

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证 券投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：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。

基金托管人招商银行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。

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

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.10 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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64

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	66
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 本基金投资股指期货的投资政策	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 市场中性策略执行情况	67
8.13 投资组合报告附注	67
§ 9 基金份额持有人信息	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	69
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
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	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
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	73
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金	
基金简称	安信阿尔法定开混合	
基金主代码	005280	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 6 日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	43,591,557.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
下属分级基金的交易代码	005280	009624
报告期末下属分级基金的份额总额	34,980,571.51 份	8,610,985.55 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	安信基金管理有限责任公司	招商银行股份有限公司

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据 和指 标	2022 年		2021 年		2020 年		2020 年 6 月 12 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	
本期已实现收益	-604,191.97	-495,412.89	13,682,371.43	5,752,749.14	20,109,573.76	7,184,779.62	
本期利润	-3,681,324.41	-1,097,086.20	5,681,360.69	2,807,527.72	25,299,981.55	11,776,652.46	
加权	-0.0492	-0.0543	0.0201	0.0149	0.1559	0.0909	

平均基金份额本期利润						
本期加权平均净值利润率	-4.10%	-4.58%	1.65%	1.24%	13.74%	7.82%
本期基金份额净值增长率	-3.52%	-4.10%	2.10%	1.52%	15.40%	8.48%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
期末可供分配利润	5,763,902.28	1,266,321.78	26,011,410.21	6,455,466.78	29,874,650.37	28,775,718.63
期末可供分配基金份额利润	0.1648	0.1471	0.1774	0.1667	0.1456	0.1421
期末基金资产净值	41,142,113.43	9,979,110.58	178,785,701.51	46,789,710.02	244,920,630.16	241,050,794.41
期末基金份额净值	1.1761	1.1589	1.2190	1.2085	1.1939	1.1904
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
基金	17.61%	5.61%	21.90%	10.13%	19.39%	8.48%

份额 累计 净值 增长 率						
---------------------------	--	--	--	--	--	--

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

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信阿尔法定开混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.33%	0.21%	0.38%	0.01%	-1.71%	0.20%
过去六个月	-1.95%	0.19%	0.76%	0.00%	-2.71%	0.19%
过去一年	-3.52%	0.20%	1.50%	0.00%	-5.02%	0.20%
过去三年	13.68%	0.24%	4.50%	0.00%	9.18%	0.24%
过去五年	17.45%	0.21%	7.50%	0.00%	9.95%	0.21%
自基金合同生效 起至今	17.61%	0.21%	7.61%	0.00%	10.00%	0.21%

安信阿尔法定开混合 C

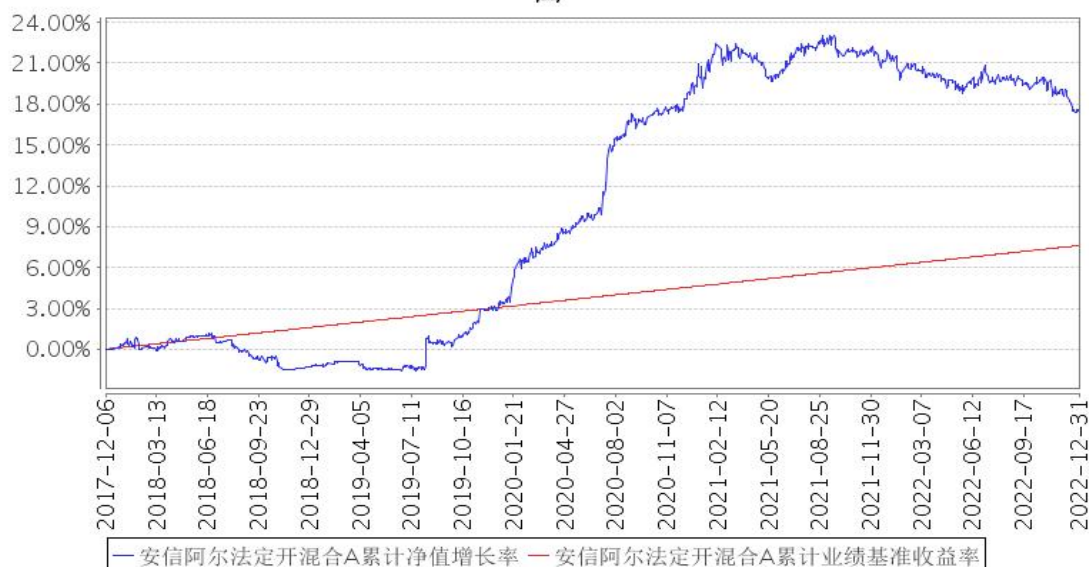
阶段	份额净值 增长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④

过去三个月	-1.48%	0.21%	0.38%	0.01%	-1.86%	0.20%
过去六个月	-2.24%	0.19%	0.76%	0.00%	-3.00%	0.19%
过去一年	-4.10%	0.20%	1.50%	0.00%	-5.60%	0.20%
自基金合同生效起至今	5.61%	0.24%	3.83%	0.00%	1.78%	0.24%

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

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

安信阿尔法定开混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



安信阿尔法定开混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



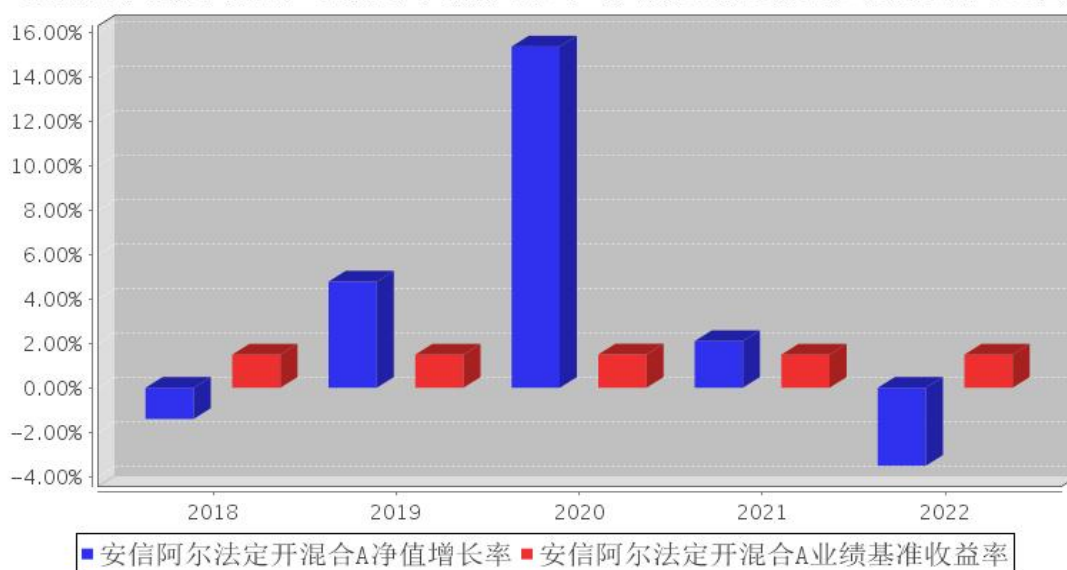
注：1、本基金合同生效日为 2017 年 12 月 06 日。

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

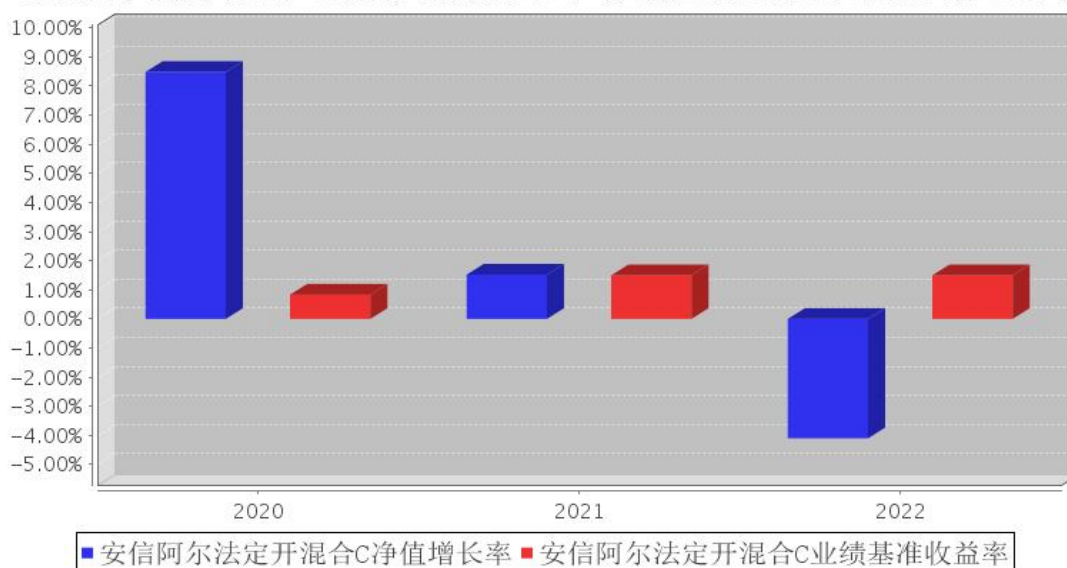
3、根据基金管理人 2020 年 5 月 28 日《关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金新增 C 类基金份额并修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，自 2020 年 6 月 12 日起，本基金增加 C 类份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信阿尔法定开混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



