

# 金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：金信基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 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。

本报告中的财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	7
3.2 基金净值表现 .....	8
3.3 其他指标 .....	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	11
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
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 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	20
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	24

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	56
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 .....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	63
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 .....	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
8.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	65
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 .....	66
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	66
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>66</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
11.4 基金投资策略的改变 .....	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
11.8 其他重大事件 .....	69
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>71</b>
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 .....	71
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	71
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>71</b>
13.1 备查文件目录 .....	71
13.2 存放地点 .....	71
13.3 查阅方式 .....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金信民长灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金信民长混合	
基金主代码	005412	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 21 日	
基金管理人	金信基金管理有限公司	
基金托管人	中信建投证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	99,332,788.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金信民长混合 A	金信民长混合 C
下属分级基金的交易代码	005412	005413
报告期末下属分级基金的份额总额	47,711,841.93 份	51,620,946.51 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合,在严格控制风险的前提下,力争为基金持有人获取长期持续稳定的投资回报。
投资策略	<p>本基金的投资策略主要有以下六个方面:</p> <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金在《基金合同》约定的范围内实施稳健的整体资产配置,根据各项重要经济指标分析宏观经济发展变动趋势,判断当前所处的经济周期,进而对未来做出科学预测。在此基础上,结合对流动性及资金流向的分析,综合股市估值水平和债市收益率情况及风险分析,进行灵活的大类资产配置进而在固定收益类资产、权益类资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金在综合分析宏观经济、货币政策的基础上,采用久期管理和信用风险管理相结合的投资策略。在债券组合的具体构造和调整上,本基金综合运用久期调整、收益率曲线形变预测、信用利差和信用风险管理、回购套利等组合管理手段进行日常管理。</p> <p>在个券选择上,本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用风险分析、隐含期权价值评估、流动性分析等方法来评估个券的投资价值。</p> <p>可转换债券和可交换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性,具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将选择公司基本素质优良、其对应的基础证券有着较高上涨潜力的可转换债券和可交换债券进行投资,并采用期权定价模型等数量化估值工具评定其投资价值,以合理价格买入并持有。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资以自下而上的精选个股为主,采用定量和定性相结合的方式,投资以成长型股票为主。</p> <p>4、资产支持证券等品种投资策略</p>

	<p>本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用数量化定价模型，评估其内在价值，以合理价格买入并持有。</p> <p>5、国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%
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，高于债券型基金及货币市场基金，属于较高收益、较高风险特征的基金。

### 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		金信基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王几高	朱志明
	联系电话	0755-82510502	4008-888-108
	电子邮箱	jubao@jxfunds.com.cn	tgguzhi@csc.com.cn
客户服务电话		400-900-8336	95587
传真		0755-82510305	010-85130975
注册地址		深圳市前海深港合作区兴海大道3040号前海世茂大厦2603	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		深圳市前海深港合作区兴海大道3040号前海世茂大厦2603 深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室	北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座10层
邮政编码		518038	100010
法定代表人		殷克胜	王常青

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jxfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大厦8层
注册登记机构	金信基金管理有限公司	深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦1502室 深圳市前海深港合作区兴海大道3040号前海世茂大厦2603

### § 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	2022 年		2021 年		2020 年 5 月 21 日 (基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日	
	金信民长混合 A	金信民长混合 C	金信民长混合 A	金信民长混合 C	金信民长混合 A	金信民长混合 C
本期已实现收益	-6,778,073.26	-11,917,849.41	5,731,401.37	9,598,645.55	1,920,909.77	932,113.01
本期利润	-23,736,771.04	-31,494,893.71	10,838,882.73	20,053,801.90	2,007,932.16	1,056,731.44
加权平均基金份额本期利润	-0.4232	-0.4806	0.2730	0.3310	0.6016	0.4220
本期加权平均净值利润率	-22.93%	-27.46%	13.17%	16.82%	57.18%	40.30%
本期基金份额净值增长率	-18.16%	-18.25%	50.41%	50.28%	41.63%	34.68%
3.1.2 期末数据和	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

指标						
期末可供分配利润	12,577,417.42	10,227,808.76	22,892,849.83	24,415,972.27	147,520.93	117,828.99
期末可供分配基金份额利润	0.2636	0.1981	0.3354	0.2682	0.2976	0.2339
期末基金资产净值	83,180,477.82	85,416,489.72	145,404,903.16	184,272,814.01	702,084.33	678,365.26
期末基金份额净值	1.7434	1.6547	2.1303	2.0240	1.4163	1.3468
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金份额累计净值增长率	74.34%	65.47%	113.03%	102.40%	41.63%	34.68%

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,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(为期末余额,不是当期发生数)。

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

### 3.2 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

金信民长混合 A

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----



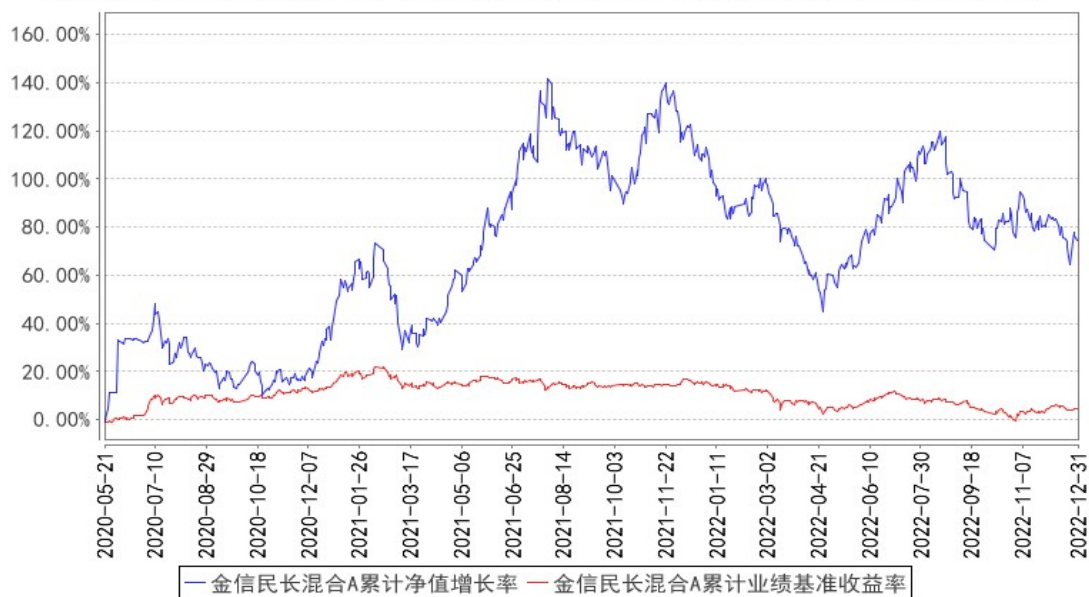
	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-0.13%	1.82%	0.98%	0.64%	-1.11%	1.18%
过去六个月	-7.42%	1.87%	-6.22%	0.55%	-1.20%	1.32%
过去一年	-18.16%	1.87%	-9.56%	0.64%	-8.60%	1.23%
自基金合同生效 起至今	74.34%	2.17%	4.51%	0.62%	69.83%	1.55%

