	600298	安琪酵母	4,631,635.00	2.09
136	601677	明泰铝业	4,588,813.10	2.07
137	688625	呈和科技	4,553,638.09	2.06
138	688303	大全能源	4,517,930.23	2.04
139	300035	中科电气	4,471,775.00	2.02
140	600460	士兰微	4,466,847.00	2.02

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	601012	隆基股份	39,625,332.40	17.90
2	000858	五粮液	38,642,335.62	17.45
3	002812	恩捷股份	35,211,908.76	15.90
4	603259	药明康德	34,485,505.52	15.57
5	600438	通威股份	33,354,012.68	15.06
6	600809	山西汾酒	30,350,492.05	13.71
7	600036	招商银行	29,156,450.76	13.17
8	300568	星源材质	24,519,846.49	11.07
9	300759	康龙化成	24,426,217.65	11.03
10	600519	贵州茅台	23,459,696.00	10.59
11	601601	中国太保	22,851,494.98	10.32
12	600309	万华化学	22,809,723.34	10.30
13	300760	迈瑞医疗	22,701,539.88	10.25
14	300750	宁德时代	21,957,552.51	9.92
15	002475	立讯精密	21,037,653.59	9.50
16	300274	阳光电源	20,725,909.00	9.36
17	600893	航发动力	20,289,636.80	9.16
18	002594	比亚迪	19,899,148.00	8.99
19	000932	华菱钢铁	19,358,108.70	8.74
20	601633	长城汽车	18,938,332.40	8.55
21	600690	海尔智家	17,946,060.56	8.10
22	688363	华熙生物	17,942,231.96	8.10
23	688598	金博股份	17,761,880.84	8.02
24	000568	泸州老窖	17,754,340.04	8.02
25	002415	海康威视	17,523,644.00	7.91

26	603799	华友钴业	17,451,356.50	7.88
27	300059	东方财富	17,363,151.50	7.84
28	688388	嘉元科技	16,824,759.77	7.60
29	002466	天齐锂业	16,790,581.28	7.58
30	600176	中国巨石	16,555,255.71	7.48
31	600660	福耀玻璃	16,179,884.62	7.31
32	000001	平安银行	16,070,507.00	7.26
33	002460	赣锋锂业	15,323,960.48	6.92
34	600887	伊利股份	15,278,856.96	6.90
35	688012	中微公司	15,232,650.32	6.88
36	300450	先导智能	15,188,967.26	6.86
37	000333	美的集团	15,050,026.45	6.80
38	000002	万科A	14,966,309.78	6.76
39	300122	智飞生物	14,731,743.34	6.65
40	000301	东方盛虹	14,640,543.00	6.61
41	003022	联泓新科	14,462,069.14	6.53
42	688006	杭可科技	14,061,472.66	6.35
43	002142	宁波银行	13,750,008.00	6.21
44	600132	重庆啤酒	13,425,348.00	6.06
45	603690	至纯科技	13,051,837.10	5.89
46	601318	中国平安	12,666,592.00	5.72
47	300316	晶盛机电	12,324,490.76	5.57
48	600570	恒生电子	12,288,199.10	5.55
49	600600	青岛啤酒	11,809,643.00	5.33
50	002601	龙佰集团	10,900,894.00	4.92
51	688390	固德威	10,771,694.24	4.86
52	688122	西部超导	10,691,434.07	4.83
53	001914	招商积余	10,423,581.00	4.71
54	002241	歌尔股份	10,395,534.81	4.69
55	600110	诺德股份	10,351,892.03	4.68
56	002709	天赐材料	10,270,641.70	4.64

57	002064	华峰化学	10,179,189.93	4.60
58	603659	璞泰来	10,073,396.60	4.55
59	000596	古井贡酒	10,062,154.00	4.54
60	688499	利元亨	9,948,438.06	4.49
61	000933	神火股份	9,820,938.00	4.44
62	002371	北方华创	9,747,372.27	4.40
63	688116	天奈科技	9,579,874.90	4.33
64	600702	舍得酒业	9,454,214.00	4.27
65	688599	天合光能	9,440,276.91	4.26
66	300896	爱美客	9,417,256.00	4.25
67	300413	芒果超媒	9,311,180.00	4.21
68	002078	太阳纸业	9,219,163.00	4.16
69	300014	亿纬锂能	8,983,218.00	4.06
70	601225	陕西煤业	8,598,111.00	3.88
71	601877	正泰电器	8,290,069.00	3.74
72	000739	普洛药业	8,108,295.00	3.66
73	688005	容百科技	8,067,504.94	3.64
74	603218	日月股份	7,993,140.00	3.61
75	601818	光大银行	7,924,800.00	3.58
76	688037	芯源微	7,893,365.12	3.56
77	300132	青松股份	7,684,223.78	3.47
78	600048	保利发展	7,651,368.75	3.46
79	000651	格力电器	7,553,554.81	3.41
80	603806	福斯特	7,506,116.00	3.39
81	601336	新华保险	7,448,204.00	3.36
82	600958	东方证券	7,269,833.00	3.28
83	000887	中鼎股份	7,185,389.00	3.25
84	600305	恒顺醋业	7,169,109.28	3.24
85	601995	中金公司	7,130,381.00	3.22
86	688186	广大特材	7,095,832.71	3.20
87	603816	顾家家居	7,080,885.70	3.20