安信阿尔法定开混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 83 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信企业价值优选混合型证券投资基金（原安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金）、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型

证券投资基金)、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金 (LOF)、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金 (LOF)、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金 (LOF)、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信丰穗一年持有期混合型证券投资基金、安信楚盈一年持有期混合型证券投资基金、安信远见成长混合型证券投资基金、安信港股通精选混合型发起式证券投资基金、安信恒鑫增强债券型证券投资基金、安信新能源主题股票型发起式证券投资基金、安信华享纯债债券型证券投资基金、安信臻享三个月定期开放债券型证券投资基金、安信洞见成长混合型证券投资基金、安信稳健启航一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐 黄 玮	本基金的基金经理, 量化投资部总经理	2017 年 12 月 29 日	-	15 年	徐黄玮先生, 理学硕士。历任广发证券股份有限公司任衍生产品部研究岗、资产管理部量化研究岗、权益及衍生品投资部量化投资岗。现任安信基金管理有限责任公司量化投资部总经理。曾任安信新起点灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理, 安信量化多因子灵活配置混合型证券

					投资基金的基金经理；现任安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。本报告期内，本公司所

有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易不存在成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

2022 年，外部美国加息，流动性紧缩，“俄乌冲突”导致地缘政治风险加大，各国股市都出现大幅下跌，国内外投资者风险偏好大幅降低。国内则受疫情反复影响较大，多座城市经历严格的封控管制，同时房企融资渠道受限，多个项目经历“烂尾”，对购房者信心打击较大。基于内外的情况，A 股全年呈下跌趋势。部分行业表现较好，如高景气的汽车行业、受益于通胀的煤炭行业等。基于这样的情况，全年整体呈现出偏价值股的行情，而在大小盘方面，则整体呈现小盘行情。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信阿尔法定开混合 A 基金份额净值为 1.1761 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.52%；安信阿尔法定开混合 C 基金份额净值为 1.1589 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.10%；同期业绩比较基准收益率为 1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

至 2022 年末时，对 2022 年影响较大的多个因素都发生转变，美国加息预计在 2023 年初结束，房企的融资问题也已经化解，而疫情防控政策也做了很大的优化。因此影响 2023 年股市走势的主要矛盾都会有所变化。展望未来，促进经济恢复和发展将是 2023 年的政策发力点。鉴于欧美经济处在相对衰退的状态，出口层面表现不会太亮眼。而国内的消费和投资将是重要的增长引擎。受疫情压制及地产链上的行业将会边际恢复。鉴于目前权益资产的估值都处于历史较低位置，同时国内流动性也比较充裕，那些在 2023 年业绩增长较好的行业和板块将值得重点关注和跟踪。超预期的股票预计会有较好表现。在风格上，则预计成长风格相对占优。我们一直重视的公司的盈利、成长性、企业质量、估值、分析师预期，个股事件驱动等指数增强方式将会有较好的投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、

梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 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，后附的安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金管理层对其他信

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

	我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	邓 雯
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2023 年 03 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,785,739.28	7,403,277.23
结算备付金		3,247,696.40	10,390,693.69
存出保证金		2,892,365.00	18,507,356.06
交易性金融资产	7.4.7.2	28,822,618.74	184,457,076.95
其中：股票投资		25,986,445.12	163,425,732.06
基金投资		-	-
债券投资		2,836,173.62	21,031,344.89
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	14,874,084.01	10,000,000.00
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		576,040.53	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	266,429.18
资产总计		52,198,543.96	231,024,833.11
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		723,227.09	3,586,460.73
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		44,179.45	295,111.81
应付托管费		11,044.85	73,777.96
应付销售服务费		4,642.00	55,381.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		35.91	20.82
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	294,190.65	1,438,669.22
负债合计		1,077,319.95	5,449,421.58
净 资 产：			
实收基金	7.4.7.7	43,591,557.06	185,379,494.39
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	7,529,666.95	40,195,917.14
净资产合计		51,121,224.01	225,575,411.53
负债和净资产总计		52,198,543.96	231,024,833.11

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 43,591,557.06 份，其中安信阿尔法定开混合 A 基金份额总额为 34,980,571.51 份，基金份额净值 1.1761 元；安信阿尔法定开混合 C 基金份额总额为 8,610,985.55 份，基金份额净值 1.1589 元。

2、以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：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	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
一、营业总收入		-2,977,402.67	29,823,509.64

1. 利息收入		619,990.07	5,392,210.65
其中：存款利息收入	7.4.7.9	263,538.44	503,464.23
债券利息收入		-	3,194,118.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		356,451.63	1,694,627.44
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-29,020.21	34,957,754.46
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-23,536,433.21	65,398,310.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	534,826.69	361,788.50
资产支持证券投资	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	22,314,954.09	-35,155,124.27
股利收益	7.4.7.15	657,632.22	4,352,779.99
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）	7.4.7.16	-3,678,805.75	-10,946,232.16
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	110,433.22	419,776.69
减：二、营业总支出		1,801,007.94	21,334,621.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,161,715.28	7,241,628.20
2. 托管费	7.4.10.2.2	290,428.85	1,423,297.24
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	147,208.22	1,363,537.67
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		250.47	296,140.02
其中：卖出回购金融资产支出		250.47	296,140.02
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		85,099.64	6.05
8. 其他费用	7.4.7.19	116,305.48	11,010,012.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,778,410.61	8,488,888.41
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,778,410.61	8,488,888.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,778,410.61	8,488,888.41

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：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）	185,379,494.39	-	40,195,917.14	225,575,411.53
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）	185,379,494.39	-	40,195,917.14	225,575,411.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-141,787,937.33	-	-32,666,250.19	-174,454,187.52
（一）、综合收益总额	-	-	-4,778,410.61	-4,778,410.61
（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）	-141,787,937.33	-	-27,887,839.58	-169,675,776.91
其中：1. 基金申购款	3,806,091.31	-	653,640.09	4,459,731.40
2. 基金赎回款	-145,594,028.64	-	-28,541,479.67	-174,135,508.31
（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)	43,591,557.06	-	7,529,666.95	51,121,224.01
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)	407,641,712.67	-	78,329,711.90	485,971,424.57
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)	407,641,712.67	-	78,329,711.90	485,971,424.57
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-222,262,218.28	-	-38,133,794.76	-260,396,013.04
(一)、综合收益总额	-	-	8,488,888.41	8,488,888.41
(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)	-222,262,218.28	-	-46,622,683.17	-268,884,901.45
其中: 1. 基金申购款	304,437,183.08	-	65,150,132.94	369,587,316.02
2. 基金赎回款	-526,699,401.36	-	-111,772,816.11	-638,472,217.47
(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	185,379,494.39	-	40,195,917.14	225,575,411.53

产（基金净值）				
---------	--	--	--	--

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：

<u>刘入领</u>	<u>廖维坤</u>	<u>苗杨</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2015 年 11 月 20 日下发的中国证监会证监许可[2015]2684 号文“关于准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，以定期开放方式运行，存续期限不定。本基金募集期间为 2017 年 11 月 1 日至 2017 年 11 月 30 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2017）验字 60962175_H11 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,298,649.48 份，其中认购资金利息折合 143.77 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：股票（包含中小板、创业板及其他经

