

# 信达澳银领先智选混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

### 2021 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月二十九日

## §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。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 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经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 6 月 30 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§2 基金简介</b>	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	5
2.4 信息披露方式	5
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>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.3 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.5 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 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
<b>§5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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
<b>§6 审计报告</b>	15
<b>§7 年度财务报表</b>	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
<b>§8 投资组合报告</b>	54
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70

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	70
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	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12	投资组合报告附注	71
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b>	<b>72</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	72
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b>	<b>73</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b>	<b>73</b>
11.1	基金份额持有人大会决议	73
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	73
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
11.4	基金投资策略的改变	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	74
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	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
11.8	其他重大事件	75
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>77</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	77
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	77
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b>	<b>77</b>
13.1	备查文件目录	77
13.2	存放地点	78
13.3	查阅方式	78

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银领先智选混合型证券投资基金
基金简称	信达澳银领先智选混合
基金主代码	012608
交易代码	012608
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 30 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,653,199,580.03 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、存托凭证投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率 ×90% + 中证港股通综合指数收益率 ×5% + 银行活期存款利率(税后) ×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

## 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		信达澳银基金管理有限公司	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	胡波
	联系电话	0755-83172666	021-61618888
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话		400-8888-118	95528
传真		0755-83196151	021-63602540
注册地址		广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	上海市中山东一路 12 号
办公地址		广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	上海市北京东路 689 号
邮政编码		518054	200001
法定代表人		朱永强	郑杨

注：2022 年 3 月 21 日起，基金管理人名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

## 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)	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	信达澳银基金管理有限公司	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路2666号中国华润大厦10层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年6月30日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
本期已实现收益	-41,814,167.81
本期利润	187,877,755.80
加权平均基金份额本期利润	0.0392
本期加权平均净值利润率	3.76%
本期基金份额净值增长率	3.62%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末
期末可供分配利润	-41,890,008.23
期末可供分配基金份额利润	-0.0090
期末基金资产净值	4,821,652,741.15
期末基金份额净值	1.0362
3.1.3 累计期末指标	2021年末

基金份额累计净值增长率	3.62%
-------------	-------

### 3.2 基金净值表现

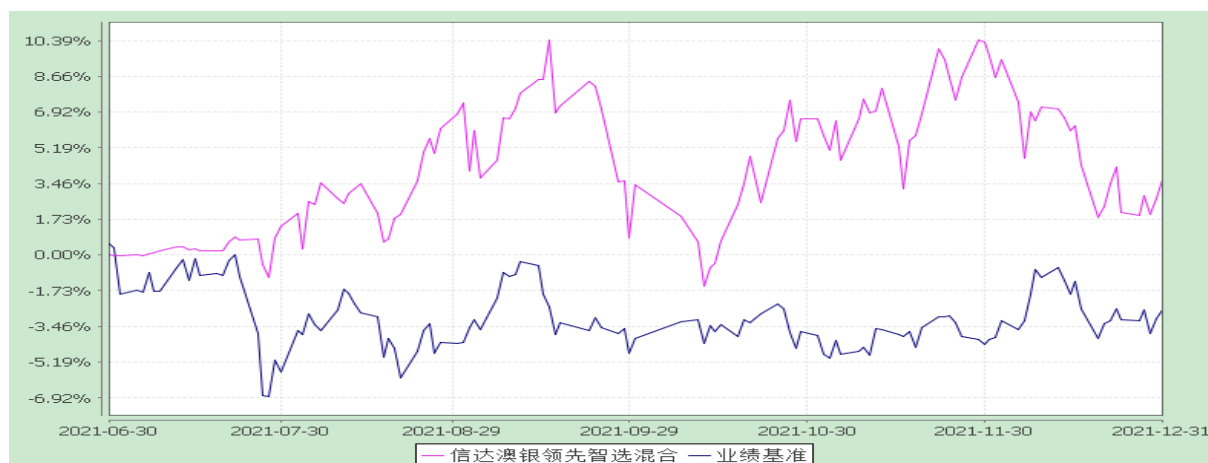
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.23%	1.37%	1.48%	0.68%	-1.25%	0.69%
过去六个月	3.62%	1.29%	-3.17%	0.89%	6.79%	0.40%
自基金合同生效起至今	3.62%	1.28%	-2.64%	0.88%	6.26%	0.40%

#### 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

信达澳银领先智选混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2021 年 6 月 30 日至 2021 年 12 月 31 日)



注:1、本基金基金合同于 2021 年 6 月 30 日生效,2021 年 9 月 27 日开始办理申购、赎回、转换、定期定额投资业务。

2、基金的投资组合比例为:本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%,其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者投资于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、

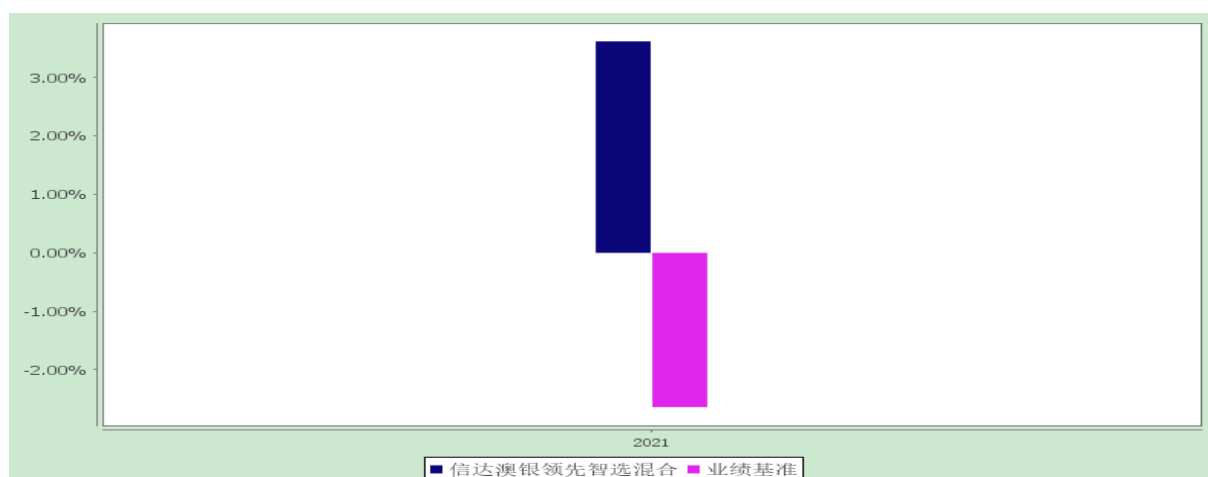


存出保证金、应收申购款等。本基金按规定在合同生效后六个月内应达到上述规定的投资组合比例。本基金的建仓期为 2021 年 6 月 30 日至 2021 年 12 月 29 日，本基金建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3、本基金基金合同生效日 2021 年 6 月 30 日至本报告期末未满一年。

### 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

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金无利润分配情况。

## §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

本基金管理人信达澳银基金管理有限公司（以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，由中国信达资产管理股份有限公司（原中国信达资产管理公司）和澳洲联邦银行全资附属公司 East Topco Limited 共同发起，是经中国证监会批准设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司，也是澳洲在中国合资设立第一家基金管理公司。2015 年 5 月 22 日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公司股份。公司注册资本 1 亿元人民币，总部设