金信民长混合 C

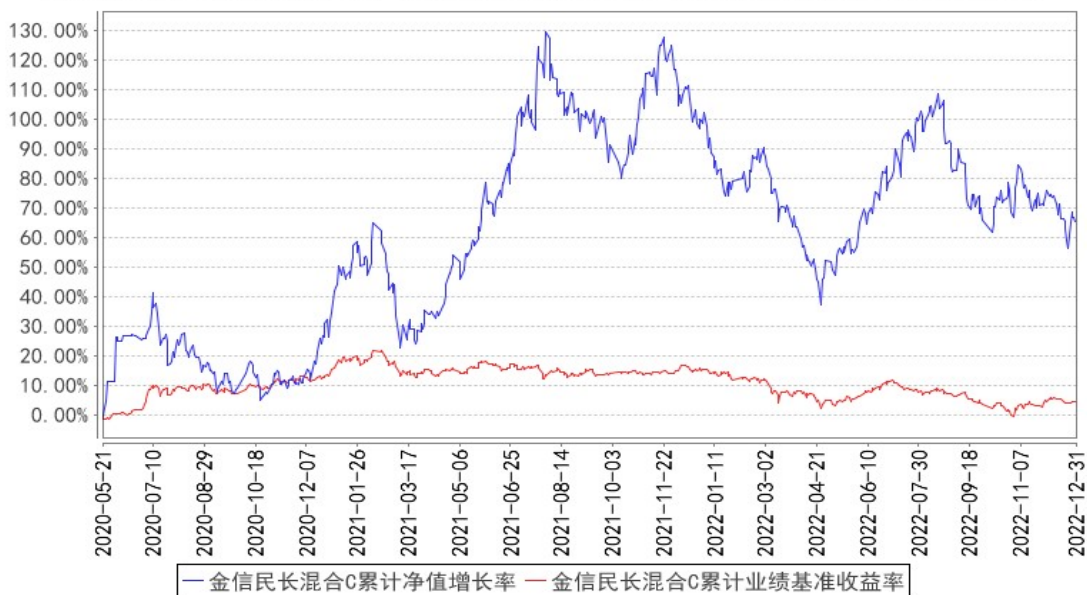
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.15%	1.82%	0.98%	0.64%	-1.13%	1.18%
过去六个月	-7.47%	1.87%	-6.22%	0.55%	-1.25%	1.32%
过去一年	-18.25%	1.87%	-9.56%	0.64%	-8.69%	1.23%
自基金合同生效 起至今	65.47%	2.10%	4.51%	0.62%	60.96%	1.48%

### 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

金信民长混合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

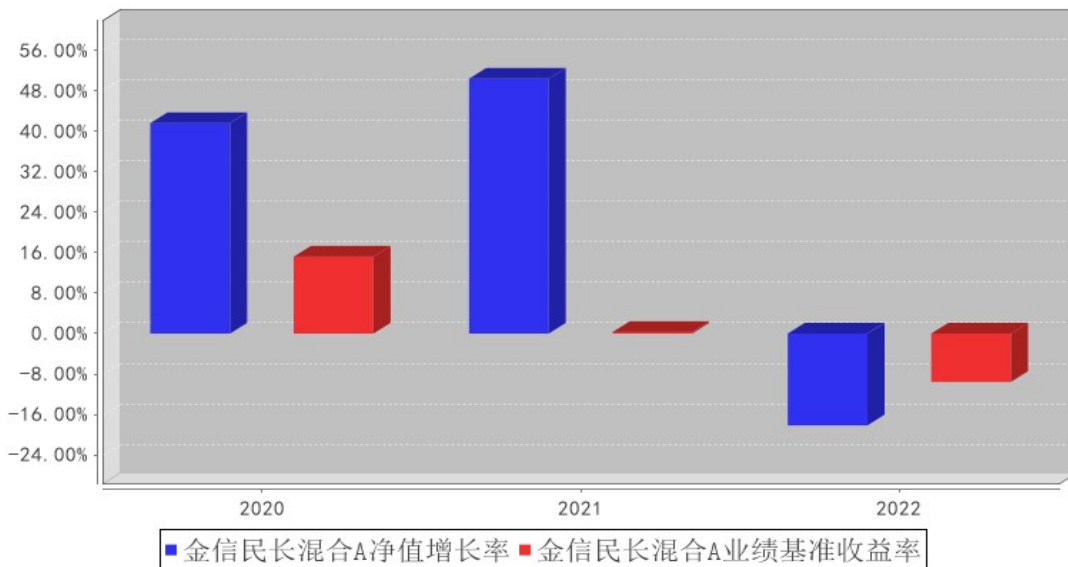


金信民长混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

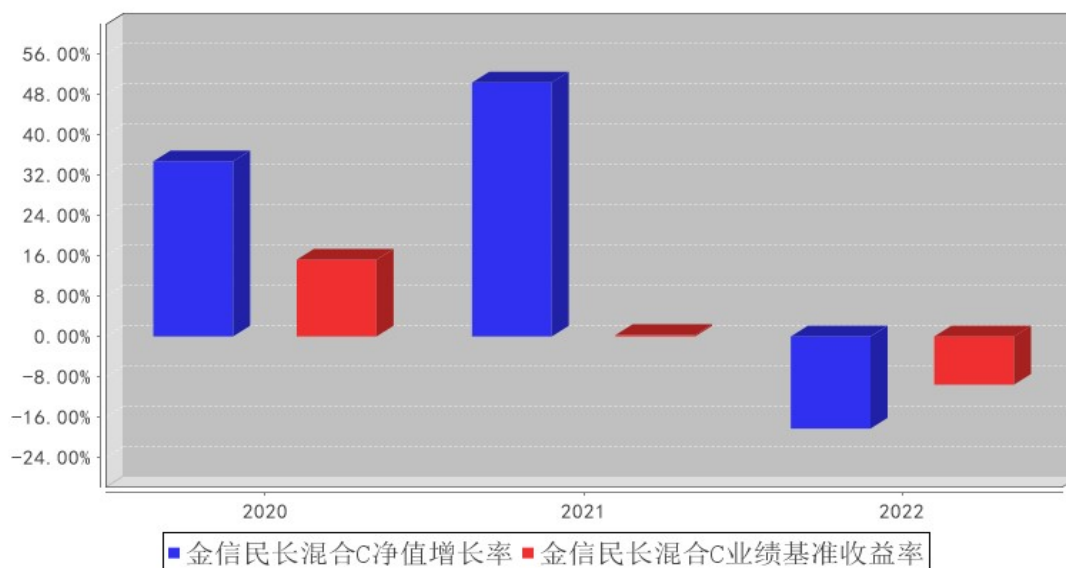


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金信民长混合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



金信民长混合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：本基金的基金合同于 2020 年 5 月 21 日生效，2020 年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金的基金合同于2020年5月21日生效，截至2022年12月31日，本基金成立未满三年。自合同生效起，本基金无利润分配事项。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

金信基金管理有限公司成立于 2015 年 7 月，注册资本 1 亿元人民币，注册地位于深圳前海，是经中国证监会批准设立的公募基金管理公司，业务范围包括基金募集、基金销售、基金管理、特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

金信基金管理有限公司作为国内首家管理团队出任第一大股东的公募基金公司，管理团队持股 35%，是公司第一大股东。此外，公司股东还包括深圳卓越创业投资有限责任公司及安徽国元信托有限责任公司，两家机构出资比例分别为：34%、31%。