中国证监会核准上市的股票、存托凭证），股指期货、权证，债券（国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%-120% 之间。其中：权益类空头头寸的价值是指卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

本基金的业绩比较基准为：一年期银行定期存款利率（税后）。

本财务报表已于 2023 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评

估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列

示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入企业；3）股利的金额能够可靠计量。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计

入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为该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。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净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金本报告期无分部报告。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发〈资产管理产品相关会计处理规定〉的通知》（财会〔2022〕14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映

在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币7,403,277.23元，自应收利息转入的重分类金额为人民币818.12元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币7,404,095.35元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币10,390,693.69元，自应收利息转入的重分类金额为人民币6,327.75元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币10,397,021.44元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币18,507,356.06元，自应收利息转入的重分类金额为人民币177.76元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币18,507,533.82元。

应收利息于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币266,429.18元，转出至银行存款的重分类金额为人民币818.12元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币6,327.75元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币177.76元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币259,105.55元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币0.00元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币0.00元，转出至其他资产的重分类金额为人民币0.00元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币

184,457,076.95 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 259,105.55 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 184,716,182.50 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

（4）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等

收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,785,739.28	7,403,277.23
等于：本金	1,785,110.07	7,403,277.23
加：应计利息	629.21	-
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	1,785,739.28	7,403,277.23

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		26,151,323.64	-	25,986,445.12	-164,878.52
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,866,336.83	13,166.43	2,836,173.62	-43,329.64
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,866,336.83	13,166.43	2,836,173.62	-43,329.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		29,017,660.47	13,166.43	28,822,618.74	-208,208.16
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		160,892,148.05	-	163,425,732.06	2,533,584.01
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	21,043,927.75	-	21,031,344.89	-12,582.86
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	21,043,927.75	-	21,031,344.89	-12,582.86
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		181,936,075.80	-	184,457,076.95	2,521,001.15

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-22,400,209.52	-	-	-
其	-22,400,209.52	-	-	-

中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-22,400,209.52	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-141,734,305.96	-	-	-
其中：股指期货投资	-141,734,305.96	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-141,734,305.96	-	-	-

注：衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为期末的合约价值。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2301	IC2301	-3.00	-3,524,760.00	162,906.67
IC2303	IC2303	-5.00	-5,874,400.00	136,640.00
IF2303	IF2303	-9.00	-10,541,340.00	-186,017.15
IF2306	IF2306	-2.00	-2,337,120.00	9,060.00
合计				122,589.52
减：可抵销期货暂收款				122,589.52
净额				-

注：（1）衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵消后的净额为0。

（2）买入持仓以正数表示，卖出持仓以负数表示。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	14,874,084.01	-
银行间市场	-	-
合计	14,874,084.01	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	10,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 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	-	266,429.18
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	266,429.18

注：“应收利息”上年度末所列示的金额为上年度末资产负债表中“应收利息”项目的“本期末”余额。

7.4.7.6 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	189,690.65	1,268,669.22
其中：交易所市场	189,515.65	1,268,669.22
银行间市场	175.00	-
应付利息	-	-
应付信息披露费	80,000.00	120,000.00
应付审计费	20,000.00	50,000.00
应付银行间账户维护费	4,500.00	-
合计	294,190.65	1,438,669.22

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	本期 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	146,662,333.05	146,662,333.05
本期申购	40,034.40	40,034.40
本期赎回（以“-”号填列）	-111,721,795.94	-111,721,795.94
本期末	34,980,571.51	34,980,571.51

安信阿尔法定开混合 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	38,717,161.34	38,717,161.34
本期申购	3,766,056.91	3,766,056.91
本期赎回（以“-”号填列）	-33,872,232.70	-33,872,232.70
本期末	8,610,985.55	8,610,985.55

注：赎回份额含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

安信阿尔法定开混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	26,011,410.21	6,111,958.25	32,123,368.46
本期利润	-604,191.97	-3,077,132.44	-3,681,324.41
本期基金份额交易产生的变动数	-19,643,315.96	-2,637,186.17	-22,280,502.13
其中：基金申购款	7,029.10	873.91	7,903.01
基金赎回款	-19,650,345.06	-2,638,060.08	-22,288,405.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,763,902.28	397,639.64	6,161,541.92

安信阿尔法定开混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,455,466.78	1,617,081.90	8,072,548.68
本期利润	-495,412.89	-601,673.31	-1,097,086.20
本期基金份额交易产生的变动数	-4,693,732.11	-913,605.34	-5,607,337.45
其中：基金申购款	585,455.78	60,281.30	645,737.08
基金赎回款	-5,279,187.89	-973,886.64	-6,253,074.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,266,321.78	101,803.25	1,368,125.03

7.4.7.9 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	21,381.41	87,301.58
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	239,502.24	410,861.93
其他	2,654.79	5,300.72
合计	263,538.44	503,464.23

7.4.7.10 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	1,103,978,194.01	4,770,087,903.72
减：卖出股票成本总额	1,124,790,845.40	4,704,689,593.48
减：交易费用	2,723,781.82	-
买卖股票差价收入	-23,536,433.21	65,398,310.24

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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	477,122.29	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	57,704.40	361,788.50
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	534,826.69	361,788.50

7.4.7.11.2 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
----	-----------------------------	----------------------------------

	日	日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	84,102,069.12	256,112,388.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	83,462,378.02	252,539,115.72
减：应计利息总额	578,158.00	3,211,483.90
减：交易费用	3,828.70	-
买卖债券差价收入	57,704.40	361,788.50

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	22,314,954.09	-35,155,124.27

7.4.7.15 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	657,632.22	4,352,779.99
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	657,632.22	4,352,779.99

7.4.7.16 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	-2,729,209.31	-35,828,156.43
股票投资	-2,698,462.53	-35,971,256.68
债券投资	-30,746.78	143,100.25
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-

贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-949,596.44	24,881,924.27
权证投资	-	-
股指期货	-949,596.44	24,881,924.27
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	-3,678,805.75	-10,946,232.16

7.4.7.17 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	104,574.46	412,914.26
基金转换费收入	5,858.76	6,862.43
合计	110,433.22	419,776.69

7.4.7.18 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。

7.4.7.19 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	20,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	4,305.48	5,723.50
银行间账户维护费	12,000.00	-
交易费用	-	10,834,288.55
合计	116,305.48	11,010,012.05

7.4.7.20 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
安信证券	147,471,336.32	7.06	4,297,243,244.89	46.28

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
安信证券	45,907.23	3.20	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）

安信证券	1,337,738.48	27.38	172,747.55	13.62
------	--------------	-------	------------	-------

注：（1）上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示。

（2）该类席位租用协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	1,161,715.28	7,241,628.20
其中：支付销售机构的客户维护费	297,794.85	1,537,253.05

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

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2）基金管理人可在满足合同约定的条件时提取附加管理费。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的托管费	290,428.85	1,423,297.24

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 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		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	65,757.37	65,757.37
安信证券	-	784.95	784.95
合计	-	66,542.32	66,542.32
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C	合计
安信基金	-	301,037.54	301,037.54
安信证券	-	666.62	666.62
合计	-	301,704.16	301,704.16

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

$$H = E \times 0.60\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日(2017 年 12 月 6 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	10,000,000.00	-
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	-	-
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
	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日(2017 年 12 月 6 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	5.39%	-

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

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

安信阿尔法定开混合 C

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 (%)
安信乾盛 财富管理 (深圳)有 限公司	1,694,053.87	3.89	-	-

注：本基金其他关联方投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

7.4.10.6 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
招商银行	1,785,739.28	21,381.41	7,403,277.23	87,301.58

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注
113664	大元转 债	2022年 12月5 日	1个月 内(含)	配债未上 市	100.00	100.02	50	4,999.96	5,001.14	-
118030	睿创转 债	2022年 12月30 日	1-6个 月(含)	配债未上 市	100.00	100.00	50	4,999.97	5,000.04	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止, 本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额, 无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 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余额, 无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 2.98%（2021 年 12 月 31 日：0.11%）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	11,303,390.00
合计	-	11,303,390.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	394,888.10	247,997.19
AAA 以下	1,127,142.23	-
未评级	1,314,143.29	9,479,957.70
合计	2,836,173.62	9,727,954.89