在深圳，在北京和上海设有分公司。公司中方股东信达证券股份有限公司出资比例为 54%，外方股东 East Topco Limited 出资比例为 46%。

公司建立了健全的法人治理结构，根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会，并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制，由总经理负责公司的日常运作，并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT 治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构，设立了权益投资总部、混合资产投资部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售部、互联网金融部、战略客户部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门，各部门分工协作，职责明确。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司共管理 41 只基金，包括信达澳银转型创新股票型证券投资基金、信达澳银新能源产业股票型证券投资基金、信达澳银中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、信达澳银先进智造股票型证券投资基金、信达澳银蓝筹精选股票型证券投资基金、信达澳银健康中国灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新目标灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银新起点定期开放灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银核心科技混合型证券投资基金、信达澳银科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、信达澳银研究优选混合型证券投资基金、信达澳银匠心臻选两年持有期混合型证券投资基金、信达澳银周期动力混合型证券投资基金、信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)、信达澳银量化先锋混合型证券投资基金(LOF)、信达澳银领先增长混合型证券投资基金、信达澳银精华灵活配置混合型证券投资基金、信达澳银中小盘混合型证券投资基金、信达澳银红利回报混合型证券投资基金、信达澳银产业升级混合型证券投资基金、信达澳银消费优选混合型证券投资基金、信达澳银星奕混合型证券投资基金、信达澳银至诚精选混合型证券投资基金、信达澳银医药健康混合型证券投资基金、信达澳银新能源精选混合型证券投资基金、信达澳银领先智选混合型证券投资基金、信达澳银品质回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、信达澳银成长精选混合型证券投资基金、信达澳银恒盛混合型证券投

资基金、信达澳银价值精选混合型证券投资基金、信达澳银优势价值混合型证券投资基金、信达澳银景气优选混合型证券投资基金、信达澳银慧管家货币市场基金、信达澳银慧理财货币市场基金、信达澳银安益纯债债券型证券投资基金、信达澳银安盛纯债债券型证券投资基金、信达澳银鑫安债券型证券投资基金(LOF)、信达澳银信用债债券型证券投资基金、信达澳银鑫益债券型证券投资基金和信达澳银优享债券型证券投资基金。

报告期内，公司第五届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求；独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责，报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内，公司及基金运作未发生重大利益冲突事件，独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯明远	本基金的基金经理，公司副总经理、联席投资总监	2021-06-30	-	11 年	浙江大学工学硕士。2010 年 9 月，任平安证券综合研究所研究员，2014 年 1 月加入信达澳银基金公司，历任研究员，基金经理助理，现任副总经理、联席投资总监，信达澳银新能源产业股票基金基金经理（2016 年 10 月 19 日起至今）、信达澳银精华配置混合基金基金经理（2017 年 12 月 26 日起至今）、信达澳银先进智造股票基金基金经理（2019 年

				1月17日起至今)、信达澳银核心科技混合基金的基金经理(2019年8月14日起至今)、信达澳银科技创新一年定开混合基金的基金经理(2020年5月29日起至今)、信达澳银研究优选混合基金的基金经理(2020年6月22日起至今)、信达澳银匠心臻选两年持有期混合基金的基金经理(2020年10月30日起至今)、信达澳银星奕混合基金的基金经理(2021年1月22日起至今)、信达澳银领先智选混合基金的基金经理(2021年6月30日起至今)、信达澳银智远三年持有期混合基金的基金经理(2022年1月25日起至今)。
--	--	--	--	--

注:1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

## 4.2 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.2.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳银基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系,严谨的公平交易机制,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻,确保不同投资组合在买卖同一证券时,按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量,严格控制不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

#### 4.2.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

#### 4.2.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。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成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.3 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2021 年，本基金配置了新能源、半导体、化工、周期行业等制造业股票，具体配置方向包括锂电池、光伏、风电、新材料、半导体、先进装备、新材料等领域。

### 4.3.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.0362 元，份额累计净值为 1.0362 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 3.62%，同期业绩比较基准收益率为-2.64%。

### 4.4 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，我们面临地缘政治冲突、疫情扰动等多重考验，本基金将继续在新能源、TMT、先进制造业、稳增长等方向寻找投资机会。

### 4.5 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核人员对公司经营及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

- (1) 进一步完善公司管理及业务制度。
- (2) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。
- (3) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行投资者适用性原则。
- (4) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员道德风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。
- (5) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

#### 4.7.1 有关参与估值流程各方及人员（或小组）的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人设立了专项的估值小组，主要职责是决策制定估值政策和估值程序。小组成员具有估值核算、投资研究、风险管理等方面的专业经验。本小组设立基金估值小组负责人一名，由督察长担任；基金估值小组成员若干名，由权益投资总部、混合资产投资部、风险控制部、监察稽核部及基金运营部指定专人并经经营管理委员会审议通过后担任，其中基金运营部负责组织小组工作的开展。

#### 4.7.2 基金经理参与或决定估值的程度

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。估值政策和程序、估值调整等与基金估值有关的业务，由基金估值小组采用集体决策方式决定。

#### 4.7.3 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7.4 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人未签订任何有关本基金估值业务的定价服务。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。本基金可供分配利润为-41,890,008.23 元。

本基金本报告期内未进行利润分配。

### 4.8 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

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对信达澳银领先智选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对信达澳银领先智选混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在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

本报告期内，由信达澳银基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60467227\_H34 号

信达澳银领先智选混合型证券投资基金

信达澳银领先智选混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了信达澳银领先智选混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。



我们认为，后附的信达澳银领先智选混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了信达澳银领先智选混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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

## 6.3 其他信息

信达澳银领先智选混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

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

治理层负责监督信达澳银领先智选混合型证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对信达澳银领先智选混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致信达澳银领先智选混合型证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

高 鹤 邓 雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层

2022 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：信达澳银领先智选混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日
资产：		-
银行存款	7.4.7.1	323,119,403.35
结算备付金		12,250,531.20
存出保证金		1,662,946.84
交易性金融资产	7.4.7.2	4,556,818,427.88
其中：股票投资		4,556,818,427.88
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		18,571.55

应收利息	7.4.7.5	49,269.93
应收股利		-
应收申购款		5,647,058.81
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>4,899,566,209.56</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 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		-
应付证券清算款		40,168,566.31
应付赎回款		22,955,066.42
应付管理人报酬		6,125,874.84
应付托管费		1,020,979.16
应付销售服务费		2,041,958.27
应付交易费用	7.4.7.7	5,441,023.41
应交税费		-
应付利息		-

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	160,000.00
<b>负债合计</b>		<b>77,913,468.41</b>
<b>所有者权益：</b>		<b>-</b>
实收基金	7.4.7.9	4,653,199,580.03
未分配利润	7.4.7.10	168,453,161.12
<b>所有者权益合计</b>		<b>4,821,652,741.15</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>4,899,566,209.56</b>

注：1、本财务报表的实际报告期间为 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

2、报告截止日 2021 年 12 月 31 日，信达澳银领先智选混合型证券投资基金份额净值 1.0362 元，基金份额总额 4,653,199,580.03 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>263,631,929.25</b>
1.利息收入		14,677,587.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	14,677,587.48

债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,649,866.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,243,114.84
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	2,406,751.66
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	229,691,923.61
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	612,551.66
<b>减：二、费用</b>		<b>75,754,173.45</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	37,790,389.04
2. 托管费	7.4.10.2	6,298,398.18
3. 销售服务费		12,596,796.33
4. 交易费用	7.4.7.18	18,900,676.85

5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7.4.7.19	167,913.05
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>187,877,755.80</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>187,877,755.80</b>

注：本财务报表的实际报告期间为 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银领先智选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,000,316,912.64	-	5,000,316,912.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	187,877,755.80	187,877,755.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-347,117,332.61	-19,424,594.68	-366,541,927.29
其中：1.基金申购款	1,440,949,391.28	72,493,449.13	1,513,442,840.41



2.基金赎回款	-1,788,066,723.89	-91,918,043.81	-1,879,984,767.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,653,199,580.03	168,453,161.12	4,821,652,741.15

注：注：本财务报表的实际报告期间为 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日，无可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

朱永强

黄晖

刘玉兰

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

信达澳银领先智选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[2021]1797号《关于准予信达澳银领先智选混合型证券投资基金注册的批复》核准，由信达澳银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《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)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 4,999,996,912.71 元，经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2021）验字第 60467227\_H05 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,000,316,912.64 份基金份额，其中认购资

金利息折合 319,999.93 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称为“上海浦东发展银行”）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者投资于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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×90%+中证港股通综合指数收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间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