截至报告期末，金信基金管理有限公司旗下管理 15 只开放式基金和 2 只资产管理计划。

#### 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
刘榕俊	本基金的基金经理	2022年8月16日	-	17年	北京大学经济学学士、中国科学院金融学硕士。2002年开始先后任职于招商基金、景顺长城基金、英大证券资产管理部。于2015年6月加入金信基金，现任金信基金投资决策委员会委员、基金经理。
周溢	本基金的基金经理	2020年5月21日	2022年8月26日	13年	男，中国人民大学应用数学硕士，具有基金从业资格。先后任职于中再资产管理股份有限公司、平安证券有限责任公司、国金创新投资有限公司、深圳铸成投资有限公司及财富证券有限责任公司。现任金信基金基金经理。
孙磊	本基金的基金经理	2020年9月29日	2022年6月9日	9年	男，华东师范大学化学学士、金融学硕士。曾先后任职于天相投资顾问有限公司、涌泉亿信投资管理有限公司、上海博观投资管理有限公司。2016年6月加入金信基金，任投资经理兼化工行业研究员。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况，本项不适用。

#### 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运作管理办法》、《公开募集证券投资基金销售管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有发生损害基金持有人利益的情形。基金的投资范围、投资比例符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中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》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订）等有关法律法规的规定，针对股票、债券市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，制定了《金信基金管理有限公司公平交易制度》、《金信基金管理有限公司异常交易监控与报告管理制度》等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 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》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况，本项不适用。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 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

受多重因素叠加影响，2022 年 A 股市场大幅震荡，一季度美联储加息、俄乌战争、疫情反复、通胀预期等国内外因素给 A 股市场造成巨大压力，投资者风险厌恶情绪上升，市场出现大幅下跌，之前估值相对较高的热门赛道遭受重挫，稳增长预期和低估值个股相对抗跌。4 月底，随着疫情可控、稳经济一揽子政策措施出台，市场在大幅下跌之后出现反弹。下半年受能源价格高企、地缘政治、国内外经济增长放缓预期等因素影响，市场震荡走弱，11 月，在房地产政策松绑、疫情管控放松和经济稳增长预期增强下，市场在低位出现小幅反弹，同时行情结构性分化明显。

报告期内本基金重点投资于新能源方向，我们认为，能源是国民经济各行业经济活动的必需成本，虽然光伏风电等行业经过多年的发展已较为成熟，但全球能源结构变化的影响才刚刚开始，新能源的发展符合能源价格下降和稳定可持续的要求，新能源的发展前景广阔。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末金信民长混合 A 基金份额净值为 1.7434 元，本报告期基金份额净值增长率为 -18.16%；截至本报告期末金信民长混合 C 基金份额净值为 1.6547 元，本报告期基金份额净值增长率为 -18.25%；同期业绩比较基准收益率为 -9.56%。

#### 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 2023 年，不确定性因素对市场的负面影响逐渐弱化，美联储加息节奏放缓，房地产政策拐点已经出现，过去受到疫情抑制的领域需求将逐步回归正常。同时另一方面，经济稳增长的需求非常迫切，2022 年四季度，消费、投资、贸易、物流、工业生产等数据出现持续下滑。2022 年底中央经济工作会议明确提出，积极的财政政策要加力提效，稳健的货币政策要精准有力，稳健积极将是 2023 年宏观政策的主基调，新一轮货币宽松和稳增长政策空间打开。

双碳政策下，新能源、环保节能等行业发展空间巨大。中国在 2030 年要实现碳达峰，在 2060 年要实现碳中和，这是未来几十年中国确定要做的事情，很多行业都受此影响，政策的支持、市场的拓展、需求的提升、成本的降低、技术的进步等带来广阔的发展空间。以储能为例，随着风光电高比例接入电网，新能源在整体比例快速提升的同时，电网安全也越来越收到重视，储能可平抑风光电不稳定性，已渐成刚需。随着技术的发展、成本的降低、应用的拓展，储能越来越具备经济性，储能作为目前市场的高成长板块，值得重点关注。2023 年新能源行业继续保持快速增长，同时会出现明显分化，在市场稳定环境下，扩产壁垒较高、竞争优势明显、盈利稳定性强的龙头公司估值有较大的向上修复机会。我们继续看好新能源行业的发展。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 本年度，公司采取外聘律师和内部专业人士相结合的方式，对各业务部门进行了相关法律法规培训和职业道德培训，进一步提高了公司从业人员的合规素质和职业道德修养。

(2) 本年度，公司按照证监会的要求对公司治理、投资、研究、交易、基金会计、注册登记、人力资源、基金销售等主要业务进行了定期稽核工作。同时，对信息技术、用户权限、通信管理

与视频监控、基金直销、后台运营、内幕交易防控等相关业务开展了专项稽核工作，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性。

(3) 通过事前合规防范、事中系统控制和事后完善纠偏的方式，加强对公司产品日常投资运作的管理和监控，保证投资符合既定的投资决策程序和业务流程，基金投资组合及个股投资比例符合比例控制的要求，严格执行分级授权制度，保证基金投资独立、公平。

(4) 全面参与新产品设计、新业务拓展工作，负责日常合同审查，监督客户投诉处理。

(5) 完成各基金及公司的各项信息披露工作，保证所披露的信息的真实性、准确性和完整性；重视媒体监督和投资者关系管理。

(6) 按照规定向人民银行报送反洗钱相关报表和报告，按监管要求制定客户洗钱风险划分的标准，并升级了客户洗钱风险划分系统。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定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。

本基金管理人由总经理、督察长、运作保障部、基金投资部、监察稽核部、交易部负责人及其他相关人员，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。该等人员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，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；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日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。每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

根据上述分配原则以及基金的实际运作情况，本报告期本基金未有分配事项。

#### 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

本基金本报告期内，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

在本报告期内，本基金托管人在托管金信民长灵活配置混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

## § 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	毕马威华振审字第 2302285 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	金信民长灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的金信民长灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表，净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中



	国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,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>该基金管理人金信基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。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>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该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,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该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</p>

	<p>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) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	吴钟鸣   查路凡
会计师事务所的地址	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大厦8层
审计报告日期	2023年3月29日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：金信民长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,138,600.64	26,629,895.23
结算备付金		439,110.46	3,061,241.70
存出保证金		272,684.44	1,094,418.99
交易性金融资产	7.4.7.2	160,941,841.55	294,069,834.74
其中：股票投资		151,623,705.99	287,767,734.74
基金投资		-	-
债券投资		9,318,135.56	6,302,100.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,873,008.24	10,055,168.37
应收股利		-	-
应收申购款		145,765.93	1,255,563.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	16,514.83
资产总计		169,811,011.26	336,182,637.84
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		751,237.52	5,024,322.19
应付管理人报酬		148,569.21	300,469.37
应付托管费		14,856.92	30,046.95
应付销售服务费		7,535.76	16,916.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	38.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	291,844.31	1,133,127.71
负债合计		1,214,043.72	6,504,920.67
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	99,332,788.44	159,300,901.18
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	69,264,179.10	170,376,815.99
净资产合计		168,596,967.54	329,677,717.17
负债和净资产总计		169,811,011.26	336,182,637.84