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风

险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人要求赎回的基金资产超出基金持有的现金类资产规模，另一方面来自于基金持有的投资品种交易不活跃而带来的变现困难或不能以合理的价格变现。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价

值)等量化风险指标评估基金的利率风险,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2022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	1,785,739.28	-	-	-	1,785,739.28
结算备付金	3,247,696.40	-	-	-	3,247,696.40
存出保证金	2,892,365.00	-	-	-	2,892,365.00
交易性金融资产	1,314,143.29	1,216,128.05	305,902.28	25,986,445.12	28,822,618.74
买入返售金融资产	14,874,084.01	-	-	-	14,874,084.01
应收清算款	-	-	-	576,040.53	576,040.53
资产总计	24,114,027.98	1,216,128.05	305,902.28	26,562,485.65	52,198,543.96
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	44,179.45	44,179.45
应付托管费	-	-	-	11,044.85	11,044.85
应付清算款	-	-	-	723,227.09	723,227.09
应付销售服务费	-	-	-	4,642.00	4,642.00
应交税费	-	-	-	35.91	35.91
其他负债	-	-	-	294,190.65	294,190.65
负债总计	-	-	-	1,077,319.95	1,077,319.95
利率敏感度缺口	24,114,027.98	1,216,128.05	305,902.28	25,485,165.70	51,121,224.01
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,403,277.23	-	-	-	7,403,277.23
结算备付金	10,390,693.69	-	-	-	10,390,693.69
存出保证金	18,507,356.06	-	-	-	18,507,356.06
交易性金融资产	11,643,847.70	9,139,500.00	247,997.19	163,425,732.06	184,457,076.95
买入返售金融资产	10,000,000.00	-	-	-	10,000,000.00
其他资产	-	-	-	266,429.18	266,429.18
资产总计	57,945,174.68	9,139,500.00	247,997.19	163,692,161.24	231,024,833.11
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	295,111.81	295,111.81
应付托管费	-	-	-	73,777.96	73,777.96
应付证券清算款	-	-	-	3,586,460.73	3,586,460.73
应付销售服务费	-	-	-	55,381.04	55,381.04
应交税费	-	-	-	20.82	20.82
其他负债	-	-	-	1,438,669.22	1,438,669.22
负债总计	-	-	-	5,449,421.58	5,449,421.58
利率敏感度缺口	57,945,174.68	9,139,500.00	247,997.19	158,242,739.66	225,575,411.53

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	16,504.75	41,608.35
	2. 市场利率上升 25 个基点	-16,297.40	-41,406.87

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	25,986,445.12	50.83	163,425,732.06	72.45
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	25,986,445.12	50.83	163,425,732.06	72.45

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（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%	1,193,134.23	7,850,553.22
	2. 沪深 300 指数下降 5%	-1,193,134.23	-7,850,553.22

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	27,498,474.27	160,444,394.73
第二层次	1,324,144.47	24,012,682.22
第三层次	-	-
合计	28,822,618.74	184,457,076.95

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无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	25,986,445.12	49.78
	其中：股票	25,986,445.12	49.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,836,173.62	5.43
	其中：债券	2,836,173.62	5.43
	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	14,874,084.01	28.50
	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	5,033,435.68	9.64
8	其他各项资产	3,468,405.53	6.64
9	合计	52,198,543.96	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	148,460.00	0.29
B	采矿业	1,467,662.00	2.87
C	制造业	14,790,683.02	28.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	900,681.00	1.76
E	建筑业	794,599.00	1.55
F	批发和零售业	459,741.00	0.90
G	交通运输、仓储和邮政业	1,046,600.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,025,090.00	2.01
J	金融业	3,983,623.10	7.79
K	房地产业	405,736.00	0.79
L	租赁和商务服务业	280,322.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	205,004.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	154,844.00	0.30
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	14,353.00	0.03
Q	卫生和社会工作	145,557.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	163,490.00	0.32
S	综合	-	-
	合计	25,986,445.12	50.83

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	400	690,800.00	1.35

2	300750	宁德时代	1,100	432,762.00	0.85
3	601398	工商银行	91,900	398,846.00	0.78
4	000858	五粮液	1,700	307,173.00	0.60
5	002142	宁波银行	9,400	305,030.00	0.60
6	600276	恒瑞医药	7,000	269,710.00	0.53
7	600900	长江电力	11,800	247,800.00	0.48
8	601318	中国平安	5,100	239,700.00	0.47
9	600028	中国石化	52,800	230,208.00	0.45
10	000568	泸州老窖	1,000	224,280.00	0.44
11	002475	立讯精密	6,900	219,075.00	0.43
12	002594	比亚迪	800	205,576.00	0.40
13	002466	天齐锂业	2,600	205,374.00	0.40
14	601668	中国建筑	36,300	197,109.00	0.39
15	601628	中国人寿	5,300	196,736.00	0.38
16	002415	海康威视	5,600	194,208.00	0.38
17	601012	隆基绿能	4,300	181,718.00	0.36
18	601088	中国神华	6,500	179,530.00	0.35
19	300014	亿纬锂能	2,000	175,800.00	0.34
20	600809	山西汾酒	600	170,994.00	0.33
21	600795	国电电力	38,900	166,103.00	0.32
22	600837	海通证券	18,800	163,372.00	0.32
23	002180	纳思达	3,100	160,859.00	0.31
24	002304	洋河股份	1,000	160,500.00	0.31
25	600048	保利发展	10,500	158,865.00	0.31
26	002129	TCL 中环	4,200	158,172.00	0.31
27	002371	北方华创	700	157,710.00	0.31
28	600926	杭州银行	12,000	156,960.00	0.31
29	600690	海尔智家	6,400	156,544.00	0.31
30	603019	中科曙光	7,000	154,980.00	0.30
31	601211	国泰君安	11,200	152,208.00	0.30
32	601899	紫金矿业	15,200	152,000.00	0.30
33	601688	华泰证券	11,900	151,606.00	0.30
34	600089	特变电工	7,500	150,600.00	0.29
35	688981	中芯国际	3,659	150,531.26	0.29
36	600919	江苏银行	20,000	145,800.00	0.29
36	603259	药明康德	1,800	145,800.00	0.29
37	601939	建设银行	25,800	145,254.00	0.28
38	600438	通威股份	3,700	142,746.00	0.28
39	600018	上港集团	25,400	135,636.00	0.27
40	601838	成都银行	8,837	135,206.10	0.26
41	600489	中金黄金	16,400	134,316.00	0.26
42	601669	中国电建	18,500	130,980.00	0.26
43	601288	农业银行	44,700	130,077.00	0.25
44	601888	中国中免	600	129,618.00	0.25

45	601009	南京银行	12,400	129,208.00	0.25
46	600741	华域汽车	7,400	128,242.00	0.25
47	600160	巨化股份	8,000	124,080.00	0.24
48	300433	蓝思科技	11,000	115,830.00	0.23
49	600820	隧道股份	21,900	115,413.00	0.23
50	300015	爱尔眼科	3,700	114,959.00	0.22
51	000425	徐工机械	22,500	114,075.00	0.22
52	601179	中国西电	24,300	112,023.00	0.22
53	601857	中国石油	22,500	111,825.00	0.22
54	600309	万华化学	1,200	111,180.00	0.22
55	600998	九州通	8,500	110,840.00	0.22
56	601166	兴业银行	6,300	110,817.00	0.22
57	601298	青岛港	19,500	109,395.00	0.21
58	600985	淮北矿业	8,500	108,800.00	0.21
59	000333	美的集团	2,100	108,780.00	0.21
60	300059	东方财富	5,600	108,640.00	0.21
61	001979	招商蛇口	8,400	106,092.00	0.21
62	002048	宁波华翔	7,600	105,640.00	0.21
63	600803	新奥股份	6,200	99,820.00	0.20
64	002179	中航光电	1,700	98,192.00	0.19
65	300628	亿联网络	1,600	96,944.00	0.19
66	002281	光迅科技	6,100	95,892.00	0.19
67	300760	迈瑞医疗	300	94,791.00	0.19
68	601100	恒立液压	1,500	94,725.00	0.19
69	601699	潞安环能	5,600	94,360.00	0.18
70	601998	中信银行	18,900	94,122.00	0.18
71	688289	圣湘生物	4,200	92,190.00	0.18
72	601988	中国银行	28,800	91,008.00	0.18
73	002601	龙佰集团	4,800	90,816.00	0.18
74	300124	汇川技术	1,300	90,350.00	0.18
75	002250	联化科技	5,800	89,900.00	0.18
76	300316	晶盛机电	1,400	88,984.00	0.17
77	002268	电科网安	2,900	88,537.00	0.17
78	601006	大秦铁路	13,100	87,508.00	0.17
79	601225	陕西煤业	4,700	87,326.00	0.17
80	600039	四川路桥	7,800	86,736.00	0.17
81	601869	长飞光纤	2,600	84,838.00	0.17
82	601111	中国国航	7,900	83,740.00	0.16
83	600486	扬农化工	800	83,120.00	0.16
84	600500	中化国际	12,500	82,625.00	0.16
85	601328	交通银行	17,100	81,054.00	0.16
86	600660	福耀玻璃	2,300	80,661.00	0.16
87	600563	法拉电子	500	79,940.00	0.16
88	002444	巨星科技	4,100	77,818.00	0.15