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。唯本期财务报表的实际编制期间系自 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

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

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

##### (1) 金融资产分类

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

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

##### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 初始确认

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

### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及金融负债采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，如名义利率与实际利率差异较小的，也可采用名义利率进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

### 终止确认

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

### 金融资产转移

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

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

(1) 存在活跃市场的金融工具且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。

(2) 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；

(3) 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；

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

(5) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起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、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(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、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时，申购、转入、红利再投资或赎回、转出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、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认，于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

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

(3) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在实际持有期间内逐日计提；

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

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

(6) 衍生工具收益/(损失)于卖出衍生工具成交日确认，并按卖出衍生工具成交金额与其成本的差额入账；

(7) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(8) 公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(9) 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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配后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；

(4)每一基金份额享有同等分配权；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在法律法规允许的前提下经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。



## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无重大会计差错更正。

## 7.4.6 税项

### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

### 7.4.6.2 增值税及附加、企业所得税

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。金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务、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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。管理人应分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额。未分别核算的，资管产品运营业务不得适用于简易计

税方法。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。

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，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.6.3 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	323,119,403.35
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	323,119,403.35

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,327,126,504.27	4,556,818,427.88	229,691,923.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-

	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,327,126,504.27	4,556,818,427.88	229,691,923.61

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	42,382.83
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	6,063.97
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	823.13
合计	49,269.93

#### 7.4.7.6 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	5,441,023.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	5,441,023.41

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	-
预提费用	160,000.00
合计	160,000.00

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年6月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	5,000,316,912.64	5,000,316,912.64
本期申购	1,440,949,391.28	1,440,949,391.28
本期赎回（以“-”号填列）	-1,788,066,723.89	-1,788,066,723.89
本期末	4,653,199,580.03	4,653,199,580.03

注：1、本期申购中包含转入份额及金额，本期赎回中包含转出份额及金额。

2、本基金自2021年6月21日至2021年6月28日止期间，共募集有效净认购资金4,999,996,912.71元，折合4,999,996,912.71份基金份额。根据《信达澳银领先智选混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入319,999.93元，折算为319,999.93份基金份额，以上实收基金（本息）合计为人民币5,000,316,912.64元，折合5,000,316,912.64份基金份额。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-41,814,167.81	229,691,923.61	187,877,755.80
本期基金份额交易产生的变动数	-75,840.42	-19,348,754.26	-19,424,594.68
其中：基金申购款	-10,465,194.53	82,958,643.66	72,493,449.13
基金赎回款	10,389,354.11	-102,307,397.92	-91,918,043.81
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-41,890,008.23	210,343,169.35	168,453,161.12

**7.4.7.10 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月30日(基金合同生效日)至2021 年12月31日
活期存款利息收入	12,929,482.55
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	1,740,142.13
其他	7,962.80
合计	14,677,587.48

注：其他包括直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

**7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月30日(基金合同生效日)至2021 年12月31日
卖出股票成交总额	5,824,678,112.49
减：卖出股票成本总额	5,808,434,997.65
买卖股票差价收入	16,243,114.84

**7.4.7.12 债券投资收益**

本基金于本期无债券投资收益。

**7.4.7.13 衍生工具收益**

本基金本期无衍生工具收益。

**7.4.7.14 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月30日（基金合同生效日）至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,406,751.66
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	2,406,751.66

**7.4.7.15 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年6月30日（基金合同生效日）至2021 年12月31日
1.交易性金融资产	229,691,923.61
——股票投资	229,691,923.61
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-



3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	229,691,923.61

**7.4.7.16 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	609,511.30
基金转换费收入	3,040.36
合计	612,551.66

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费全额归入基金资产的即为基金赎回费收入。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费全额归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

**7.4.7.17 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021年6月30日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	18,900,676.85
银行间市场交易费用	-
合计	18,900,676.85

**7.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00
信息披露费	60,000.00
证券出借违约金	-
存托服务费	-
银行结算费用	7,913.05
合计	167,913.05

#### 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

本基金的基金管理人于 2022 年 3 月 21 日更名为“信达澳亚基金管理有限公司”。除以上情况外，本基金无其他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
信达澳银基金管理有限公司（“信达澳银基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金托管人
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、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

本基金本期无关联方交易单元进行的交易。

## 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 2021年6月30日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	37,790,389.04
其中：支付销售机构的客户维护费	18,044,004.38

注：支付基金管理人信达澳银基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年6月30日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,298,398.18

注：支付基金托管人上海浦东发展银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

## 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
信达澳银基金公司	20,699.98	
信达证券	809,403.77	
合计	830,103.75	

注：本基金的销售服务费年费率为 0.50%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给信达澳银基金公司，再由信达澳银基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期无与关联方进行转融通证券出借交易。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期基金管理人无运用固有资金投资本基金。

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

本期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 6 月 30 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	323,119,403.35	12,929,482.55

注：本基金的银行存款由基金托管人上海浦东发展银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本期无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**

本基金本期无需要说明的其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本期无利润分配情况。

**7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	新股流通受限	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	新股流通受限	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-

301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	新股流通受限	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	新股流通受限	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	新股流通受限	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	新股流通受限	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301185	鸥玛软	2021-11-11	2022-05-19	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-

301188	件力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	新股流通受限	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
688091	上海谊众	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	38.10	42.81	3,294	125,501.40	141,016.14	-
688622	禾信仪器	2021-09-03	2022-03-14	新股流通受限	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
1234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新股未上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-

注：注：上述流通受限证券的“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终可流通日期以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000780	ST 平能	2021-12-17	重大事项停牌	10.95	-	-	1,211,200	11,582,518.10	13,262,640.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无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，无作为质押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无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。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

### 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

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债、中期票据、可转换债券（含可分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。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将以上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以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定



公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行上海浦东发展银行，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评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本期未持有交易性债券投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	323,119,403.35	-	-	-	323,119,403.35
结算备付金	12,250,531.20	-	-	-	12,250,531.20
存出保证金	1,662,946.84	-	-	-	1,662,946.84
交易性金融资产	-	-	-	4,556,818,427.88	4,556,818,427.88
应收利息	-	-	-	49,269.93	49,269.93
应收申购款	5,318.88	-	-	5,641,739.93	5,647,058.81
应收证券清算款	-	-	-	18,571.55	18,571.55
<b>资产总计</b>	<b>337,038,200.27</b>	-	-	<b>4,562,528,009.29</b>	<b>4,899,566,209.56</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	22,955,066.42	22,955,066.42
应付管理人报酬	-	-	-	6,125,874.84	6,125,874.84
应付托管费	-	-	-	1,020,979.16	1,020,979.16
应付证券清算款	-	-	-	40,168,566.31	40,168,566.31
应付销售服务费	-	-	-	2,041,958.27	2,041,958.27
应付交易费用	-	-	-	5,441,023.41	5,441,023.41
其他负债	-	-	-	160,000.00	160,000.00
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>77,913,468.41</b>	<b>77,913,468.41</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>337,038,200.27</b>	-	-	<b>4,484,614,540.88</b>	<b>4,821,652,741.15</b>

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至本报告期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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。

本基金的股票投资主要采用“自下而上”的策略，通过对上市公司基本面的深入研究，基于对上市公司的业绩质量、成长性与投资价值的权衡，精选成长空间较大的行业，并采用定性和定量相结合的方法，选取具有竞争优势且估值具有吸引力的股票构建组合。

本基金股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%—95%，其中港股通标的股票占股票资产的比例不超过 50%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,556,818,427.88	94.51
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
<b>合计</b>	<b>4,556,818,427.88</b>	<b>94.51</b>

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币万元)
		本期末 2021 年 12 月 31 日
	中证 800 指数上升 5%	21,369.00
	中证 800 指数下降 5%	-21,369.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币 4,542,274,883.57 元，属于第二层次的余额为人民币 14,543,544.31 元，无属于第三层次余额。