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 99,332,788.44 份，其中金信民长灵活配置混合型证券投资基金 A 类基金份额 47,711,841.93 份，基金份额净值 1.7434 元；金信民长灵活配置

混合型证券投资基金 C 类基金份额 51,620,946.51 份，基金份额净值 1.6547 元。

## 7.2 利润表

会计主体：金信民长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-52,554,832.79	40,586,907.98
1. 利息收入		211,743.26	246,756.89
其中：存款利息收入	7.4.7.13	204,886.54	233,032.36
债券利息收入		-	13,724.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		6,856.72	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-16,839,548.75	19,292,976.47
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-20,586,950.90	18,850,996.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	2,932,601.22	38,372.76
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	814,800.93	403,607.58
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-36,535,742.08	15,562,637.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	608,714.78	5,484,536.91
<b>减：二、营业总支出</b>		2,676,831.96	9,694,223.35
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,190,753.58	1,957,459.57
2. 托管费	7.4.10.2.2	219,075.41	195,745.99
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	115,383.19	115,736.76

4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,592.35	-
其中：卖出回购金融资产支出		1,592.35	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		27.43	49.43
8. 其他费用	7.4.7.23	150,000.00	7,425,231.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-55,231,664.75	30,892,684.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-55,231,664.75	30,892,684.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-55,231,664.75	30,892,684.63

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金信民长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	159,300,901.18	-	170,376,815.99	329,677,717.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	159,300,901.18	-	170,376,815.99	329,677,717.17
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-59,968,112.74	-	-101,112,636.89	-161,080,749.63

(一)、综合收益总额	-	-	-55,231,664.75	-55,231,664.75
(二)、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)	-59,968,112.74	-	-45,880,972.14	-105,849,084.88
其中:1.基金申购款	95,741,309.39	-	79,202,233.24	174,943,542.63
2.基金赎回款	-155,709,422.13	-	-125,083,205.38	-280,792,627.51
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	99,332,788.44	-	69,264,179.10	168,596,967.54
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产(基金净值)	999,375.40	-	381,074.19	1,380,449.59
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	999,375.40	-	381,074.19	1,380,449.59
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	158,301,525.78	-	169,995,741.80	328,297,267.58
(一)、综合收益总额	-	-	30,892,684.63	30,892,684.63
(二)、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)	158,301,525.78	-	139,103,057.17	297,404,582.95
其中:1.基金申购款	657,354,929.59	-	651,286,327.80	1,308,641,257.39
2.基金赎回款	-499,053,403.81	-	-512,183,270.63	-1,011,236,674.44
(三)、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)				
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	159,300,901.18	-	170,376,815.99	329,677,717.17

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：

殷克胜

朱斌

陈瑾

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

金信民长灵活配置混合型证券投资基金（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”）证监许可[2019]2949号《关于准予金信民长灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》注册，由金信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信民长灵活配置混合型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，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,671,113.55 元，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）毕马威华振验字第 2000228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,671,113.55 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为金信基金管理有限公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

根据《金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《金信民长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同将基金份额



分为不同类别。其中收取认(申)购费,不收取销售服务费的,称为 A 类基金份额;收取销售服务费,不收取认(申)购费的,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许发行的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债券)、可交换债券、次级债)、同业存单、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、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,但需符合中国证监会相关规定。本基金股票资产占基金资产的 0%-95%;投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;本基金每个交易日日终,在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50%+中证综合债指数收益率×50%。

本财务报表由本基金的基金管理人金信基金管理有限公司于 2023 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现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。

### 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

#### (a) 初始确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

#### (b) 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

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

##### - 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d) 减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期

信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产款在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期

损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债权投资在持有期间按票面利率计算的利息。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股

票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行了财政部发布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”）和 2022 年中国证监会发布的修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》。

###### （a）新金融工具准则

根据财政部发布的新金融工具准则相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，本基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

新金融工具准则修订了财政部于 2006 年颁布的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》和《企业会计准则第 24 号——套期保值》以及财政部于 2014 年修订的《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“原金融工具准则”）。

新金融工具准则将金融资产划分为三个基本分类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；及（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在新金融工具准则下，金融资产的分类是基于本基金管理金融资产的业务模式及该资产的合同现金流量特征而确定。新金融工具准则取消了原金融工具准则中规定的持有至到期投资、贷款和应收款项及可供出售金融资产四个分类类别。根据新金融工具准则，嵌入衍生工具不再从金融资产的主合同中分拆出来，而是将混合金融工具整体适用关于金融资产分类的相关规定。



新金融工具准则以“预期信用损失”模型替代了原金融工具准则中的“已发生损失”模型。“预期信用损失”模型要求持续评估金融资产的信用风险，因此在新金融工具准则下，本基金信用损失的确认时点早于原金融工具准则。

本基金按照新金融工具准则的衔接规定，对新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）未终止确认的金融工具的分类和计量（含减值）进行追溯调整。本基金未调整比较财务报表数据，将金融工具的原账面价值和在新金融工具准则施行日的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初留存收益。

(b) 修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

本基金根据修订的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》编制财务报表时，调整了部分财务报表项目的列报和披露，未对财务报表列报和披露产生重大影响。

执行上述会计政策对本基金资产负债表的影响汇总如下：

(i) 金融工具的分类影响

以摊余成本计量的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 26,629,895.23 元、3,061,241.70 元、1,094,418.99 元、16,514.83 元、10,055,168.37 元和 1,255,563.98 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收清算款和应收申购款，金额分别为 26,638,530.48 元、3,062,757.06 元、1,094,960.74 元、10,055,168.37 元和 1,255,563.98 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，金额为 294,069,834.74 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为交易性金融资产，金额为 294,075,657.21 元。

以摊余成本计量的金融负债

于 2021 年 12 月 31 日，本基金按照原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应交税费、其他负债-预提费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,024,322.19 元、300,469.37 元、30,046.95 元、16,916.25 元、1,090,976.87 元、38.20 元、40,000.00 元和 2,150.84 元。

于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、

应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、应交税费、其他负债-预提费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,024,322.19 元、300,469.37 元、30,046.95 元、16,916.25 元、1,090,976.87 元、38.20 元、40,000.00 元和 2,150.84 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等对应的应计利息余额均列示在应收利息或应付利息科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金按照新金融工具准则，将上述应计利息分别转入银行存款、结算备付金、存出保证金、交易性金融资产、买入返售金融资产和卖出回购金融资产款等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1

年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

#### 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	5,138,600.64	26,629,895.23
等于：本金	5,137,095.71	26,629,895.23
加：应计利息	1,504.93	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	5,138,600.64	26,629,895.23

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	172,378,135.54	-	151,623,705.99	-20,754,429.55	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	9,202,434.00	122,735.56	9,318,135.56	-7,034.00
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	9,202,434.00	122,735.56	9,318,135.56	-7,034.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		181,580,569.54	122,735.56	160,941,841.55	-20,761,463.55
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		271,723,981.94	-	287,767,734.74	16,043,752.80
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,571,574.27	-	6,302,100.00	-269,474.27
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,571,574.27	-	6,302,100.00	-269,474.27
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		278,295,556.21	-	294,069,834.74	15,774,278.53

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期无其他债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	16,514.83
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	16,514.83

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	168.04	2,150.84
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	141,676.27	1,090,976.87
其中：交易所市场	141,676.27	1,090,976.87
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	40,000.00