89	600153	建发股份	5,700	77,805.00	0.15
90	000739	普洛药业	3,600	77,544.00	0.15
91	002385	大北农	8,700	77,430.00	0.15
92	603379	三美股份	2,700	76,842.00	0.15
93	002056	横店东磁	4,100	76,834.00	0.15
94	601997	贵阳银行	13,900	76,311.00	0.15
95	000063	中兴通讯	2,900	74,994.00	0.15
96	600233	圆通速递	3,700	74,333.00	0.15
97	600901	江苏金租	13,500	73,980.00	0.14
98	002714	牧原股份	1,500	73,125.00	0.14
99	600392	盛和资源	5,200	72,800.00	0.14
100	000869	张裕 A	2,400	72,576.00	0.14
101	600026	中远海能	6,000	72,300.00	0.14
102	600739	辽宁成大	5,700	71,763.00	0.14
103	600887	伊利股份	2,300	71,300.00	0.14
104	000977	浪潮信息	3,300	71,016.00	0.14
105	601138	工业富联	7,700	70,686.00	0.14
106	600549	厦门钨业	3,600	70,380.00	0.14
107	600383	金地集团	6,800	69,564.00	0.14
108	688208	道通科技	2,200	69,410.00	0.14
109	000623	吉林敖东	4,600	68,954.00	0.13
110	000768	中航西飞	2,700	68,715.00	0.13
111	000690	宝新能源	10,500	68,250.00	0.13
112	600732	爱旭股份	1,800	68,076.00	0.13
113	002311	海大集团	1,100	67,903.00	0.13
114	600022	山东钢铁	44,900	66,452.00	0.13
115	603290	斯达半导	200	65,860.00	0.13
116	601058	赛轮轮胎	6,500	65,130.00	0.13
117	601816	京沪高铁	13,100	64,452.00	0.13
118	600517	国网英大	13,300	64,372.00	0.13
119	000898	鞍钢股份	24,000	64,080.00	0.13
120	003022	联泓新科	2,100	63,735.00	0.12
121	600885	宏发股份	1,900	63,479.00	0.12
122	002236	大华股份	5,500	62,205.00	0.12
123	000547	航天发展	6,600	61,974.00	0.12
124	600968	海油发展	21,500	61,920.00	0.12
125	002299	圣农发展	2,600	61,594.00	0.12
126	000651	格力电器	1,900	61,408.00	0.12
127	000686	东北证券	9,400	61,100.00	0.12
128	000963	华东医药	1,300	60,840.00	0.12
129	600188	兖矿能源	1,800	60,444.00	0.12
130	300496	中科创达	600	60,180.00	0.12
131	002705	新宝股份	3,600	59,940.00	0.12
132	600718	东软集团	6,000	59,700.00	0.12

133	603707	健友股份	3,300	59,532.00	0.12
134	000012	南玻A	8,800	59,048.00	0.12
135	300002	神州泰岳	13,600	59,024.00	0.12
136	000400	许继电气	2,900	57,913.00	0.11
137	300115	长盈精密	5,600	57,848.00	0.11
138	600436	片仔癀	200	57,692.00	0.11
139	600176	中国巨石	4,200	57,582.00	0.11
140	002867	周大生	4,100	57,523.00	0.11
141	300450	先导智能	1,400	56,350.00	0.11
142	601127	赛力斯	1,400	55,986.00	0.11
143	600256	广汇能源	6,200	55,924.00	0.11
144	002353	杰瑞股份	2,000	55,820.00	0.11
145	600050	中国联通	12,300	55,104.00	0.11
146	002004	华邦健康	10,700	54,570.00	0.11
147	600566	济川药业	2,000	54,440.00	0.11
148	601991	大唐发电	19,500	54,405.00	0.11
149	600529	山东药玻	1,900	53,960.00	0.11
150	002410	广联达	900	53,955.00	0.11
151	600019	宝钢股份	9,600	53,664.00	0.10
152	600699	均胜电子	3,800	53,390.00	0.10
153	688111	金山办公	200	52,898.00	0.10
154	002709	天赐材料	1,200	52,632.00	0.10
155	002230	科大讯飞	1,600	52,528.00	0.10
156	300347	泰格医药	500	52,400.00	0.10
157	688268	华特气体	700	51,975.00	0.10
158	600378	昊华科技	1,200	51,492.00	0.10
159	002648	卫星化学	3,300	51,150.00	0.10
160	600315	上海家化	1,600	50,960.00	0.10
161	601099	太平洋	19,800	50,886.00	0.10
162	002555	三七互娱	2,800	50,680.00	0.10
163	600835	上海机电	4,500	50,490.00	0.10
164	600528	中铁工业	6,600	50,358.00	0.10
165	601886	江河集团	6,500	50,310.00	0.10
166	000661	长春高新	300	49,935.00	0.10
167	600348	华阳股份	3,500	49,875.00	0.10
168	600329	达仁堂	1,700	49,470.00	0.10
169	600131	国网信通	3,300	49,368.00	0.10
170	600377	宁沪高速	6,000	49,320.00	0.10
171	300033	同花顺	500	49,305.00	0.10
172	300363	博腾股份	1,200	49,020.00	0.10
173	300666	江丰电子	700	48,440.00	0.09
174	688002	睿创微纳	1,300	48,347.00	0.09
175	688006	杭可科技	1,100	48,147.00	0.09
176	600030	中信证券	2,400	47,784.00	0.09

177	688819	天能股份	1,300	47,762.00	0.09
178	002065	东华软件	8,400	47,544.00	0.09
179	600060	海信视像	3,500	47,390.00	0.09
180	000090	天健集团	8,600	46,956.00	0.09
181	601098	中南传媒	4,700	46,906.00	0.09
182	601689	拓普集团	800	46,864.00	0.09
183	000999	华润三九	1,000	46,810.00	0.09
184	000156	华数传媒	6,200	46,438.00	0.09
185	600380	健康元	4,100	46,289.00	0.09
186	688116	天奈科技	600	46,284.00	0.09
187	002399	海普瑞	3,600	46,260.00	0.09
188	600009	上海机场	800	46,168.00	0.09
189	603026	胜华新材	500	46,150.00	0.09
190	002074	国轩高科	1,600	46,128.00	0.09
191	600642	申能股份	8,400	46,116.00	0.09
192	600928	西安银行	13,100	46,112.00	0.09
193	601128	常熟银行	6,100	46,055.00	0.09
194	002273	水晶光电	3,900	45,981.00	0.09
195	603056	德邦股份	2,200	45,826.00	0.09
196	000785	居然之家	11,200	45,808.00	0.09
197	300182	捷成股份	10,200	45,594.00	0.09
198	000997	新大陆	3,500	45,535.00	0.09
199	002027	分众传媒	6,800	45,424.00	0.09
200	601880	辽港股份	28,000	45,360.00	0.09
201	600195	中牧股份	3,900	45,318.00	0.09
202	600535	天士力	4,200	45,192.00	0.09
202	600597	光明乳业	4,200	45,192.00	0.09
203	000937	冀中能源	7,100	45,156.00	0.09
204	300073	当升科技	800	45,120.00	0.09
205	601555	东吴证券	6,900	45,057.00	0.09
206	603077	和邦生物	14,800	44,992.00	0.09
207	000598	兴蓉环境	9,200	44,988.00	0.09
208	002583	海能达	8,800	44,968.00	0.09
209	000883	湖北能源	10,700	44,940.00	0.09
210	601108	财通证券	6,300	44,856.00	0.09
211	600475	华光环能	5,100	44,829.00	0.09
212	300274	阳光电源	400	44,720.00	0.09
213	300296	利亚德	7,900	44,714.00	0.09
214	600643	爱建集团	8,100	44,712.00	0.09
215	001301	尚太科技	756	44,634.24	0.09
216	601158	重庆水务	8,700	44,631.00	0.09
217	300136	信维通信	2,700	44,577.00	0.09
218	601607	上海医药	2,500	44,575.00	0.09
219	002249	大洋电机	8,700	44,544.00	0.09