本基金持有的第一层次及第二层次金融工具公允价值的估值技术及输入值参见 7.4.4.5

#### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间

及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层次。

#### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金于本报告期初未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金本报告期未发生第三层次公允价值转入转出情况。

#### 7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 7.4.14.3 其他事项

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

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 03 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,556,818,427.88	93.00
	其中：股票	4,556,818,427.88	93.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	335,369,934.55	6.84
8	其他各项资产	7,377,847.13	0.15
9	合计	4,899,566,209.56	100.00

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,590,361.20	0.05
B	采矿业	46,559,003.89	0.97
C	制造业	3,910,849,391.62	81.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	157,044,081.87	3.26
E	建筑业	80,182,170.96	1.66
F	批发和零售业	21,535,519.90	0.45
G	交通运输、仓储和邮政业	44,964,034.80	0.93
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	138,289,502.05	2.87
J	金融业	12,414,288.63	0.26
K	房地产业	29,301,255.00	0.61
L	租赁和商务服务业	5,834,550.72	0.12
M	科学研究和技术服务业	734,305.92	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	19,897,284.59	0.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-



Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	29,491.80	0.00
S	综合	86,570,415.15	1.80
	合计	4,556,818,427.88	94.51

### 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	占基金资产净值比例 (%)
1	603659	璞泰来	1,047,403	168,223,395.83	3.49
2	000063	中兴通讯	3,437,600	115,159,600.00	2.39
3	300679	电连技术	1,752,100	91,985,250.00	1.91
4	002466	天齐锂业	857,811	91,785,777.00	1.90
5	600673	东阳光	9,737,336	86,467,543.68	1.79
6	300035	中科电气	2,469,800	74,711,450.00	1.55
7	300750	宁德时代	121,832	71,637,216.00	1.49
8	300207	欣旺达	1,690,015	71,251,032.40	1.48
9	002460	赣锋锂业	447,209	63,883,805.65	1.32
10	600516	方大炭素	5,777,526	62,512,831.32	1.30
11	002179	中航光电	613,479	61,691,448.24	1.28
12	688772	珠海冠宇	1,258,933	61,247,090.45	1.27
13	300457	赢合科技	1,712,904	52,620,410.88	1.09
14	601877	正泰电器	961,118	51,794,649.02	1.07
15	600210	紫江企业	5,553,814	50,984,012.52	1.06
16	002741	光华科技	2,253,773	47,284,157.54	0.98
17	002876	三利谱	729,600	45,585,408.00	0.95
18	300638	广和通	828,600	45,158,700.00	0.94
19	600703	三安光电	1,124,900	42,251,244.00	0.88
20	688187	时代电气	512,949	42,061,818.00	0.87
21	002664	长鹰信质	2,078,517	41,258,562.45	0.86
22	600741	华域汽车	1,457,201	41,238,788.30	0.86
23	000858	五粮液	175,571	39,092,638.86	0.81

24	603989	艾华集团	933,596	38,650,874.40	0.80
25	002273	水晶光电	2,147,347	37,342,364.33	0.77
26	688595	芯海科技	283,251	35,250,586.95	0.73
27	002635	安洁科技	2,008,600	34,206,458.00	0.71
28	688148	芳源股份	963,384	33,708,806.16	0.70
29	002988	豪美新材	1,627,261	33,537,849.21	0.70
30	603982	泉峰汽车	710,100	33,374,700.00	0.69
31	600519	贵州茅台	15,840	32,472,000.00	0.67
32	600745	闻泰科技	250,846	32,434,387.80	0.67
33	002824	和胜股份	708,700	32,153,719.00	0.67
34	600114	东睦股份	2,657,600	31,226,800.00	0.65
35	002916	深南电路	254,200	30,966,644.00	0.64
36	601919	中远海控	1,583,290	29,591,690.10	0.61
37	603799	华友钴业	267,087	29,462,366.97	0.61
38	300088	长信科技	2,198,600	29,197,408.00	0.61
39	300115	长盈精密	1,468,009	29,125,298.56	0.60
40	300890	翔丰华	468,100	28,942,623.00	0.60
41	000568	泸州老窖	113,466	28,805,613.42	0.60
42	600905	三峡能源	3,827,899	28,747,521.49	0.60
43	002060	粤水电	5,168,872	28,687,239.60	0.59
44	002050	三花智控	1,129,829	28,584,673.70	0.59
45	000422	湖北宜化	1,336,205	28,474,528.55	0.59
46	603383	顶点软件	785,800	28,210,220.00	0.59
47	002705	新宝股份	1,100,500	27,182,350.00	0.56
48	300811	铂科新材	269,020	26,439,285.60	0.55
49	002594	比亚迪	98,067	26,293,724.04	0.55
50	000792	盐湖股份	720,926	25,513,571.14	0.53
51	002101	广东鸿图	2,161,000	25,456,580.00	0.53
52	002463	沪电股份	1,500,107	24,871,774.06	0.52
53	002049	紫光国微	109,578	24,655,050.00	0.51
54	688036	传音控股	156,386	24,536,963.40	0.51
55	300432	富临精工	828,751	24,365,279.40	0.51
56	002436	兴森科技	1,735,866	24,302,124.00	0.50
57	300568	星源材质	658,354	24,181,342.42	0.50
58	600418	江淮汽车	1,347,437	23,445,403.80	0.49
59	002472	双环传动	848,500	23,401,630.00	0.49
60	002706	良信股份	1,238,420	22,068,644.40	0.46
61	002540	亚太科技	2,831,100	21,799,470.00	0.45
62	300114	中航电测	1,225,500	21,666,840.00	0.45
63	002484	江海股份	790,400	21,593,728.00	0.45
64	601985	中国核电	2,555,062	21,207,014.60	0.44
65	600256	广汇能源	3,191,411	20,871,827.94	0.43

66	688390	固德威	44,177	20,302,865.66	0.42
67	002136	安纳达	1,242,846	20,208,675.96	0.42
68	000539	粤电力A	3,183,979	19,581,470.85	0.41
69	688123	聚辰股份	285,042	19,342,950.12	0.40
70	002583	海能达	3,488,470	19,256,354.40	0.40
71	688077	大地熊	244,340	18,860,604.60	0.39
72	002139	拓邦股份	993,074	18,560,553.06	0.38
73	000030	富奥股份	2,370,046	17,585,741.32	0.36
74	300748	金力永磁	390,000	17,507,100.00	0.36
75	002284	亚太股份	1,649,800	17,174,418.00	0.36
76	002459	晶澳科技	184,170	17,072,559.00	0.35
77	001914	招商积余	835,622	16,929,701.72	0.35
78	600728	佳都科技	2,021,508	16,839,161.64	0.35
79	300531	优博讯	811,276	16,574,368.68	0.34
80	603319	湘油泵	641,700	16,504,524.00	0.34
81	300930	屹通新材	499,600	16,207,024.00	0.34
82	688599	天合光能	205,211	16,191,147.90	0.34
83	002918	蒙娜丽莎	555,200	15,895,376.00	0.33
84	601012	隆基股份	183,224	15,793,908.80	0.33
85	688005	容百科技	130,065	15,032,912.70	0.31
86	002957	科瑞技术	587,700	14,945,211.00	0.31
87	002176	江特电机	716,400	14,872,464.00	0.31
88	601800	中国交建	1,717,538	14,736,476.04	0.31
89	002182	云海金属	637,200	14,617,368.00	0.30
90	002475	立讯精密	294,939	14,510,998.80	0.30
91	603626	科森科技	1,199,200	14,498,328.00	0.30
92	600963	岳阳林纸	1,774,800	13,985,424.00	0.29
93	601669	中国电建	1,698,824	13,726,497.92	0.28
94	601868	中国能建	5,025,036	13,718,348.28	0.28
95	300502	新易盛	341,532	13,381,223.76	0.28
96	000780	ST平能	1,211,200	13,262,640.00	0.28
97	601778	晶科科技	1,541,640	13,150,189.20	0.27
98	002745	木林森	855,860	12,949,161.80	0.27
99	688388	嘉元科技	102,046	12,811,875.30	0.27
100	603063	禾望电气	308,397	12,431,483.07	0.26
101	000810	创维数字	1,251,300	12,325,305.00	0.26
102	300611	美力科技	1,091,300	12,309,864.00	0.26
103	603927	中科软	446,220	12,208,579.20	0.25
104	300343	联创股份	709,934	12,083,076.68	0.25
105	600110	诺德股份	751,815	11,991,449.25	0.25
106	002959	小熊电器	187,100	11,950,077.00	0.25
107	003012	东鹏控股	870,300	11,940,516.00	0.25