合计	291,844.31	1,133,127.71
----	------------	--------------

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

## 金信民长混合 A

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	68,255,126.66	68,255,126.66
本期申购	33,782,004.58	33,782,004.58
本期赎回（以“-”号填列）	-54,325,289.31	-54,325,289.31
本期末	47,711,841.93	47,711,841.93

## 金信民长混合 C

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,045,774.52	91,045,774.52
本期申购	61,959,304.81	61,959,304.81
本期赎回（以“-”号填列）	-101,384,132.82	-101,384,132.82
本期末	51,620,946.51	51,620,946.51

## 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期无其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 金信民长混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	22,892,849.83	54,256,926.67	77,149,776.50
本期利润	-6,778,073.26	-16,958,697.78	-23,736,771.04
本期基金份额交易产生的变动数	-3,537,359.15	-14,407,010.42	-17,944,369.57
其中：基金申购款	6,098,895.46	23,630,585.46	29,729,480.92
基金赎回款	-9,636,254.61	-38,037,595.88	-47,673,850.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,577,417.42	22,891,218.47	35,468,635.89

## 金信民长混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	24,415,972.27	68,811,067.22	93,227,039.49
本期利润	-11,917,849.41	-19,577,044.30	-31,494,893.71
本期基金份额交易产生的变动数	-2,270,314.10	-25,666,288.47	-27,936,602.57
其中：基金申购款	8,433,490.56	41,039,261.76	49,472,752.32
基金赎回款	-10,703,804.66	-66,705,550.23	-77,409,354.89

本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,227,808.76	23,567,734.45	33,795,543.21

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	176,695.84	192,394.78
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	18,464.03	33,847.32
其他	9,726.67	6,790.26
合计	204,886.54	233,032.36

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-20,586,950.90	18,850,996.13
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-20,586,950.90	18,850,996.13

##### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,341,495,217.05	2,750,221,841.73
减：卖出股票成本总额	1,358,650,712.95	2,731,370,845.60
减：交易费用	3,431,455.00	-



买卖股票差价收入	-20,586,950.90	18,850,996.13
----------	----------------	---------------

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	108,182.08	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,824,419.14	38,372.76
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	2,932,601.22	38,372.76

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	34,978,381.54	138,319,247.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,115,954.45	138,193,122.86
减：应计利息总额	36,422.00	87,751.43
减：交易费用	1,585.95	-
买卖债券差价收入	2,824,419.14	38,372.76

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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。

##### 7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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——买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.18 衍生工具收益

##### 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	814,800.93	403,607.58
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	814,800.93	403,607.58

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-36,535,742.08	15,562,637.71
股票投资	-36,798,182.35	15,832,111.98
债券投资	262,440.27	-269,474.27
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-36,535,742.08	15,562,637.71

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	608,714.78	5,484,536.91
合计	608,714.78	5,484,536.91

#### 7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	30,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
律师费	-	18,000.00
公证费	-	8,000.00
交易费用	-	7,359,231.60

合计	150,000.00	7,425,231.60
----	------------	--------------

#### 7.4.7.24 分部报告

本基金无分部报告。

#### 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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金信基金管理有限公司（“金信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	基金托管人
深圳市卓越创业投资有限责任公司	基金管理人的股东
安徽国元信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳市巨财汇投资有限公司	基金管理人的股东
殷克胜	基金管理人的股东
刘吉云	基金管理人的股东
宋思颖	基金管理人的股东
孔学兵	基金管理人的股东
杨超	基金管理人的股东
汇巨未来投资（深圳）合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,190,753.58	1,957,459.57
其中：支付销售机构的客户维护费	951,037.34	854,144.87

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金管理人按照与基金销售机构签订的基金销售协议约定，依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，客户维护费从基金管理费中列支。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	219,075.41	195,745.99

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金信民长混合 A	金信民长混合 C	合计
金信基金	-	13.42	13.42
中信建投证券股份有限公司	-	349.90	349.90
合计	-	363.32	363.32
获得销售服务费的各关联方	上年度可比期间		
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		

名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金信民长混合 A	金信民长混合 C	合计
金信基金	-	700.38	700.38
中信建投证券股份有限公司	-	206.90	206.90
合计	-	907.28	907.28

注：本基金 A 类基金份额不收销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.1%。其计算公式为：

$$H = E \times \text{该类基金份额的年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金份额销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 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与关联方无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

无。

##### 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

无。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
		金信民长混合 A
基金合同生效日（2020 年 5 月 21 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	金信民长混合 A	金信民长混合 C
基金合同生效日（2020年5月21日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	380,300.16	400,000.00
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	380,300.16	400,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：本基金基金管理人本报告期内未运用固有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

##### 金信民长混合 A

关联方名称	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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（%）
刘吉云	1.00	0.0000	1.00	0.0000
殷克胜	1.00	0.0000	1.00	0.0000
宋思颖	1.00	0.0000	-	-

注：殷克胜、刘吉云、宋思颖投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中信建投证券股份有限公司	5,138,600.64	176,695.84	26,629,895.23	192,394.78

注：本基金托管人为中信建投证券，银行账户开立于交通银行，按同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022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	受限期	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
301095	广立微	2022年7月28日	6个月	新股流通受限	58.00	86.49	180	10,440.00	15,568.20	-
301152	天力锂能	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	183	10,431.00	8,535.12	-
301195	北路智控	2022年7月25日	6个月	新股流通受限	71.17	73.04	145	10,319.65	10,590.80	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	6个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	234	7,108.92	5,908.50	-
301297	富乐德	2022年12月23日	6个月	新股流通受限	8.48	12.99	852	7,224.96	11,067.48	-
301306	西测	2022年	6个月	新股流	43.23	42.29	175	7,565.25	7,400.75	-



	测试	7月19日		通受限							
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	85	20,187.50	15,042.45		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股流通受限	78.80	76.96	94	7,407.20	7,234.24		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	206	9,543.98	10,091.94		-
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	84	8,064.00	6,801.48		-
688073	毕得医药	2022年9月27日	6个月	新股流通受限	88.00	75.40	1,069	94,072.00	80,602.60		-
688184	帕瓦股份	2022年9月9日	6个月	新股流通受限	51.88	33.82	1,789	92,813.32	60,503.98		-
688247	宣泰医药	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	9.37	15.06	7,155	67,042.35	107,754.30		-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2022年12月31日，本基金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

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，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

无。

#### 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

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面

临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险以及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建设全面风险体系，建立了以公司董事会风险控制与审计委员会为核心的、由投资决策委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与审计委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。在公司管理层下设立投资决策委员会和监察稽核部对公司的风险进行的预防和控制；投资决策委员会在总经理的领导下，研究并制定公司基金资产投资战略和投资策略，对基金的总体投资情况提出指导性意见，从而达到分散投资风险，提高基金资产的安全性的目的；监察稽核部在督察长的领导下，独立于公司各业务部门和各分支机构，对各岗位、各部门、各项业务中的风险控制情况实施监督。在业务部门层面，公司各部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的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

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级设置投资最低条件来控制证券发行人的信用风险。信用评估包括公司内部信用评级和外部信用评级。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的评估结果，对单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2021 年

