

# 信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资 基金

**2021 年年度报告**

**2021 年 12 月 31 日**

基金管理人：信达澳银基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	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> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	17
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 .....	17
<b>§5 托管人报告</b> .....	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
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 .....	17
<b>§6 审计报告</b> .....	17
<b>§7 年度财务报表</b> .....	21
7.1 资产负债表 .....	21
7.2 利润表 .....	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	25
7.4 报表附注 .....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	59
8.1 期末基金资产组合情况 .....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
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 .....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	63
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	77
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 .....	78

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	78
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	78
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	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
<b>§9 基金份额持有人信息</b>	<b>81</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
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	81
<b>§10 开放式基金份额变动</b>	<b>82</b>
<b>§11 重大事件揭示</b>	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
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	83
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	84
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>88</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	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
<b>§13 备查文件目录</b>	<b>89</b>
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	信达澳银新财富混合
基金主代码	003655
交易代码	003655
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 10 日
基金管理人	信达澳银基金管理有限公司
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	690,592,135.55 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，通过对不同类别资产的优化配置，严选安全边际较高的股票、债券等进行投资，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取自上而下和自下而上相结合的积极主动的投资策略，并对投资组合进行动态调整。本基金投资策略主要包括资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、中小企业私募债投资策略、权证投资策略、股指期货投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中预期风险与预期收益中等的投资品种，其风险收益水平高于货币基金和债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳银基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	张燕
	联系电话	0755-83172666	0755-83199084
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-8888-118	95555
传真		0755-83196151	0755-83195201
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518054	518040
法定代表人		朱永强	缪建民

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	《中国证券报》
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	2020 年	2019 年
本期已实现收益	35,984,240.53	75,773,196.52	10,902,704.40
本期利润	60,458,491.15	55,596,263.37	65,501,361.05
加权平均基金份额本期利润	0.2075	0.3475	0.4318
本期加权平均净值利润率	12.57%	26.26%	41.96%
本期基金份额净值增长率	11.35%	35.14%	54.73%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	495,181,043.80	16,149,307.14	854,797.82
期末可供分配基金份额利润	0.7170	0.5423	0.0056
期末基金资产净值	1,185,773,179.35	45,926,606.57	173,796,602.02
期末基金份额净值	1.717	1.542	1.141

3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	123.06%	100.33%	48.23%

注：1、本基金基金合同于 2016 年 11 月 10 日生效，2017 年 2 月 10 日开始办理申购、赎回业务。

2、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的认购、申购及赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。4.期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 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	4.38%	0.39%	1.32%	0.40%	3.06%	-0.01%
过去六个月	7.72%	0.43%	-1.38%	0.51%	9.10%	-0.08%
过去一年	11.35%	0.37%	-0.18%	0.59%	11.53%	-0.22%
过去三年	132.85%	1.00%	38.14%	0.64%	94.71%	0.36%
过去五年	126.92%	0.99%	36.78%	0.60%	90.14%	0.39%
自基金合同生效起至今	123.06%	0.98%	35.49%	0.59%	87.57%	0.39%

#### 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

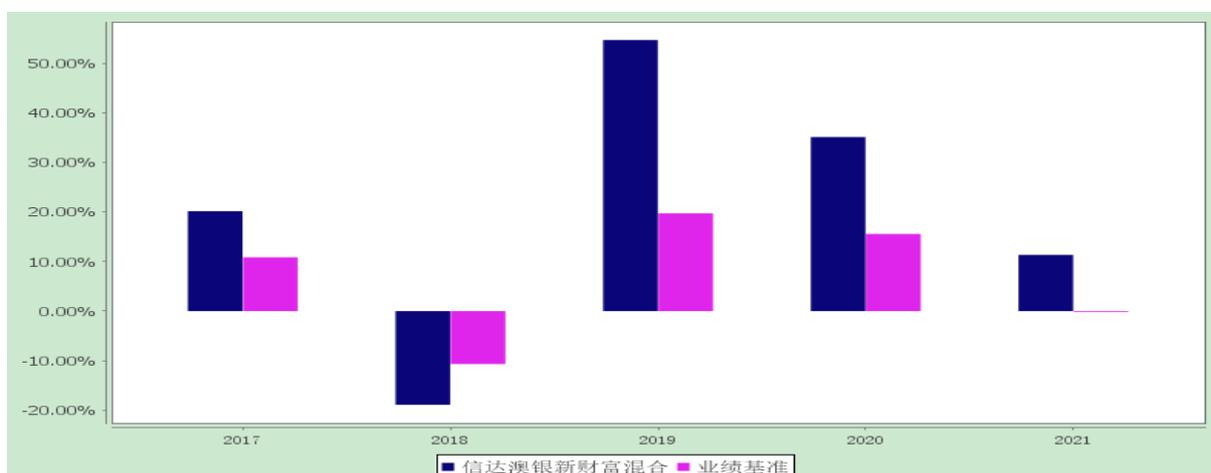
信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 11 月 10 日至 2021 年 12 月 31 日)