108	300390	天华超净	144,400	11,696,400.00	0.24
109	300409	道氏技术	477,172	11,571,421.00	0.24
110	002341	新纶新材	2,090,849	11,520,577.99	0.24
111	300870	欧陆通	137,300	11,500,248.00	0.24
112	300919	中伟股份	75,900	11,499,609.00	0.24
113	600600	青岛啤酒	114,500	11,335,500.00	0.24
114	601016	节能风电	1,713,917	11,157,599.67	0.23
115	600933	爱柯迪	570,000	10,989,600.00	0.23
116	002937	兴瑞科技	544,700	10,981,152.00	0.23
117	603348	文灿股份	181,500	10,601,415.00	0.22
118	002236	大华股份	444,717	10,441,955.16	0.22
119	000004	国华网安	534,500	10,379,990.00	0.22
120	000875	吉电股份	1,139,978	10,362,400.02	0.21
121	300450	先导智能	138,800	10,322,556.00	0.21
122	300468	四方精创	507,300	10,242,387.00	0.21
123	002011	盾安环境	744,200	10,195,540.00	0.21
124	600236	桂冠电力	1,582,650	10,160,613.00	0.21
125	002756	永兴材料	66,700	9,872,934.00	0.20
126	000049	德赛电池	167,677	9,778,922.64	0.20
127	300487	蓝晓科技	99,300	9,766,155.00	0.20
128	688499	利元亨	33,239	9,739,027.00	0.20
129	603026	石大胜华	49,062	9,713,785.38	0.20
130	603118	共进股份	1,005,460	9,612,197.60	0.20
131	002196	方正电机	814,300	9,511,024.00	0.20
132	002600	领益智造	1,274,621	9,381,210.56	0.19
133	601615	明阳智能	355,300	9,273,330.00	0.19
134	300745	欣锐科技	142,158	9,126,543.60	0.19
135	002328	新朋股份	1,513,000	9,078,000.00	0.19
136	603713	密尔克卫	67,000	9,030,260.00	0.19
137	688323	瑞华泰	230,686	8,888,331.58	0.18
138	600378	昊华科技	181,032	8,725,742.40	0.18
139	600499	科达制造	345,443	8,573,895.26	0.18
140	600809	山西汾酒	26,946	8,509,007.88	0.18
141	603693	江苏新能	297,898	8,478,177.08	0.18
142	603359	东珠生态	573,900	8,206,770.00	0.17
143	600887	伊利股份	195,460	8,103,771.60	0.17
144	603290	斯达半导	21,227	8,087,487.00	0.17
145	002782	可立克	448,300	8,011,121.00	0.17
146	688536	思瑞浦	10,283	7,897,344.00	0.16
147	300917	特发服务	241,300	7,888,097.00	0.16
148	688519	南亚新材	155,205	7,823,884.05	0.16
149	002008	大族激光	143,900	7,770,600.00	0.16

150	002536	飞龙股份	903,550	7,707,281.50	0.16
151	000762	西藏矿业	144,033	7,652,473.29	0.16
152	603816	顾家家居	97,400	7,515,384.00	0.16
153	300827	上能电气	81,897	7,444,437.30	0.15
154	600885	宏发股份	99,128	7,398,913.92	0.15
155	603105	芯能科技	442,488	7,354,150.56	0.15
156	600702	舍得酒业	32,220	7,323,606.00	0.15
157	688127	蓝特光学	317,632	7,302,359.68	0.15
158	002993	奥海科技	183,940	7,243,557.20	0.15
159	600995	文山电力	364,200	7,236,654.00	0.15
160	300131	英唐智控	888,000	7,228,320.00	0.15
161	600285	羚锐制药	453,800	7,170,040.00	0.15
162	603385	惠达卫浴	645,500	7,165,050.00	0.15
163	002415	海康威视	136,699	7,152,091.68	0.15
164	688711	宏微科技	57,661	7,144,774.51	0.15
165	002091	江苏国泰	519,840	7,137,403.20	0.15
166	002245	蔚蓝锂芯	257,946	7,096,094.46	0.15
167	600098	广州发展	874,100	7,062,728.00	0.15
168	605111	新 洁 能	38,262	6,814,462.20	0.14
169	002138	顺络电子	171,493	6,547,602.74	0.14
170	300661	圣邦股份	21,103	6,520,827.00	0.14
171	600152	维科技术	791,200	6,503,664.00	0.13
172	000519	中兵红箭	242,638	6,471,155.46	0.13
173	601689	拓普集团	121,294	6,428,582.00	0.13
174	000045	深纺织 A	676,000	6,422,000.00	0.13
175	600690	海尔智家	214,561	6,413,228.29	0.13
176	603345	安井食品	37,506	6,405,274.68	0.13
177	603040	新 坐 标	317,100	6,389,565.00	0.13
178	600500	中化国际	745,100	6,378,056.00	0.13
179	002384	东山精密	233,900	6,338,690.00	0.13
180	300604	长川科技	110,121	6,331,957.50	0.13
181	000333	美的集团	85,289	6,295,181.09	0.13
182	603596	伯 特 利	90,400	6,291,840.00	0.13
183	300674	宇信科技	260,213	6,219,090.70	0.13
184	300656	民德电子	116,653	6,200,106.95	0.13
185	300124	汇川技术	85,800	5,885,880.00	0.12
186	002407	多 氟 多	129,770	5,838,352.30	0.12
187	601888	中国中免	26,592	5,834,550.72	0.12
188	688518	联赢激光	117,528	5,790,604.56	0.12
189	000661	长春高新	20,800	5,645,120.00	0.12
190	603166	福达股份	638,900	5,552,041.00	0.12
191	002371	北方华创	15,745	5,463,829.90	0.11

192	002832	比音勒芬	213,900	5,443,755.00	0.11
193	002368	太极股份	197,374	5,435,679.96	0.11
194	603978	深圳新星	194,100	5,322,222.00	0.11
195	601727	上海电气	1,072,079	5,210,303.94	0.11
196	002938	鹏鼎控股	121,500	5,155,245.00	0.11
197	600522	中天科技	298,378	5,060,490.88	0.10
198	600491	龙元建设	728,570	5,019,847.30	0.10
199	002708	光洋股份	719,130	5,019,527.40	0.10
200	688107	安路科技	69,764	5,002,078.80	0.10
201	600361	华联综超	865,600	4,977,200.00	0.10
202	603690	至纯科技	103,308	4,974,280.20	0.10
203	002557	洽洽食品	80,500	4,939,480.00	0.10
204	300480	光力科技	143,445	4,923,032.40	0.10
205	000921	海信家电	324,300	4,913,145.00	0.10
206	601238	广汽集团	321,269	4,880,076.11	0.10
207	603288	海天味业	46,404	4,877,524.44	0.10
208	600460	士兰微	88,878	4,817,187.60	0.10
209	300059	东方财富	129,800	4,816,878.00	0.10
210	300308	中际旭创	113,100	4,806,750.00	0.10
211	002851	麦格米特	149,666	4,792,305.32	0.10
212	603138	海量数据	301,192	4,785,940.88	0.10
213	600216	浙江医药	279,300	4,770,444.00	0.10
214	000408	藏格矿业	116,186	4,763,626.00	0.10
215	002488	金固股份	542,000	4,758,760.00	0.10
216	601222	林洋能源	390,700	4,739,191.00	0.10
217	000883	湖北能源	896,752	4,698,980.48	0.10
218	002068	黑猫股份	446,073	4,683,766.50	0.10
219	600237	铜峰电子	495,000	4,677,750.00	0.10
220	000591	太阳能	414,034	4,637,180.80	0.10
221	600038	中直股份	57,709	4,634,032.70	0.10
222	000799	酒鬼酒	21,700	4,611,250.00	0.10
223	600660	福耀玻璃	97,400	4,591,436.00	0.10
224	300037	新宙邦	39,753	4,492,089.00	0.09
225	603899	晨光文具	68,000	4,386,680.00	0.09
226	300659	中孚信息	96,700	4,385,345.00	0.09
227	002884	凌霄泵业	154,996	4,335,238.12	0.09
228	300660	江苏雷利	146,500	4,292,450.00	0.09
229	300428	立中集团	158,862	4,178,070.60	0.09
230	600562	国睿科技	227,300	4,177,774.00	0.09
231	600309	万华化学	41,339	4,175,239.00	0.09
232	600111	北方稀土	90,311	4,136,243.80	0.09
233	002063	远光软件	415,800	4,133,052.00	0.09