12 月 31 日：4.46%)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券均在证券交易所上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.21%。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过对所持投资品种修正久期等参数的监控进行利率风险管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,138,600.64	-	-	-	-	-	5,138,600.64
结算备付金	439,110.46	-	-	-	-	-	439,110.46
存出保证金	272,684.44	-	-	-	-	-	272,684.44
交易性金融资产	-	-9,318,135.56	-	-	-151,623,705.99	160,941,841.55	
应收申购款	-	-	-	-	-	145,765.93	145,765.93
应收清算款	-	-	-	-	-	2,873,008.24	2,873,008.24
资产总计	5,850,395.54	-9,318,135.56	-	-	-154,642,480.16	169,811,011.26	
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	751,237.52	751,237.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	148,569.21	148,569.21
应付托管费	-	-	-	-	-	14,856.92	14,856.92
应付销售服务	-	-	-	-	-	7,535.76	7,535.76

费							
其他负债	-	-	-	-	-	291,844.31	291,844.31
负债总计	-	-	-	-	-	1,214,043.72	1,214,043.72
利率敏感度缺口	5,850,395.54		-9,318,135.56			-153,428,436.44	168,596,967.54
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	26,629,895.23	-	-	-	-	-	26,629,895.23
结算备付金	3,061,241.70	-	-	-	-	-	3,061,241.70
存出保证金	1,094,418.99	-	-	-	-	-	1,094,418.99
交易性金融资产	6,302,100.00	-	-	-	-	-287,767,734.74	294,069,834.74
应收申购款	-	-	-	-	-	1,255,563.98	1,255,563.98
应收证券清算款	-	-	-	-	-	10,055,168.37	10,055,168.37
其他资产	-	-	-	-	-	16,514.83	16,514.83
资产总计	37,087,655.92	-	-	-	-	-299,094,981.92	336,182,637.84
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,024,322.19	5,024,322.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	300,469.37	300,469.37
应付托管费	-	-	-	-	-	30,046.95	30,046.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	16,916.25	16,916.25
应交税费	-	-	-	-	-	38.20	38.20
其他负债	-	-	-	-	-	1,133,127.71	1,133,127.71
负债总计	-	-	-	-	-	6,504,920.67	6,504,920.67
利率敏感度缺口	37,087,655.92	-	-	-	-	-292,590,061.25	329,677,717.17

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.53%(2021 年 12 月 31 日：1.91%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的0%-95%；本基金每个交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。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，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 2022年12月31日		上年度末 2021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	151,623,705.99	89.93	287,767,734.74	87.29
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	151,623,705.99	89.93	287,767,734.74	87.29

##### 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	

	动	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 沪深 300 指数上升 5%	6,546,179.69	6,979,800.20
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-6,546,179.69	-6,979,800.20

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	151,266,043.87	293,377,402.20
第二层次	9,318,135.56	-
第三层次	357,662.12	692,432.54
合计	160,941,841.55	294,069,834.74

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

无。

## 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

无。

## 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

## 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

## 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	151,623,705.99	89.29
	其中：股票	151,623,705.99	89.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,318,135.56	5.49
	其中：债券	9,318,135.56	5.49
	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	5,577,711.10	3.28
8	其他各项资产	3,291,458.61	1.94
9	合计	169,811,011.26	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	-	-



B	采矿业	-	-
C	制造业	151,269,004.78	89.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	26,770.50	0.02
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,299.88	0.02
J	金融业	82,553.38	0.05
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	214,077.45	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	151,623,705.99	89.93

### 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	002648	卫星化学	575,036	8,913,058.00	5.29
2	300014	亿纬锂能	98,843	8,688,299.70	5.15
3	002960	青鸟消防	298,811	8,363,719.89	4.96
4	002897	意华股份	141,200	8,301,148.00	4.92
5	002837	英维克	247,134	8,232,033.54	4.88
6	688516	奥特维	40,077	8,055,477.00	4.78
7	300693	盛弘股份	145,477	7,896,491.56	4.68
8	603799	华友钴业	140,958	7,841,493.54	4.65
9	688503	C聚和	50,653	7,552,868.83	4.48
10	300631	久吾高科	270,441	7,531,781.85	4.47
11	002009	天奇股份	523,100	7,407,096.00	4.39
12	300432	富临精工	506,239	7,305,028.77	4.33
13	603529	爱玛科技	154,200	7,073,154.00	4.20
14	688339	亿华通	88,255	6,530,870.00	3.87
15	301030	仕净科技	154,481	6,443,402.51	3.82

16	688707	振华新材	142,278	6,395,396.10	3.79
17	002407	多氟多	179,200	5,970,944.00	3.54
18	603688	石英股份	45,300	5,948,796.00	3.53
19	688556	高测股份	79,086	5,933,031.72	3.52
20	301327	华宝新能	30,385	5,719,017.45	3.39
21	688005	容百科技	65,544	4,506,150.00	2.67
22	301297	富乐德	8,514	126,074.10	0.07
23	688247	宣泰医药	7,155	107,754.30	0.06
24	688475	C 萤石	3,968	102,890.24	0.06
25	601136	N 首创	4,739	82,553.38	0.05
26	688073	毕得医药	1,069	80,602.60	0.05
27	301391	卡莱特	840	71,439.48	0.04
28	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.04
29	688147	N 微导	2,727	68,393.16	0.04
30	688496	C 清越	7,160	65,012.80	0.04
31	688184	帕瓦股份	1,789	60,503.98	0.04
32	688410	C 山外山	2,102	53,117.54	0.03
33	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.02
34	301095	广立微	180	15,568.20	0.01
35	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.01
36	001333	光华股份	426	12,332.70	0.01
37	301195	北路智控	145	10,590.80	0.01
38	301338	凯格精机	206	10,091.94	0.01
39	301152	天力锂能	183	8,535.12	0.01
40	301306	西测测试	175	7,400.75	0.00
41	301328	维峰电子	94	7,234.24	0.00
42	301282	金禄电子	234	5,908.50	0.00
43	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
44	301316	慧博云通	359	5,140.88	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	600499	科达制造	41,492,535.60	12.59
2	300390	天华超净	35,362,380.00	10.73
3	300850	新强联	22,581,454.80	6.85
4	603799	华友钴业	21,990,761.60	6.67
5	002460	赣锋锂业	21,503,900.60	6.52
6	300432	富临精工	21,484,492.35	6.52
7	688599	天合光能	16,528,368.54	5.01
8	600487	亨通光电	16,214,242.13	4.92
9	600754	锦江酒店	15,807,131.18	4.79