88	002459	晶澳科技	6,965,302.00	3.15
89	300357	我武生物	6,898,927.32	3.12
90	300604	长川科技	6,847,260.00	3.09
91	600019	宝钢股份	6,845,303.76	3.09
92	600030	中信证券	6,818,952.01	3.08
93	002304	洋河股份	6,777,930.00	3.06
94	000625	长安汽车	6,553,615.60	2.96
95	601899	紫金矿业	6,525,476.00	2.95
96	002497	雅化集团	6,432,883.12	2.91
97	002597	金禾实业	6,357,634.00	2.87
98	000799	酒鬼酒	6,257,638.00	2.83
99	002541	鸿路钢构	6,233,744.00	2.82
100	300661	圣邦股份	6,228,195.00	2.81
101	002977	天箭科技	6,226,286.00	2.81
102	600276	恒瑞医药	6,215,016.00	2.81
103	688063	派能科技	6,137,237.98	2.77
104	600741	华域汽车	5,861,226.36	2.65
105	002311	海大集团	5,792,350.90	2.62
106	300363	博腾股份	5,713,020.00	2.58
107	601966	玲珑轮胎	5,700,559.00	2.57
108	601865	福莱特	5,521,279.00	2.49
109	600031	三一重工	5,487,998.05	2.48
110	600711	盛屯矿业	5,480,726.00	2.48
111	688126	沪硅产业	5,466,669.01	2.47
112	300775	三角防务	5,426,674.00	2.45
113	600486	扬农化工	5,384,705.00	2.43
114	600882	妙可蓝多	5,359,209.00	2.42
115	000831	五矿稀土	5,259,818.00	2.38
116	000830	鲁西化工	5,210,829.00	2.35
117	601238	广汽集团	5,201,948.00	2.35
118	002080	中材科技	5,171,970.52	2.34

119	002714	牧原股份	5,115,432.00	2.31
120	603877	太平鸟	5,097,757.00	2.30
121	002531	天顺风能	5,083,197.00	2.30
122	000906	浙商中拓	5,033,730.89	2.27
123	002727	一心堂	5,002,909.00	2.26
124	601636	旗滨集团	4,981,013.00	2.25
125	601939	建设银行	4,895,214.00	2.21
126	600392	盛和资源	4,870,642.35	2.20
127	600760	中航沈飞	4,760,985.00	2.15
128	002572	索菲亚	4,759,235.00	2.15
129	603993	洛阳钼业	4,756,384.39	2.15
130	002414	高德红外	4,750,408.20	2.15
131	600298	安琪酵母	4,611,621.13	2.08
132	600763	通策医疗	4,606,629.16	2.08
133	688625	呈和科技	4,597,827.42	2.08
134	002179	中航光电	4,583,725.00	2.07
135	601677	明泰铝业	4,552,376.00	2.06
136	601233	桐昆股份	4,546,789.40	2.05

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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	1,990,438,974.36
卖出股票收入（成交）总额	2,097,414,687.70

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额填列，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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 本基金本报告期内投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	95,942.89
2	应收证券清算款	448,255.23
3	应收股利	-
4	应收利息	5,595.44
5	应收申购款	7,780.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	557,574.36

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.12.5 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的股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
人保 转型 混合A	497	122,064.98	58,520,535.14	96.4 6%	2,145,761.20	3.54%
人保 转型 混合C	487	17,128.83	0.00	0.00%	8,341,738.14	100.0 0%
合计	948	72,793.29	58,520,535.14	84.8 0%	10,487,499.34	15.20%