234	688678	福立旺	125,359	4,110,521.61	0.09
235	600406	国电南瑞	101,300	4,055,039.00	0.08
236	300433	蓝思科技	169,200	3,888,216.00	0.08
237	300614	百川畅银	80,627	3,870,096.00	0.08
238	600366	宁波韵升	291,700	3,853,357.00	0.08
239	300775	三角防务	77,027	3,765,850.03	0.08
240	688200	华峰测控	7,046	3,606,847.40	0.07
241	002025	航天电器	42,200	3,542,690.00	0.07
242	002922	伊戈尔	173,153	3,516,737.43	0.07
243	689009	九号公司	50,124	3,512,188.68	0.07
244	002497	雅化集团	121,859	3,492,478.94	0.07
245	688368	晶丰明源	10,822	3,464,122.20	0.07
246	688080	映翰通	38,696	3,393,639.20	0.07
247	600776	东方通信	292,100	3,362,071.00	0.07
248	600577	精达股份	449,488	3,344,190.72	0.07
249	002352	顺丰控股	48,500	3,342,620.00	0.07
250	603020	爱普股份	234,832	3,339,311.04	0.07
251	300319	麦捷科技	216,654	3,314,806.20	0.07
252	300408	三环集团	73,100	3,260,260.00	0.07
253	002240	盛新锂能	55,935	3,241,433.25	0.07
254	002085	万丰奥威	590,200	3,240,198.00	0.07
255	688025	杰普特	41,711	3,213,832.55	0.07
256	600085	同仁堂	70,700	3,180,086.00	0.07
257	600970	中材国际	274,620	3,138,906.60	0.07
258	688800	瑞可达	22,452	3,127,114.56	0.06
259	002036	联创电子	124,200	3,013,092.00	0.06
260	603305	旭升股份	60,000	2,992,800.00	0.06
261	603588	高能环境	169,583	2,979,573.31	0.06
262	300274	阳光电源	19,424	2,832,019.20	0.06
263	300438	鹏辉能源	59,500	2,810,780.00	0.06
264	002507	涪陵榨菜	72,800	2,751,840.00	0.06
265	300671	富满微	33,900	2,747,595.00	0.06
266	000559	万向钱潮	431,100	2,746,107.00	0.06
267	002266	浙富控股	383,422	2,729,964.64	0.06
268	688008	澜起科技	31,666	2,655,827.42	0.06
269	300505	川金诺	85,027	2,605,227.28	0.05
270	002714	牧原股份	48,545	2,590,361.20	0.05
271	002212	天融信	133,200	2,553,444.00	0.05
272	002241	歌尔股份	46,209	2,499,906.90	0.05
273	603612	索通发展	121,106	2,485,095.12	0.05
274	002142	宁波银行	63,372	2,425,880.16	0.05
275	600036	招商银行	49,382	2,405,397.22	0.05

276	000938	紫光股份	105,227	2,404,436.95	0.05
277	688210	统联精密	57,914	2,401,114.44	0.05
278	603938	三孚股份	65,100	2,395,029.00	0.05
279	300623	捷捷微电	75,958	2,389,638.68	0.05
280	002805	丰元股份	74,554	2,352,178.70	0.05
281	002080	中材科技	68,909	2,344,284.18	0.05
282	603893	瑞芯微	17,100	2,340,990.00	0.05
283	300693	盛弘股份	63,100	2,315,139.00	0.05
284	688408	中信博	12,919	2,280,332.69	0.05
285	600585	海螺水泥	56,300	2,268,890.00	0.05
286	600141	兴发集团	59,700	2,261,436.00	0.05
287	000596	古井贡酒	9,200	2,244,800.00	0.05
288	600297	广汇汽车	799,300	2,134,131.00	0.04
289	688396	华润微	32,708	2,112,936.80	0.04
290	002405	四维图新	132,700	2,112,584.00	0.04
291	000400	许继电气	80,029	2,088,756.90	0.04
292	603897	长城科技	41,900	2,088,296.00	0.04
293	603179	新泉股份	47,500	2,055,800.00	0.04
294	600487	亨通光电	134,500	2,033,640.00	0.04
295	300014	亿纬锂能	16,982	2,006,932.76	0.04
296	688128	中国电研	67,602	1,998,315.12	0.04
297	002335	科华数据	54,854	1,994,491.44	0.04
298	688608	恒玄科技	6,489	1,979,145.00	0.04
299	002312	川发龙蟒	151,183	1,977,473.64	0.04
300	001979	招商蛇口	147,402	1,966,342.68	0.04
301	600011	华能国际	202,036	1,957,728.84	0.04
302	002897	意华股份	34,400	1,947,384.00	0.04
303	603936	博敏电子	112,600	1,936,720.00	0.04
304	300699	光威复材	22,800	1,926,144.00	0.04
305	688122	西部超导	19,474	1,887,809.56	0.04
306	603283	赛腾股份	63,487	1,866,517.80	0.04
307	600850	电科数字	53,900	1,839,607.00	0.04
308	002192	融捷股份	14,060	1,829,909.00	0.04
309	300866	安克创新	17,100	1,752,750.00	0.04
310	603505	金石资源	47,416	1,717,881.68	0.04
311	601633	长城汽车	35,350	1,715,889.00	0.04
312	002434	万里扬	114,800	1,692,152.00	0.04
313	300351	永贵电器	113,800	1,688,792.00	0.04
314	600023	浙能电力	401,653	1,622,678.12	0.03
315	002271	东方雨虹	30,600	1,612,008.00	0.03
316	002326	永太科技	30,014	1,537,016.94	0.03
317	600048	保利发展	97,222	1,519,579.86	0.03