220	603228	景旺电子	2,200	44,528.00	0.09
221	601390	中国中铁	8,000	44,480.00	0.09
222	603568	伟明环保	2,400	44,472.00	0.09
223	600170	上海建工	17,100	44,460.00	0.09
224	002936	郑州银行	18,900	44,415.00	0.09
225	002408	齐翔腾达	6,300	44,352.00	0.09
226	002010	传化智联	8,300	44,322.00	0.09
227	603739	蔚蓝生物	3,300	44,286.00	0.09
228	002625	光启技术	2,600	44,252.00	0.09
229	000563	陕国投 A	14,600	44,238.00	0.09
230	601992	金隅集团	17,400	44,196.00	0.09
231	300088	长信科技	7,400	44,178.00	0.09
232	601598	中国外运	11,500	44,160.00	0.09
233	002396	星网锐捷	2,300	44,068.00	0.09
234	000967	盈峰环境	9,700	44,038.00	0.09
235	002745	木林森	5,400	43,794.00	0.09
236	000987	越秀资本	7,300	43,727.00	0.09
237	600487	亨通光电	2,900	43,674.00	0.09
238	601568	北元集团	7,700	43,659.00	0.09
239	600927	永安期货	2,700	43,524.00	0.09
240	000538	云南白药	800	43,488.00	0.09
241	601766	中国中车	8,500	43,435.00	0.08
242	000559	万向钱潮	8,900	43,343.00	0.08
243	600426	华鲁恒升	1,300	43,095.00	0.08
244	603185	上机数控	400	42,340.00	0.08
245	000001	平安银行	3,200	42,112.00	0.08
246	002221	东华能源	5,500	41,965.00	0.08
247	601168	西部矿业	4,100	41,820.00	0.08
248	603260	合盛硅业	500	41,470.00	0.08
249	300751	迈为股份	100	41,184.00	0.08
250	600717	天津港	9,900	40,590.00	0.08
251	600570	恒生电子	1,000	40,460.00	0.08
252	600372	中航电子	2,500	39,925.00	0.08
253	002049	紫光国微	300	39,546.00	0.08
254	000895	双汇发展	1,500	38,895.00	0.08
255	603885	吉祥航空	2,400	38,832.00	0.08
256	603899	晨光股份	700	38,486.00	0.08
257	300207	欣旺达	1,800	38,070.00	0.07
258	002007	华兰生物	1,600	36,208.00	0.07
259	002459	晶澳科技	600	36,054.00	0.07
260	002690	美亚光电	1,500	35,850.00	0.07
261	000066	中国长城	3,500	35,700.00	0.07
262	605499	东鹏饮料	200	35,580.00	0.07
263	000938	紫光股份	1,700	33,167.00	0.06

264	605117	德业股份	100	33,120.00	0.06
265	600111	北方稀土	1,300	32,565.00	0.06
266	002050	三花智控	1,500	31,830.00	0.06
267	600633	浙数文化	3,800	31,122.00	0.06
268	603986	兆易创新	300	30,741.00	0.06
269	600763	通策医疗	200	30,598.00	0.06
270	600999	招商证券	2,300	30,590.00	0.06
271	603369	今世缘	600	30,540.00	0.06
272	300957	贝泰妮	200	29,848.00	0.06
273	601989	中国重工	8,500	29,665.00	0.06
274	000792	盐湖股份	1,300	29,497.00	0.06
275	000513	丽珠集团	900	29,232.00	0.06
276	600536	中国软件	500	29,165.00	0.06
277	600989	宝丰能源	2,400	28,968.00	0.06
278	000887	中鼎股份	2,000	28,940.00	0.06
279	002120	韵达股份	2,000	28,760.00	0.06
280	600547	山东黄金	1,500	28,740.00	0.06
281	600959	江苏有线	9,600	28,512.00	0.06
282	600027	华电国际	4,800	28,224.00	0.06
283	300142	沃森生物	700	28,133.00	0.06
284	603355	莱克电气	1,000	28,040.00	0.05
285	600905	三峡能源	4,900	27,685.00	0.05
286	600941	中国移动	400	27,068.00	0.05
287	603868	飞科电器	400	26,932.00	0.05
288	603638	艾迪精密	1,800	26,856.00	0.05
289	688020	方邦股份	500	26,385.00	0.05
290	300122	智飞生物	300	26,349.00	0.05
291	688008	澜起科技	420	26,292.00	0.05
292	002812	恩捷股份	200	26,258.00	0.05
293	600399	抚顺特钢	1,800	25,758.00	0.05
294	688626	翔宇医疗	800	25,504.00	0.05
295	002223	鱼跃医疗	800	25,488.00	0.05
296	600132	重庆啤酒	200	25,476.00	0.05
297	300841	康华生物	300	25,386.00	0.05
298	603392	万泰生物	200	25,340.00	0.05
299	300595	欧普康视	700	24,990.00	0.05
300	688223	晶科能源	1,700	24,905.00	0.05
301	000581	威孚高科	1,400	24,822.00	0.05
302	603658	安图生物	400	24,740.00	0.05
303	603317	天味食品	900	24,732.00	0.05
304	601928	凤凰传媒	3,100	24,552.00	0.05
305	600521	华海药业	1,100	24,046.00	0.05
306	002152	广电运通	2,400	23,856.00	0.05
307	002901	大博医疗	700	23,821.00	0.05

308	600801	华新水泥	1,600	23,712.00	0.05
309	002841	视源股份	400	23,616.00	0.05
310	600556	天下秀	3,500	23,590.00	0.05
311	000021	深科技	2,200	23,518.00	0.05
312	600008	首创环保	8,300	23,489.00	0.05
313	000786	北新建材	900	23,292.00	0.05
314	600582	天地科技	4,400	22,880.00	0.04
315	000733	振华科技	200	22,846.00	0.04
316	300146	汤臣倍健	1,000	22,820.00	0.04
317	601611	中国核建	3,000	22,800.00	0.04
318	600350	山东高速	4,000	22,760.00	0.04
319	603611	诺力股份	1,400	22,666.00	0.04
320	000709	河钢股份	10,000	22,600.00	0.04
321	300376	易事特	3,300	22,539.00	0.04
322	300454	深信服	200	22,510.00	0.04
323	300257	开山股份	1,500	22,500.00	0.04
324	600580	卧龙电驱	1,800	22,428.00	0.04
325	601186	中国铁建	2,900	22,417.00	0.04
326	600511	国药股份	800	22,320.00	0.04
327	002373	千方科技	2,500	22,300.00	0.04
328	000401	冀东水泥	2,700	22,221.00	0.04
329	600867	通化东宝	2,400	22,032.00	0.04
330	688321	微芯生物	1,000	21,980.00	0.04
331	002195	二三四五	10,900	21,909.00	0.04
332	000039	中集集团	3,100	21,824.00	0.04
332	000970	中科三环	1,600	21,824.00	0.04
333	300037	新宙邦	500	21,735.00	0.04
334	600909	华安证券	4,700	21,573.00	0.04
335	001872	招商港口	1,500	21,540.00	0.04
336	002266	浙富控股	5,500	21,505.00	0.04
337	600967	内蒙一机	2,600	21,476.00	0.04
338	600516	方大炭素	3,500	21,420.00	0.04
339	002081	金螳螂	4,400	21,340.00	0.04
340	601231	环旭电子	1,300	21,099.00	0.04
341	002497	雅化集团	900	20,925.00	0.04
342	002460	赣锋锂业	300	20,853.00	0.04
343	603659	璞泰来	400	20,756.00	0.04
344	300121	阳谷华泰	2,000	20,720.00	0.04
345	600299	安迪苏	2,500	20,650.00	0.04
346	300618	寒锐钴业	500	20,025.00	0.04
347	002738	中矿资源	300	19,998.00	0.04
348	000750	国海证券	6,000	19,980.00	0.04
349	600588	用友网络	800	19,336.00	0.04
350	688330	宏力达	300	19,104.00	0.04