10	688001	华兴源创	15,106,517.00	4.58
11	300893	松原股份	14,723,960.56	4.47
12	688072	拓荆科技	14,471,985.89	4.39
13	688218	江苏北人	13,825,062.66	4.19
14	002897	意华股份	13,722,753.00	4.16
15	300496	中科创达	13,693,844.00	4.15
16	688339	亿华通	13,465,561.57	4.08
17	603345	安井食品	13,415,775.57	4.07
18	002245	蔚蓝锂芯	12,869,687.45	3.90
19	600196	复星医药	12,595,562.96	3.82
20	002026	山东威达	12,453,815.00	3.78
21	301030	仕净科技	12,378,714.69	3.75
22	688139	海尔生物	11,771,544.01	3.57
23	300373	扬杰科技	11,674,057.52	3.54
24	002648	卫星化学	11,528,318.55	3.50
25	300014	亿纬锂能	11,440,667.00	3.47
26	688819	天能股份	11,321,363.37	3.43
27	002009	天奇股份	11,276,906.00	3.42
28	002015	协鑫能科	11,226,356.00	3.41
29	603077	和邦生物	11,174,475.00	3.39
30	600460	士兰微	11,114,929.00	3.37
31	300856	科思股份	11,072,514.00	3.36
32	002837	英维克	10,816,502.49	3.28
33	600522	中天科技	10,806,440.39	3.28
34	300835	龙磁科技	10,766,463.60	3.27
35	300438	鹏辉能源	10,726,024.16	3.25
36	002960	青鸟消防	10,610,892.04	3.22
37	600547	山东黄金	10,405,332.80	3.16
38	688516	奥特维	10,387,634.52	3.15
39	002241	歌尔股份	10,362,617.98	3.14
40	002170	芭田股份	10,285,325.00	3.12
41	688777	中控技术	10,230,947.61	3.10
42	300057	万顺新材	10,187,187.81	3.09
43	300031	宝通科技	10,079,668.00	3.06
44	600438	通威股份	10,055,619.00	3.05
45	300682	朗新科技	10,027,899.00	3.04
46	688046	药康生物	9,950,162.66	3.02
47	688390	固德威	9,908,925.39	3.01
48	600258	首旅酒店	9,846,185.85	2.99
49	688356	键凯科技	9,757,852.63	2.96
50	300896	爱美客	9,510,920.52	2.88
51	300260	新莱应材	9,441,778.00	2.86
52	300604	长川科技	9,391,422.70	2.85

53	300693	盛弘股份	9,321,678.50	2.83
54	688298	东方生物	9,124,305.33	2.77
55	300035	中科电气	9,081,773.00	2.75
56	603019	中科曙光	8,980,507.00	2.72
57	600489	中金黄金	8,855,791.00	2.69
58	603529	爱玛科技	8,800,932.00	2.67
59	300631	久吾高科	8,659,548.00	2.63
60	688408	中信博	8,556,901.07	2.60
61	688180	君实生物	8,434,477.50	2.56
62	002371	北方华创	8,316,682.00	2.52
63	688083	中望软件	8,274,349.30	2.51
64	300037	新宙邦	8,080,754.40	2.45
65	605111	新洁能	8,041,808.20	2.44
66	002987	京北方	8,015,402.00	2.43
67	300083	创世纪	8,007,336.00	2.43
68	600406	国电南瑞	8,003,311.00	2.43
69	688707	振华新材	7,944,206.98	2.41
70	300957	贝泰妮	7,943,092.00	2.41
71	605358	立昂微	7,921,561.62	2.40
72	688518	联赢激光	7,899,050.76	2.40
73	000651	格力电器	7,892,875.00	2.39
74	000811	冰轮环境	7,879,871.00	2.39
75	000400	许继电气	7,868,514.00	2.39
76	300652	雷迪克	7,832,911.38	2.38
77	600079	人福医药	7,790,180.00	2.36
78	300331	苏大维格	7,621,662.00	2.31
79	002497	雅化集团	7,551,049.00	2.29
80	301163	宏德股份	7,366,303.00	2.23
81	688597	煜邦电力	7,155,433.25	2.17
82	688503	C聚和	7,056,023.06	2.14
83	301327	华宝新能	6,985,064.65	2.12
84	688536	思瑞浦	6,928,550.55	2.10
85	002812	恩捷股份	6,880,228.00	2.09
86	688375	国博电子	6,818,286.69	2.07
87	300015	爱尔眼科	6,804,093.64	2.06
88	300969	恒帅股份	6,780,024.00	2.06
89	688322	奥比中光	6,706,946.85	2.03
90	603067	振华股份	6,688,416.14	2.03

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	600499	科达制造	40,198,053.34	12.19
2	300260	新莱应材	37,302,997.24	11.31
3	600522	中天科技	36,312,160.75	11.01
4	300390	天华超净	33,293,429.20	10.10
5	300850	新强联	32,707,689.50	9.92
6	688599	天合光能	32,651,938.36	9.90
7	002466	天齐锂业	32,045,745.31	9.72
8	002487	大金重工	23,915,180.96	7.25
9	688218	江苏北人	22,720,675.40	6.89
10	300896	爱美客	21,118,330.60	6.41
11	688072	拓荆科技	20,623,820.21	6.26
12	002531	天顺风能	20,540,593.80	6.23
13	002460	赣锋锂业	20,286,620.37	6.15
14	600487	亨通光电	19,327,050.91	5.86
15	601615	明阳智能	18,853,704.44	5.72
16	002371	北方华创	17,670,935.80	5.36
17	300893	松原股份	16,222,642.24	4.92
18	600754	锦江酒店	15,230,550.56	4.62
19	688001	华兴源创	13,750,858.37	4.17
20	688598	金博股份	13,352,963.69	4.05
21	300496	中科创达	13,105,218.00	3.98
22	688390	固德威	12,405,912.56	3.76
23	600196	复星医药	12,278,466.20	3.72
24	300432	富临精工	12,179,572.95	3.69
25	600438	通威股份	12,159,316.05	3.69
26	603799	华友钴业	12,136,391.86	3.68
27	603345	安井食品	12,123,498.00	3.68
28	688777	中控技术	11,669,011.08	3.54
29	600150	中国船舶	11,383,822.12	3.45
30	603077	和邦生物	11,111,601.68	3.37
31	688139	海尔生物	11,076,531.95	3.36
32	002245	蔚蓝锂芯	10,975,010.05	3.33
33	300373	扬杰科技	10,973,475.62	3.33
34	688819	天能股份	10,958,402.41	3.32
35	300057	万顺新材	10,795,423.85	3.27
36	688046	药康生物	10,736,005.49	3.26
37	600460	士兰微	10,734,957.05	3.26
38	002241	歌尔股份	10,723,107.14	3.25
39	002006	精功科技	10,592,534.00	3.21
40	300203	聚光科技	10,561,008.00	3.20
41	300604	长川科技	10,297,916.32	3.12
42	002026	山东威达	10,069,089.00	3.05

43	002170	芭田股份	10,008,201.00	3.04
44	300438	鹏辉能源	9,961,025.42	3.02
45	002015	协鑫能科	9,847,023.60	2.99
46	688356	键凯科技	9,748,563.16	2.96
47	300856	科思股份	9,679,461.24	2.94
48	300835	龙磁科技	9,617,061.80	2.92
49	300990	同飞股份	9,531,380.16	2.89
50	600547	山东黄金	9,437,364.40	2.86
51	300957	贝泰妮	9,247,248.00	2.80
52	300969	恒帅股份	9,093,011.08	2.76
53	688518	联赢激光	8,961,822.86	2.72
54	688298	东方生物	8,885,073.84	2.70
55	688221	前沿生物	8,828,140.32	2.68
56	600258	首旅酒店	8,776,691.93	2.66
57	605111	新洁能	8,532,386.36	2.59
58	002987	京北方	8,531,066.40	2.59
59	603019	中科曙光	8,514,862.88	2.58
60	300031	宝通科技	8,511,467.00	2.58
61	300682	朗新科技	8,475,088.00	2.57
62	300035	中科电气	8,462,063.72	2.57
63	688408	中信博	8,221,614.46	2.49
64	688597	煜邦电力	8,166,352.31	2.48
65	300037	新宙邦	8,039,098.03	2.44
66	600489	中金黄金	7,935,135.43	2.41
67	688256	寒武纪	7,888,680.28	2.39
68	002812	恩捷股份	7,853,445.00	2.38
69	600079	人福医药	7,735,586.27	2.35
70	000651	格力电器	7,725,633.00	2.34
71	688180	君实生物	7,707,587.79	2.34
72	600406	国电南瑞	7,628,100.00	2.31
73	600976	健民集团	7,580,216.00	2.30
74	605358	立昂微	7,577,235.00	2.30
75	688711	宏微科技	7,499,128.97	2.27
76	300083	创世纪	7,496,426.01	2.27
77	000400	许继电气	7,434,156.00	2.25
78	300652	雷迪克	7,268,031.20	2.20
79	000811	冰轮环境	7,246,471.86	2.20
80	002497	雅化集团	7,040,443.00	2.14
81	688499	利元亨	6,864,042.98	2.08
82	002139	拓邦股份	6,814,170.00	2.07
83	301122	采纳股份	6,796,798.41	2.06
84	301163	宏德股份	6,790,096.84	2.06
85	300015	爱尔眼科	6,754,788.00	2.05