318	000876	新希望	99,700	1,516,437.00	0.03
319	688793	倍轻松	14,467	1,511,801.50	0.03
320	603606	东方电缆	28,500	1,458,060.00	0.03
321	300211	亿通科技	113,400	1,451,520.00	0.03
322	300729	乐歌股份	49,200	1,446,480.00	0.03
323	002895	川恒股份	58,309	1,439,649.21	0.03
324	003022	联泓新科	38,963	1,419,811.72	0.03
325	000777	中核科技	89,500	1,406,940.00	0.03
326	600674	川投能源	112,000	1,400,000.00	0.03
327	002649	博彦科技	119,000	1,389,920.00	0.03
328	000027	深圳能源	170,653	1,382,289.30	0.03
329	600990	四创电子	24,500	1,376,165.00	0.03
330	300474	景嘉微	8,974	1,365,842.80	0.03
331	603918	金桥信息	149,200	1,359,212.00	0.03
332	300763	锦浪科技	5,805	1,344,147.75	0.03
333	002906	华阳集团	24,340	1,337,726.40	0.03
334	600619	海立股份	159,800	1,299,174.00	0.03
335	603501	韦尔股份	4,055	1,260,172.35	0.03
336	600367	红星发展	66,830	1,241,701.40	0.03
337	603109	神驰机电	43,426	1,238,075.26	0.03
338	300473	德尔股份	53,300	1,234,428.00	0.03
339	002074	国轩高科	23,986	1,229,282.50	0.03
340	603078	江化微	45,086	1,198,385.88	0.02
341	300709	精研科技	19,649	1,177,957.55	0.02
342	300365	恒华科技	108,800	1,169,600.00	0.02
343	002180	纳思达	24,400	1,165,344.00	0.02
344	002920	德赛西威	8,215	1,162,504.65	0.02
345	600872	中炬高新	30,500	1,158,085.00	0.02
346	000821	京山轻机	83,500	1,151,465.00	0.02
347	002752	昇兴股份	170,200	1,148,850.00	0.02
348	300648	星云股份	18,718	1,126,636.42	0.02
349	600438	通威股份	24,700	1,110,512.00	0.02
350	600170	上海建工	306,000	1,101,600.00	0.02
351	301067	显盈科技	22,300	1,091,362.00	0.02
352	600893	航发动力	17,157	1,088,783.22	0.02
353	600875	东方电气	50,800	1,088,136.00	0.02
354	600477	杭萧钢构	262,954	1,086,000.02	0.02
355	688023	安恒信息	4,329	1,085,453.46	0.02
356	002043	兔宝宝	89,400	1,079,952.00	0.02
357	002135	东南网架	93,084	1,076,051.04	0.02
358	688359	三孚新科	18,128	1,063,388.48	0.02
359	600025	华能水电	160,898	1,060,317.82	0.02

360	688598	金博股份	2,940	1,043,817.60	0.02
361	601111	中国国航	110,700	1,010,691.00	0.02
362	000831	五矿稀土	25,900	1,010,618.00	0.02
363	600199	金种子酒	59,066	998,806.06	0.02
364	300655	晶瑞电材	23,900	998,542.00	0.02
365	600029	南方航空	146,400	996,984.00	0.02
366	600536	中国软件	19,402	968,741.86	0.02
367	002386	天原股份	76,010	967,607.30	0.02
368	600150	中国船舶	38,869	963,562.51	0.02
369	002986	宇新股份	25,786	927,780.28	0.02
370	688521	芯原股份	11,588	896,447.68	0.02
371	300598	诚迈科技	13,779	881,718.21	0.02
372	002149	西部材料	47,551	880,644.52	0.02
373	300369	绿盟科技	55,300	877,058.00	0.02
374	300034	钢研高纳	15,200	875,520.00	0.02
375	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.02
376	688385	复旦微电	17,130	862,324.20	0.02
377	600884	杉杉股份	25,935	849,889.95	0.02
378	002533	金杯电工	95,600	823,116.00	0.02
379	002191	劲嘉股份	52,606	795,928.78	0.02
380	300593	新雷能	13,900	755,882.00	0.02
381	601177	杭齿前进	83,092	748,658.92	0.02
382	603663	三祥新材	26,700	740,925.00	0.02
383	605399	晨光新材	18,546	736,461.66	0.02
384	300379	东方通	24,574	725,670.22	0.02
385	300097	智云股份	84,765	717,959.55	0.01
386	601226	华电重工	104,576	709,025.28	0.01
387	603568	伟明环保	18,160	663,384.80	0.01
388	002439	启明星辰	23,000	656,190.00	0.01
389	600096	云天化	32,500	637,650.00	0.01
390	688110	东芯股份	14,044	634,507.92	0.01
391	600021	上海电力	48,862	626,410.84	0.01
392	000915	华特达因	20,073	611,423.58	0.01
393	002738	中矿资源	8,315	585,043.40	0.01
394	002039	黔源电力	27,367	576,896.36	0.01
395	000776	广发证券	23,281	572,479.79	0.01
396	600312	平高电气	62,259	565,934.31	0.01
397	300041	回天新材	30,214	560,167.56	0.01
398	300112	万讯自控	39,527	558,121.24	0.01
399	601688	华泰证券	31,239	554,804.64	0.01
400	000731	四川美丰	52,829	548,365.02	0.01
401	600496	精工钢构	125,815	535,971.90	0.01

402	000002	万 科 A	26,923	531,998.48	0.01
403	600795	国电电力	166,664	528,324.88	0.01
404	002743	富煌钢构	72,909	522,028.44	0.01
405	000958	东方能源	100,655	513,340.50	0.01
406	300459	汤 姆 猫	92,000	510,600.00	0.01
407	601006	大秦铁路	79,398	508,147.20	0.01
408	300236	上海新阳	12,381	505,763.85	0.01
409	300046	台基股份	21,336	496,488.72	0.01
410	601127	小康股份	8,303	494,443.65	0.01
411	601827	三峰环境	55,339	493,623.88	0.01
412	601179	中国西电	88,925	493,533.75	0.01
413	002129	中环股份	11,750	490,562.50	0.01
414	002125	湘潭电化	43,019	490,416.60	0.01
415	002034	旺能环境	28,203	487,065.81	0.01
416	601377	兴业证券	49,266	486,748.08	0.01
417	300852	四会富仕	8,300	484,886.00	0.01
418	601000	唐 山 港	175,870	483,642.50	0.01
419	600104	上汽集团	23,398	482,700.74	0.01
420	600426	华鲁恒升	15,399	481,988.70	0.01
421	000630	铜陵有色	138,484	481,924.32	0.01
422	300082	奥克股份	31,066	479,969.70	0.01
423	002885	京 泉 华	18,308	477,472.64	0.01
424	000911	南宁糖业	44,492	476,064.40	0.01
425	300619	金 银 河	5,449	474,989.33	0.01
426	600800	渤海化学	99,500	470,635.00	0.01
427	002759	天际股份	16,046	470,147.80	0.01
428	000625	长安汽车	30,935	469,902.65	0.01
429	301011	华立科技	7,800	469,560.00	0.01
430	600316	洪都航空	12,016	469,344.96	0.01
431	600821	金开新能	49,306	467,913.94	0.01
432	600323	瀚蓝环境	21,986	461,266.28	0.01
433	600744	华银电力	78,630	459,985.50	0.01
434	600760	中航沈飞	6,701	455,936.04	0.01
435	600392	盛和资源	23,227	455,713.74	0.01
436	000968	蓝焰控股	47,943	448,267.05	0.01
437	603993	洛阳钼业	78,523	438,158.34	0.01
438	601600	中国铝业	69,496	423,230.64	0.01
439	600171	上海贝岭	16,457	422,286.62	0.01
440	688779	长远锂科	17,905	419,693.20	0.01
441	601838	成都银行	34,500	414,000.00	0.01
442	002092	中泰化学	41,059	391,702.86	0.01
443	605117	德业股份	1,400	383,306.00	0.01