### 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

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2016 年 11 月 10 日生效，因此 2016 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	-
2020	-	-	-	-	-
2019	0.947	14,465,277.94	176,086.13	14,641,364.07	-
合计	0.947	14,465,277.94	176,086.13	14,641,364.07	-

## §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		
王建华	本基金的基金经理，公司副总经理	2021-05-20	-	12.5 年	复旦大学产业经济学硕士。2012 年至 2015 年历任交通银行苏州分行投资银行部副总经理、总经理；2015 年至 2019 年任交通银行资管业务中心结构融资部、资本市场部总经理；2019 年至 2020 年任交通银行理财有限责任公司权益投资部、研究部总经理；2021 年 2 月加入信达澳银基金管理有限公司，任副总经理，分管固定收益部，任信达澳银新财富混合型基金经理（2021 年 5 月 20 日起至今）。
王辉良	本基金的基金经理	2021-01-22	2021-12-21	14 年	中国人民大学金融学硕士。2006 年 7 月至 2010 年 8 月在招商基金管理有限公司，任策略研究员；2010 年 8 月至 2012 年 4 月在华宝兴业基金管理有限公司，任高级分析师；2013 年 1 月加入信达澳银基金公司，历任高级策略研究员、信达澳银中小盘混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理助理、信达澳银红利回报混合基金基金经理（2016 年 1 月 8 日起至 2020 年 7 月 26 日）、信达澳银中证沪港深高股息精选指数基金基金经理（2018 年 11 月 2 日起至 2021 年 12 月 21 日）、信达澳银新征程混合基金基金经理（2021 年 1 月 22 日起至 2021 年 12 月 14 日）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2021 年 1 月 22

					日起至 2021 年 12 月 21 日)。
杨超	本基金的基金经理	2019-10-29	2021-01-22	9 年	复旦大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2015 年 7 月担任中泰证券有限公司研究员。2015 年 9 月加入信达澳银基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、基金经理。任信达澳银新目标混合型基金经理（2019 年 10 月 24 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信达澳银新征程混合基金基金经理（2019 年 10 月 24 日起至 2021 年 1 月 22 日）、信达澳银新财富混合基金基金经理（2019 年 10 月 29 日起至 2021 年 1 月 22 日）、信达澳银信用债债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日、信达澳银鑫安债券基金（LOF）基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信达澳银安益纯债债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信达澳银慧管家货币基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信达澳银慧理财货币基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）、信达澳银稳定价值债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2021 年 12 月 13 日）、信达澳银安盛纯债债券基金基金经理（2021 年 2 月 3 日起至 2022 年 1 月 7 日）。

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。3、本基金管理人

于 2022 年 1 月 5 日发布公告,2022 年 1 月 5 日起聘任李丛文先生为本基金基金经理。4、本基金管理人于 2022 年 1 月 7 日发布公告,自 2022 年 1 月 7 日起杨超先生不再担任本基金基金经理。

#### 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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,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,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,没有发生损害基金持有人利益的行为。

#### 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同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。

##### 4.3.2 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同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。

#### 4.3.3 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。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，宏观方面，受疫情影响供应链紧张，全球大宗商品价格上涨，通胀压力下，美联储加息缩表进程节奏加快，国内经济基本面呈现出前高后低的态势，地产行业去杠杆，消费受疫情影响萎靡，出口维持较高景气。流动性层面，央行货币政策前紧后松，年中实施降准，市场流动性较好。股市方面，主要指数全年波动较大，能源改革贯穿全年，引领股市的主要结构方向，其中新能源汽车、光伏等行业表现最好，煤炭、电力等周期行业同样表现不弱，疫情影响叠加 2020 年的高基数，消费行业整体持续偏弱。利率方面，经济下行，流动性较好，利率先上后下。信用层面，行业分化较大，地产去杠杆导致地产行业信用利差扩大，煤炭、钢铁等行业基本面改善，信用利差缩小，资质上，高等级国企信用利差压缩较多。转债层面，得益于利率下行、股市风险偏好提升，全年走出单边大牛市行情，估值层面得到极大提升，市场赚钱效应明显。

报告期内，本基金股票配置风格价值为主兼顾成长，根据市场情况适度调整整体组合估值，行业分散，避免单一行业风险暴露过大。全年股票仓位维持在 25%-30% 左右，整体持仓较为均衡，行业层面，主要配置新能源、光伏、电力等，低配消费、医药等行业。转债层面，全年仓位维持在 30% 左右，对估值容忍度较高，主要选择股性较强的标