86	300274	阳光电源	6,729,999.21	2.04
87	688536	思瑞浦	6,704,250.00	2.03
88	688768	容知日新	6,674,730.20	2.02
89	301030	仕净科技	6,651,998.95	2.02

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,259,304,866.55
卖出股票收入（成交）总额	1,341,495,217.05

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（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	9,318,135.56	5.53
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,318,135.56	5.53

#### 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	019674	22 国债 09	92,000	9,318,135.56	5.53

注：本基金本报告期末仅持有以上债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将以投资组合的避险保值和有效管理为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货的投资。利用股指期货流动性好，交易成本低等特点，在市场向下带动净值走低时，通过股指期货快速降低投资组合的仓位，从而调整投资组合的风险暴露，避免市场的系统性风险，改善组合的风险收益特性；并在市场快速向上基金难以及时提高仓位时，通过股指期货快速提高投资组合的仓位，从而提高基金资产收益。

## 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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除卫星化学外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

卫星化学股份有限公司于 2022 年 4 月 15 日因未及时披露公司重大事项，受到中国证券监督管理委员会浙江监管局出具警示函处罚。之后本基金管理人对卫星化学进行了充分研究，认为卫星化学受到的处罚虽反映出卫星化学存在一定管理问题，但对其整体的业务开展以及持续经营无重大不利影响，对卫星化学资金周转和债务偿还影响较小，本基金管理人履行了必要的投资决策程序后买入并持有卫星化学发行的证券。

本基金投资上述证券的程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。



## 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	272,684.44
2	应收清算款	2,873,008.24
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	145,765.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,291,458.61

## 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

## 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
金信民长混合 A	12,727	3,748.87	167,321.60	0.3507	47,544,520.33	99.6493
金信民长混合 C	15,470	3,336.84	0.00	0.00	51,620,946.51	100.0000
合计	27,396	3,625.81	167,321.60	0.1684	99,165,466.84	99.8316

注：1、分类基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分类基金，比例的分母采用各自类别的份额；对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额；

2、户均持有的基金份额合计=期末基金份额总额/期末持有人户数总计。

## 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	金信民长混合 A	319.74	0.0007
	金信民长混合 C	60.74	0.0001
	合计	380.48	0.0004

注：分类基金管理人的从业人员持有基金占总份额比例的计算中，对下属分类基金，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	金信民长混合 A	0~10
	金信民长混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金信民长混合 A	0~10
	金信民长混合 C	0
	合计	0~10

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

本报告期内本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况，本项不适用。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金信民长混合 A	金信民长混合 C
基金合同生效日 (2020年5月21日) 基金份额总额	115,869,812.55	84,801,301.00
本报告期期初基金份额总额	68,255,126.66	91,045,774.52
本报告期基金总申购份额	33,782,004.58	61,959,304.81
减：本报告期基金总赎回份额	54,325,289.31	101,384,132.82
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,711,841.93	51,620,946.51

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门没有发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期为本基金提供审计服务的会计师事务所变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币 30,000 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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 (%)	
中金公司	1	1,101,935,591.27	42.43	793,746.95	42.52	-
海通证券	1	997,467,752.44	38.41	716,234.75	38.37	-
安信证券	1	227,056,253.33	8.74	161,504.73	8.65	-
中金财富	1	189,833,085.	7.31	136,924.98	7.34	-

证券		77				
长江证券	1	80,696,425.47	3.11	58,205.28	3.12	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程

公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评价，并根据评价的结果按制度经相关部门及公司领导审核后选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

### 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(%)
中金公司	38,896,774.22	55.77	-	-	-	-
海通证券	30,851,171.40	44.23	79,500,000.00	97.19	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

长江证 券	-	-	2,300,000.00	2.81	-	-
东兴证 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	金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第四季度报告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 1 月 21 日
2	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 1 月 21 日
3	金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 3 月 30 日
4	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 3 月 30 日
5	金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第一季度报告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 4 月 22 日
6	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 4 月 22 日
7	金信基金关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 4 月 28 日
8	金信民长灵活配置混合型基金招募说明书（更新）（2022 年第 1 次更新）	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 6 月 10 日
9	金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 6 月 10 日
10	金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 6 月 10 日
11	金信基金关于旗下部分基金增加泰信财富为代销机构并开通定期定额投资业务、参加其费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 7 月 1 日
12	金信基金管理有限公司关于暂停喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 7 月 9 日
13	金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第二季度报告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 7 月 20 日
14	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 7 月 20 日
15	金信基金关于旗下部分基金参加申万	中国证监会基金电子披	2022 年 8 月 9 日

	宏源证券、申万宏源西部证券费率优惠活动并开通定期定额投资业务公告	露网站及本公司网站	
16	金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 8 月 18 日
17	金信民长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2022 年第 2 次更新）	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 19 日
18	金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 19 日
19	金信基金关于旗下部分基金增加江海证券为代销机构并开通定期定额投资业务、参加其费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 26 日
20	金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 8 月 27 日
21	金信民长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 30 日
22	金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 30 日
23	金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 30 日
24	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 8 月 30 日
25	金信基金关于旗下部分基金增加东海证券为代销机构并开通定期定额投资业务、参加其费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 8 月 31 日
26	金信基金关于旗下部分基金增加招商证券为代销机构并开通定期定额投资业务、参加其费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 9 月 20 日
27	金信民长灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第三季度报告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 10 月 26 日
28	金信基金管理有限公司旗下 15 只基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 10 月 26 日
29	金信基金管理有限公司旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会基金电子披露网站、规定报刊及本公司网站	2022 年 11 月 25 日
30	金信基金关于旗下基金增加众禄基金为代销机构并开通定期定额投资业务、参加其费率优惠的公告	中国证监会基金电子披露网站及本公司网站	2022 年 12 月 20 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额未有达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金信民长灵活配置混合型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《金信民长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《金信民长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及营业执照。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区益田路 6001 号太平金融大厦 1502

深圳市前海深港合作区兴海大道 3040 号前海世茂大厦 2603

### 13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- (2) 投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：[www.jxfunds.com.cn](http://www.jxfunds.com.cn)。

金信基金管理有限公司

2023 年 3 月 30 日