444	002487	大金重工	9,500	368,125.00	0.01
445	300965	恒宇信通	5,200	357,032.00	0.01
446	600765	中航重机	5,203	262,699.47	0.01
447	002579	中京电子	24,824	255,687.20	0.01
448	600282	南钢股份	68,759	254,408.30	0.01
449	600773	西藏城投	8,951	252,955.26	0.01
450	601011	宝泰隆	47,378	250,629.62	0.01
451	002268	卫士通	4,424	247,478.56	0.01
452	600019	宝钢股份	34,042	243,740.72	0.01
453	600160	巨化股份	18,842	243,250.22	0.01
454	002110	三钢闽光	35,434	240,951.20	0.00
455	600711	盛屯矿业	22,368	240,008.64	0.00
456	002866	传艺科技	19,045	239,205.20	0.00
457	600863	内蒙华电	60,477	238,279.38	0.00
458	000932	华菱钢铁	45,453	232,264.83	0.00
459	603429	集友股份	8,816	230,097.60	0.00
460	600063	皖维高新	37,221	228,164.73	0.00
461	002132	恒星科技	36,938	225,691.18	0.00
462	600926	杭州银行	17,532	224,760.24	0.00
463	688560	明冠新材	6,381	220,718.79	0.00
464	600782	新钢股份	41,069	216,844.32	0.00
465	600581	八一钢铁	34,234	212,593.14	0.00
466	002968	新大正	6,000	212,580.00	0.00
467	002518	科士达	8,428	211,542.80	0.00
468	600596	新安股份	8,350	208,666.50	0.00
469	000962	东方钽业	16,450	193,945.50	0.00
470	600027	华电国际	35,923	192,188.05	0.00
471	688091	上海谊众	3,294	141,016.14	0.00
472	688233	神工股份	1,430	126,126.00	0.00
473	002493	荣盛石化	5,761	104,619.76	0.00
474	000009	中国宝安	7,129	102,871.47	0.00
475	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.00
476	603986	兆易创新	339	59,613.15	0.00
477	688733	壹石通	683	54,476.08	0.00
478	000629	攀钢钒钛	13,497	52,503.33	0.00
479	000155	川能动力	1,905	50,539.65	0.00
480	601857	中国石油	10,117	49,674.47	0.00
481	601618	中国中冶	12,674	48,541.42	0.00
482	600497	驰宏锌锗	9,652	48,163.48	0.00
483	002396	星网锐捷	2,042	48,129.94	0.00
484	300657	弘信电子	2,861	47,235.11	0.00
485	300741	华宝股份	984	47,084.40	0.00

486	601678	滨化股份	5,899	47,015.03	0.00
487	002119	康强电子	3,229	46,562.18	0.00
488	688029	南微医学	217	46,149.39	0.00
489	688981	中芯国际	862	45,677.38	0.00
490	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
491	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
492	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
493	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
494	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
495	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
496	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
497	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
498	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
499	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
500	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
501	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
502	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
503	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
504	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
505	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
506	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
507	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
508	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
509	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
510	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
511	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
512	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
513	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	359,327,993.81	7.45
2	002594	比亚迪	236,110,769.08	4.90
3	300750	宁德时代	196,897,525.58	4.08
4	603659	璞泰来	190,360,292.51	3.95
5	603993	洛阳钼业	166,749,862.95	3.46

6	002460	赣锋锂业	159,980,824.12	3.32
7	300457	赢合科技	141,749,757.26	2.94
8	300207	欣旺达	134,058,257.29	2.78
9	600516	方大炭素	126,155,968.62	2.62
10	000063	中兴通讯	113,475,361.43	2.35
11	603799	华友钴业	109,526,837.80	2.27
12	601669	中国电建	100,012,162.00	2.07
13	600519	贵州茅台	99,377,062.32	2.06
14	000858	五粮液	98,669,126.89	2.05
15	002407	多氟多	98,290,489.88	2.04
16	601618	中国中冶	95,809,605.01	1.99
17	600905	三峡能源	93,774,089.69	1.94
18	000630	铜陵有色	89,912,658.11	1.86
19	601012	隆基股份	89,530,811.78	1.86
20	600673	东阳光	89,339,034.65	1.85

## 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002466	天齐锂业	259,412,294.49	5.38
2	002594	比亚迪	218,976,448.92	4.54
3	603993	洛阳钼业	149,666,927.98	3.10
4	300750	宁德时代	131,289,448.08	2.72
5	601669	中国电建	123,236,923.11	2.56
6	601618	中国中冶	98,303,276.46	2.04
7	000630	铜陵有色	92,988,545.20	1.93
8	300457	赢合科技	90,107,262.73	1.87
9	002407	多氟多	88,686,959.97	1.84
10	002460	赣锋锂业	81,448,277.32	1.69
11	601985	中国核电	77,029,312.31	1.60
12	600905	三峡能源	71,920,448.72	1.49
13	601012	隆基股份	69,875,391.52	1.45
14	600519	贵州茅台	69,846,530.75	1.45
15	688499	利元亨	68,379,623.20	1.42
16	688390	固德威	68,181,853.27	1.41
17	300207	欣旺达	66,515,427.94	1.38
18	600711	盛屯矿业	64,119,337.91	1.33
19	600516	方大炭素	63,646,033.30	1.32
20	603799	华友钴业	59,370,888.13	1.23

**8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额**

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,135,561,501.92
卖出股票的收入（成交）总额	5,824,678,112.49

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金未参与投资股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未参与投资国债期货。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有投资国债期货。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

### 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	1,662,946.84
2	应收证券清算款	18,571.55
3	应收股利	-
4	应收利息	49,269.93
5	应收申购款	5,647,058.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,377,847.13



#### 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未存在流通受限情况

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
538,325	8,643.85	34,853,025.03	0.75%	4,618,346,555.00	99.25%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,463,495.27	0.03%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基	>100

金	
---	--

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年6月30日)基金份额总额	5,000,316,912.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,440,949,391.28
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,788,066,723.89
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,653,199,580.03

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

### 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，本基金管理人经第五届董事会第十九次会议决定，自 2021 年 3 月 29 日起，王建华先生担任公司副总经理，分管固定收益部（后更名为混合资产投资部）。

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第二十八次会议决定，自 2021 年 6 月 18 日起，冯明远先生担任公司副总经理，分管权益投资业务以及投资管理部。

本报告期内，本基金管理人经第五届董事会第三十五次会议决定，自 2021 年 11 月 9 日起，魏庆孔先生担任公司副总经理，市场销售部、机构销售部、互联网金融部。

本报告期内，本基金管理人经 2021 年第八次股东会决议，自 2021 年 11 月 5 日起，李泉先生担任公司董事，宋若冰先生、杨棉之先生和屈文洲先生担任公司独立董事，Ken

Okamoto 先生担任公司执行监事；刘怡海先生、张宏先生、刘颂兴先生不再担任公司独立董事。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 10 万元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	8,612,490,886.24	54.06%	6,298,323.40	54.06%	-
金元证券	2	5,219,077,983.36	32.76%	3,816,806.92	32.76%	-
平安证券	2	1,796,467,221.85	11.28%	1,313,758.52	11.28%	-
东亚前海证券	1	189,331,917.66	1.19%	138,459.42	1.19%	-
国联证券	2	113,186,281.87	0.71%	82,771.83	0.71%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后 20 个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

### 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	信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金份额发售公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-07
2	信达澳银领先智选混合型证券投资基金托管协议	证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-07
3	信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同	证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-07
4	信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金产品资料概要	证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-07
5	信达澳银领先智选混合型证券投资基金招募说明书	证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-07
6	信达澳银基金管理有限公司关于信达澳银领先智选混合型证券投资基金调整募集规模上限的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-18
7	信达澳银领先智选混合型证券投资基金提前结束募集的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-26
8	信达澳银基金管理有限公司关于对信达澳银领先智选混合型基金认购申请进行比例确认的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披	2021-06-29

		露网站、公司网站	
9	信达澳银领先智选混合型证券投资基金认购申请确认比例结果的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-30
10	信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-07-01
11	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金调整认购费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-08-02
12	信达澳银基金管理有限公司关于部分业务暂停服务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-09-10
13	信达澳银基金管理有限公司关于恢复网上直销货币基金快速赎回的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-09-10
14	信达澳银领先智选混合型证券投资基金开放申购、赎回、转换及定投业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-09-24
15	信达澳银基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-13
16	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-15
17	信达澳银领先智选混合型证券投资基金 2021 年第	证监会信息披	2021-10-26

	三季度报告	露网站、公司网站	
18	信达澳银基金管理有限公司关于董事及独立董事变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-11-06
19	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-11-10
20	信达澳银基金管理有限公司关于开通网上直销汇款交易业务并实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-11-25
21	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有“江特电机”股票估值价格调整的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-12-10

## §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

报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信达澳银领先智选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银领先智选混合型证券投资基金托管协议》；

- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：[www.fscinda.com](http://www.fscinda.com)

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二二年三月二十九日