351	300308	中际旭创	700	18,921.00	0.04
352	002568	百润股份	500	18,680.00	0.04
353	002078	太阳纸业	1,600	18,432.00	0.04
354	002439	启明星辰	700	18,256.00	0.04
355	688777	中控技术	200	18,166.00	0.04
356	601456	国联证券	1,600	18,000.00	0.04
357	600848	上海临港	1,500	17,880.00	0.03
358	603156	养元饮品	800	17,816.00	0.03
359	601319	中国人保	3,400	17,748.00	0.03
360	600760	中航沈飞	300	17,589.00	0.03
361	688162	巨一科技	400	17,328.00	0.03
362	600325	华发股份	1,900	17,214.00	0.03
363	600893	航发动力	400	16,912.00	0.03
364	600859	王府井	600	16,884.00	0.03
365	603858	步长制药	800	16,808.00	0.03
366	002271	东方雨虹	500	16,785.00	0.03
367	603799	华友钴业	300	16,689.00	0.03
368	300026	红日药业	2,900	16,472.00	0.03
369	002938	鹏鼎控股	600	16,464.00	0.03
370	300474	景嘉微	300	16,371.00	0.03
371	601788	光大证券	1,100	16,357.00	0.03
372	600435	北方导航	1,400	16,240.00	0.03
373	601658	邮储银行	3,500	16,170.00	0.03
374	600584	长电科技	700	16,135.00	0.03
375	002422	科伦药业	600	15,966.00	0.03
376	002244	滨江集团	1,800	15,894.00	0.03
377	300058	蓝色光标	3,000	15,150.00	0.03
378	688556	高测股份	200	15,004.00	0.03
379	002821	凯莱英	100	14,800.00	0.03
380	002607	中公教育	3,100	14,353.00	0.03
381	603195	公牛集团	100	14,326.00	0.03
382	002368	太极股份	500	14,065.00	0.03
383	300498	温氏股份	700	13,741.00	0.03
384	600908	无锡银行	2,600	13,702.00	0.03
385	002900	哈三联	1,000	13,650.00	0.03
386	601238	广汽集团	1,200	13,236.00	0.03
387	002946	新乳业	1,000	13,230.00	0.03
388	603688	石英股份	100	13,132.00	0.03
389	601881	中国银河	1,400	13,006.00	0.03
390	000878	云南铜业	1,100	12,925.00	0.03
391	688012	中微公司	130	12,741.30	0.02
392	000002	万科 A	700	12,740.00	0.02
393	600765	中航重机	400	12,436.00	0.02
394	603876	鼎胜新材	300	12,312.00	0.02

395	002430	杭氧股份	300	11,808.00	0.02
396	002352	顺丰控股	200	11,552.00	0.02
397	300979	华利集团	202	11,536.22	0.02
398	002518	科士达	200	11,520.00	0.02
399	300633	开立医疗	200	10,966.00	0.02
400	000932	华菱钢铁	2,300	10,810.00	0.02
401	600600	青岛啤酒	100	10,750.00	0.02
402	600745	闻泰科技	200	10,516.00	0.02
403	600606	绿地控股	3,400	10,132.00	0.02
404	002032	苏泊尔	200	9,892.00	0.02
405	688273	麦澜德	300	9,780.00	0.02
406	603052	可川科技	200	9,374.00	0.02
407	000913	钱江摩托	500	9,240.00	0.02
408	002756	永兴材料	100	9,217.00	0.02
409	603529	爱玛科技	200	9,174.00	0.02
410	603086	先达股份	700	9,163.00	0.02
411	000915	华特达因	200	9,100.00	0.02
412	605196	华通线缆	1,300	9,074.00	0.02
413	603363	傲农生物	700	9,023.00	0.02
414	002111	威海广泰	900	8,973.00	0.02
415	603619	中曼石油	500	8,965.00	0.02
416	301004	嘉益股份	300	8,934.00	0.02
417	002209	达意隆	1,100	8,811.00	0.02
418	300205	天喻信息	800	8,800.00	0.02
419	003040	楚天龙	500	8,720.00	0.02
420	688401	路维光电	200	8,718.00	0.02
421	301035	润丰股份	100	8,710.00	0.02
422	600546	山煤国际	600	8,694.00	0.02
423	688295	中复神鹰	200	8,634.00	0.02
424	300546	雄帝科技	400	8,544.00	0.02
425	603040	新坐标	500	8,540.00	0.02
426	603035	常熟汽饰	400	8,500.00	0.02
427	600779	水井坊	100	8,442.00	0.02
428	603421	鼎信通讯	1,000	8,370.00	0.02
429	300512	中亚股份	1,200	8,244.00	0.02
429	603636	南威软件	600	8,244.00	0.02
430	000983	山西焦煤	700	8,155.00	0.02
431	000893	亚钾国际	300	8,154.00	0.02
432	002002	鸿达兴业	2,500	8,100.00	0.02
433	600958	东方证券	900	8,046.00	0.02
434	603083	剑桥科技	700	7,868.00	0.02
435	300438	鹏辉能源	100	7,799.00	0.02
436	688400	凌云光	300	7,659.00	0.01
437	600219	南山铝业	2,300	7,521.00	0.01

438	002390	信邦制药	1,500	7,050.00	0.01
439	600728	佳都科技	1,300	6,864.00	0.01
440	600029	南方航空	900	6,840.00	0.01
441	600645	中源协和	400	6,804.00	0.01
442	300260	新莱应材	100	6,710.00	0.01
443	600115	中国东航	1,200	6,636.00	0.01
444	000778	新兴铸管	1,800	6,570.00	0.01
445	603225	新凤鸣	600	6,528.00	0.01
446	601021	春秋航空	100	6,425.00	0.01
447	600201	生物股份	700	6,307.00	0.01
448	600064	南京高科	900	5,949.00	0.01
449	603348	文灿股份	100	5,757.00	0.01
450	603360	百傲化学	300	5,271.00	0.01
451	002557	洽洽食品	100	5,000.00	0.01
452	600346	恒力石化	300	4,659.00	0.01
453	002063	远光软件	600	4,554.00	0.01
454	000601	韶能股份	900	4,230.00	0.01
455	002374	中锐股份	700	4,109.00	0.01
456	300271	华宇软件	600	4,098.00	0.01
457	002493	荣盛石化	300	3,690.00	0.01
458	002876	三利谱	100	3,640.00	0.01
459	600988	赤峰黄金	200	3,610.00	0.01
460	601865	福莱特	100	3,331.00	0.01
461	600583	海油工程	500	3,030.00	0.01
462	002785	万里石	100	3,018.00	0.01
463	601633	长城汽车	100	2,962.00	0.01
464	601872	招商轮船	500	2,795.00	0.01
465	000529	广弘控股	300	2,631.00	0.01
466	002138	顺络电子	100	2,618.00	0.01
467	002507	涪陵榨菜	100	2,577.00	0.01
468	000950	重药控股	500	2,540.00	0.00
469	601066	中信建投	100	2,375.00	0.00
470	002372	伟星新材	100	2,134.00	0.00
471	002404	嘉欣丝绸	300	1,911.00	0.00
472	300119	瑞普生物	100	1,861.00	0.00
473	603315	福鞍股份	100	1,710.00	0.00
474	000900	现代投资	400	1,672.00	0.00
475	601808	中海油服	100	1,658.00	0.00
476	001914	招商积余	100	1,538.00	0.00
477	300592	华凯易佰	100	1,515.00	0.00
478	300230	永利股份	400	1,512.00	0.00
479	600356	恒丰纸业	200	1,464.00	0.00
480	300532	今天国际	100	1,448.00	0.00
481	603081	大丰实业	100	1,246.00	0.00