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	人保转型混合A	10,591.63	0.02%

基金	人保转型混合C	2,829.61	0.03%
	合计	13,421.24	0.02%

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	人保转型混合A	0
	人保转型混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	人保转型混合A	0~10
	人保转型混合C	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	人保转型混合A	人保转型混合C
基金合同生效日(2018年06月21日)基金份额总额	83,163,790.13	164,631,616.25
本报告期期初基金份额总额	129,601,083.02	813,750.71
本报告期基金总申购份额	14,633,571.60	15,717,144.58
减：本报告期基金总赎回份额	83,568,358.28	8,189,157.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	60,666,296.34	8,341,738.14

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；
2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§ 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

2021年3月8日，经本基金管理人董事会审议通过，并报中国银行保险监督管理委员会核准同意，曾北川先生任中国人保资产管理有限公司总裁。

2021年7月21日，经中国人民保险集团股份有限公司党委决定，本基金管理人董事会审议通过，并报中国银行保险监督管理委员会核准同意，罗熹先生任中国人保资产管理有限公司非执行董事、董事长。

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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金的审计机构是德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。目前事务所已提供审计服务从基金成立起至今。本基金本报告期内应支付给德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)的基金审计费用为4万元整。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	697,596,502.27	17.09%	510,153.82	17.09%	-
长城证券	1	164,203,663.84	4.02%	120,082.04	4.02%	-
申万宏源证券	1	1,485,028,521.25	36.37%	1,085,998.92	36.37%	-

兴业证券	1	1,078,354,977.87	26.41%	788,600.13	26.41%	-
招商证券	1	657,437,291.00	16.10%	480,782.29	16.10%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。

1、基金交易单元的选择标准如下：

(1)基本情况：包括但不限于资本充足，财务状况及最近三年盈利情况良好；主要股东实力强大；具备投资组合运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合进行证券交易的需要，并能为投资组合提供全面的信息服务；

(2)公司治理：公司治理完善，股东会、董事会、监事会及管理层权责明确，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足投资组合运作高度保密的要求；

(3)研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究人员以及研究水平处于行业领先水平的研究员；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，并能在符合相关法规及执业规范的前提下，根据公司的特定要求，提供专题研究报告；研究报告应分析严谨，观点独立、客观，并具备较强风险意识和风险测算能力；

2、基金交易单元的选择程序如下：

(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内退租长城证券交易席位1个，无新增交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	22,132,070.60	100.00%	230,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中国人保资产管理有限公司旗下基金2020年4季度报告提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
2	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-22
3	中国人保资产管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
4	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
5	关于旗下部分基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-03
6	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2021年第1号)	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-03
7	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-03
8	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年1季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-22
9	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-22
10	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金投资范围新增存托凭证、增加侧袋机制、根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号—指数基金指引》修改法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
11	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
12	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
13	关于旗下基金招募说明书及基金产品资料概要更新的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-08

14	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-08
15	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新(2021年第2号)	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-08
16	关于旗下部分基金新增阳光人寿保险股份有限公司为销售机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-27
17	中国人保资产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	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-30
18	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年2季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-21
19	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-21
20	关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-27
21	中国人保资产管理有限公司关于旗下部分基金参与招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-07-31
22	中国人保资产管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-08-31
23	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-08-31
24	关于旗下部分基金参与宁波银行股份有限公司同业易管家平台费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-09-13
25	中国人保资产管理有限公司旗下基金2021年3季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-10-27
26	人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金2021年第三季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021-10-27
27	关于旗下部分基金参与国信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-11-25
28	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	中国证监会规定报刊及网站	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	20210101 - 20211231	52,323,480.56	0.00	0.00	52,323,480.56	75.82%
	2	20210101 - 20211223	50,896,689.19	5,355,363.93	56,252,053.12	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，该类投资者大额赎回所持有的基金份额时，将可能产生流动性风险，即基金资产不能迅速变现，或者未能以合理的价格变现基金资产以支付投资者赎回款，对资产净值产生不利影响。</p> <p>当开放式基金发生巨额赎回，基金管理人认为基金组合资产变现能力有限或认为因应对赎回导致的资产变现对基金单位份额净值产生较大的波动时，为了切实保护存量基金份额持有人的合法权益，可能出现延期支付赎回款等情形。同时为了公平对待所有投资者合法权益不受损害，管理人有权根据基金合同和招募说明书的约定，暂停或者拒绝申购、暂停赎回，基金份额持有人存在可能无法及时赎回持有的全部基金份额的风险。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。此外，当单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</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、中国证监会准予人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 5、报告期内人保转型新动力灵活配置混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区西长安街88号中国人保大厦

基金托管人办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中国人保资产管理有限公司。

客户服务中心电话：400-820-7999

基金管理人网址：fund.piccamc.com

中国人保资产管理有限公司

二〇二二年三月三十一日