482	600841	动力新科	200	1,214.00	0.00
483	601187	厦门银行	200	1,146.00	0.00
484	600330	天通股份	100	1,054.00	0.00
485	603551	奥普家居	100	975.00	0.00
486	601868	中国能建	400	916.00	0.00
487	300095	华伍股份	100	897.00	0.00
488	601236	红塔证券	100	740.00	0.00
489	002454	松芝股份	100	710.00	0.00
490	600133	东湖高新	100	550.00	0.00
491	600531	豫光金铅	100	521.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	13,765,927.00	6.10
2	300750	宁德时代	8,727,726.95	3.87
3	300059	东方财富	7,112,377.80	3.15
4	000858	五粮液	6,678,735.00	2.96
5	600048	保利发展	5,783,503.00	2.56
6	002304	洋河股份	5,715,412.00	2.53
7	601238	广汽集团	5,333,691.14	2.36
8	601012	隆基绿能	5,327,740.14	2.36
9	600900	长江电力	5,295,455.00	2.35
10	600438	通威股份	5,252,189.47	2.33
11	601166	兴业银行	5,245,163.00	2.33
12	601668	中国建筑	5,104,418.00	2.26
13	601318	中国平安	4,900,709.00	2.17
14	002714	牧原股份	4,807,319.00	2.13
15	600030	中信证券	4,680,688.75	2.07
16	000166	申万宏源	4,668,117.00	2.07
17	000002	万科A	4,610,964.68	2.04
18	600383	金地集团	4,563,632.83	2.02
19	603259	药明康德	4,533,649.00	2.01
20	000725	京东方A	4,442,589.00	1.97

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	600519	贵州茅台	17,189,582.00	7.62
2	300750	宁德时代	10,312,008.00	4.57
3	300059	东方财富	7,745,950.31	3.43
4	000858	五粮液	7,590,606.00	3.36
5	601012	隆基绿能	6,609,716.08	2.93
6	600048	保利发展	6,366,108.00	2.82
7	600438	通威股份	6,204,154.91	2.75
8	002304	洋河股份	6,034,768.56	2.68
9	002142	宁波银行	5,781,108.20	2.56
10	600900	长江电力	5,751,459.00	2.55
11	601166	兴业银行	5,669,690.00	2.51
12	601668	中国建筑	5,590,566.00	2.48
13	601238	广汽集团	5,545,447.00	2.46
14	600030	中信证券	5,512,049.80	2.44
15	601318	中国平安	5,453,664.00	2.42
16	000002	万科A	5,422,879.26	2.40
17	002129	TCL中环	5,167,742.00	2.29
18	000725	京东方A	5,046,211.00	2.24
19	600383	金地集团	5,035,843.92	2.23
20	002714	牧原股份	5,013,623.61	2.22
21	000166	申万宏源	4,733,309.00	2.10
22	600018	上港集团	4,711,840.00	2.09
23	000568	泸州老窖	4,660,853.00	2.07
24	601888	中国中免	4,615,156.00	2.05
25	601225	陕西煤业	4,546,355.00	2.02

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	990,050,020.99
卖出股票收入（成交）总额	1,103,978,194.01

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	1,314,143.29	2.57
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）	1,522,030.33	2.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,836,173.62	5.55

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	010303	03 国债(3)	13,000	1,314,143.29	2.57
2	113052	兴业转债	1,450	147,630.86	0.29
3	128037	岩土转债	860	100,363.72	0.20
4	127042	嘉美转债	900	98,999.01	0.19
5	110053	苏银转债	800	98,973.63	0.19

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

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

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

8.11.2 本期国债期货投资评价

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

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 25,986,445.12 元，占基金资产净值的比例为 50.83%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 22,277,620.00 元，占基金资产净值的比例为 43.58%，空头合约市值占股票资产的比例为 85.73%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 -1,221,479.12 元，公允价值变动损益为 -3,648,058.97 元。

8.13 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券除工商银行（代码：601398 SH）、宁波银行（代码：002142 SZ）、中国平安（代码：601318 SH）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1. 中国工商银行股份有限公司

2022 年 3 月 25 日，中国工商银行股份有限公司因未依法履行职责被中国银行保险监督管理委员会罚款。

2022 年 4 月 29 日，中国工商银行股份有限公司因违规经营被中国银行保险监督管理委员会通知整改。

2. 宁波银行股份有限公司

2022 年 4 月-2022 年 9 月，宁波银行股份有限公司因违规经营、未依法履行职责、内部制度不完善多次被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局罚款、通知整改。

3. 中国平安保险(集团)股份有限公司

2022 年 8 月 22 日，中国平安保险(集团)股份有限公司因未依法履行职责被国家外汇管理局深圳市分局警告、罚款、通知整改。

以上证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,892,365.00
2	应收清算款	576,040.53

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,468,405.53

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113052	兴业转债	147,630.86	0.29
2	128037	岩土转债	100,363.72	0.20
3	127042	嘉美转债	98,999.01	0.19
4	110053	苏银转债	98,973.63	0.19
5	113639	华正转债	98,601.52	0.19
6	113591	胜达转债	98,400.36	0.19
7	123064	万孚转债	97,783.31	0.19
8	113056	重银转债	97,134.49	0.19
9	113631	皖天转债	96,379.37	0.19
10	128081	海亮转债	95,712.29	0.19
11	110084	贵燃转债	94,324.38	0.18
12	127028	英特转债	94,072.38	0.18
13	123128	首华转债	93,997.04	0.18
14	127032	苏行转债	51,149.12	0.10
15	127055	精装转债	49,766.40	0.10
16	113610	灵康转债	48,342.58	0.09
17	113647	禾丰转债	39,560.64	0.08

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
安信阿尔法定开混合 A	1,506	23,227.47	-	-	34,980,571.51	100.00
安信阿尔法定开混合 C	451	19,093.09	3,417,147.66	39.68	5,193,837.89	60.32
合计	1,929	22,598.01	3,417,147.66	7.84	40,174,409.40	92.16

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	安信阿尔法定开混合 A	601,979.56	1.72
	安信阿尔法定开混合 C	2,751.69	0.03
	合计	604,731.25	1.39

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金发起资金持有期限已满三年，截至本报告期末，发起资金未持有本基金份额。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信阿尔法定开混合 A	安信阿尔法定开混合 C
基金合同生效日（2017年12月6日）基金份额总额	10,298,649.48	-

本报告期期初基金份额总额	146,662,333.05	38,717,161.34
本报告期基金总申购份额	40,034.40	3,766,056.91
减：本报告期基金总赎回份额	111,721,795.94	33,872,232.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,980,571.51	8,610,985.55

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

自 2022 年 7 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 20,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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到相关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没有受到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 (%)	
长江证券	2	1,392,371,989.42	66.62	992,260.93	69.16	-
东方证券	2	527,637,887.06	25.25	380,586.06	26.53	-
安信证券	2	147,471,336.32	7.06	45,907.23	3.20	-
浙商证券	2	22,485,758.92	1.08	15,994.83	1.11	新租
长城证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
长江证券	35,760,254.48	30.59	2,015,950,000.00	46.13	-	-
东方证券	72,628,381.55	62.14	1,476,770,000.00	33.79	-	-
安信证券	7,940,899.68	6.79	661,000,000.00	15.12	-	-
浙商证券	558,051.84	0.48	216,900,000.00	4.96	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信基金管理有限责任公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2022-01-01

	具准则的公告		
2	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-01-21
3	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增国盛证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-01-26
4	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增众惠基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-02-16
5	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年度第一次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2022-03-08
6	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-03-31
7	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-04-08
8	安信基金管理有限责任公司关于对公司旗下 FOF 资产管理计划通过直销柜台办理旗下基金认购、申购、赎回及转换业务免收相关费用的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-04-15
9	安信基金管理有限责任公司旗下 79 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-04-21
10	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年度第二次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2022-06-07
11	安信基金管理有限责任公司旗下 79 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-07-20
12	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司、本公司员工名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-08-11
13	安信基金管理有限责任公司旗下 79 只基金中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-08-30
14	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年度第三次开放申购、赎回和转换业务的公告	上海证券报	2022-09-05
15	安信基金管理有限责任公司关于旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-10-25
16	安信基金管理有限责任公司关于安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金 2022 年度第四次开放申	上海证券报	2022-12-06

	购、赎回和转换业务的公告		
17	关于安信基金管理有限责任公司上海分公司营业场所变更的公告	中国证券报、证券日报、 证券时报、上海证券报	2022-12-13

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

本基金管理人及基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2023 年 3 月 30 日