的和部分有债底保护安全性标的。纯债方面，仓位保持在 30%-35% 左右，组合维持偏长久期，资质上主要以高等级信用债为主。

#### 4.4.2 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 1.717 元，份额累计净值为 2.008 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 11.35%，同期业绩比较基准收益率为-0.18%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，国内经济基本面有下行压力，全球货币政策逐渐收紧，内部流动性预计保持中性，财政支出增加，政府政策整体更加偏向于稳增长。2022 年权益市场方面，相对看好以下机会：1、宽信用直接收益的基建和地产方向，其中既包括以新能源发电资产以及配电侧的改造代表的新基建方向，也包括地产行业强烈去杠杆之后，基本面存在较大的改善预期空间的建材、家居等地产链条行业。2、2022 年共同富裕也会进一步凸显国企央企改革的重要性，作为国之重器，军工、电子、通信等技术密集型的央企存在较大机会，高度重视卫星、地图等商业化的应用。3、新能源汽车行业电动化经过 21-22 年已经处于估值消化期，而智能化才是未来的长坡厚雪，激光雷达、人机交互等都是 22 年重点方向。4、元宇宙是元年的开始，虽然现在主题是主题，未来一到两年会进入爆发期，关注海外和国内巨头的动向所带来的产业的重大变革机会。债券市场方面，随着国内政策重心逐渐从宽货币为主过度到宽信用为主，纯债主要采取票息策略，以高评级、短久期为主，获取确定性底层受益，适度通过久期管理操作增厚组合收益。转债市场估值处于历史高位，仓位适度偏防守，主要选择接近债底，临近回售/到期，正股无信用风险的高赔率标的，获取未来期权价值。

#### 4.6 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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.7 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，由分管基金运营的高级管理人员担任；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、基金运营部及监察稽核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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为 495,181,043.80 元。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。

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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

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

安永华明（2022）审字第 60467227\_H17 号

信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金

信达澳银新财富灵活配置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新财富灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的信达澳银新财富灵活配置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新财富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。

## 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新财富灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

信达澳银新财富灵活配置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新财富灵活配置混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、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新财富灵活配置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新财富灵活配置混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如

果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。

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

我们与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：信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	5,630,851.25	1,814,859.18
结算备付金		5,941,925.38	3,176,114.41
存出保证金		202,394.59	76,294.11
交易性金融资产	7.4.7.2	1,168,193,394.11	40,662,557.12
其中：股票投资		292,767,269.42	9,150,821.92
基金投资		-	-
债券投资		875,426,124.69	31,511,735.20
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		3,551,782.33	-

应收利息	7.4.7.5	8,464,944.47	570,890.24
应收股利		-	-
应收申购款		19,438.06	141.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>1,192,004,730.19</b>	<b>46,300,856.06</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>上年度末 2020 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		3,806,570.82	-
应付赎回款		24,620.26	1,797.22
应付管理人报酬		673,868.30	26,932.30
应付托管费		96,266.92	3,847.48
应付销售服务费		192,533.79	7,694.94
应付交易费用	7.4.7.7	1,224,140.97	164,795.33
应交税费		24,249.78	182.22
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	189,300.00	169,000.00
<b>负债合计</b>		<b>6,231,550.84</b>	<b>374,249.49</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	690,592,135.55	29,777,299.43
未分配利润	7.4.7.10	495,181,043.80	16,149,307.14
<b>所有者权益合计</b>		<b>1,185,773,179.35</b>	<b>45,926,606.57</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>1,192,004,730.19</b>	<b>46,300,856.06</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金份额净值 1.717 元，基金份额总额 690,592,135.55 份。

## 7.2 利润表

会计主体：信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>68,995,051.26</b>	<b>58,610,167.96</b>
1.利息收入		7,873,576.96	810,691.45
其中：存款利息收入	7.4.7.11	154,829.60	181,273.35
债券利息收入		7,384,131.00	307,941.80
资产支持证券利息收入		-	-

买入返售金融资产收入		334,616.36	321,476.30
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		36,437,966.25	77,974,586.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	25,955,749.57	75,690,830.23
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	9,684,271.97	-78,191.52
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	797,944.71	2,361,948.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	24,474,250.62	-20,176,933.15
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	209,257.43	1,822.72
<b>减：二、费用</b>		<b>8,536,560.11</b>	<b>3,013,904.59</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2	3,325,458.21	1,486,455.33
2. 托管费	7.4.10.2	475,065.54	212,350.74
3. 销售服务费	7.4.10.2	950,130.95	424,701.57
4. 交易费用	7.4.7.18	3,520,431.06	687,867.79
5. 利息支出		24,477.51	-
其中：卖出回购金融资产支出		24,477.51	-

6. 税金及附加		17,094.02	19.52
7. 其他费用	7.4.7.19	223,902.82	202,509.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>60,458,491.15</b>	<b>55,596,263.37</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>60,458,491.15</b>	<b>55,596,263.37</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	29,777,299.43	16,149,307.14	45,926,606.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	60,458,491.15	60,458,491.15
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）	660,814,836.12	418,573,245.51	1,079,388,081.63
其中：1.基金申购款	816,397,035.33	516,611,921.53	1,333,008,956.86
2.基金赎回款	-155,582,199.21	-98,038,676.02	-253,620,875.23
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）	690,592,135.55	495,181,043.80	1,185,773,179.35
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	152,380,131.29	21,416,470.73	173,796,602.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,596,263.37	55,596,263.37
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）	-122,602,831.86	-60,863,426.96	-183,466,258.82
其中：1.基金申购款	221,761,898.10	94,300,345.06	316,062,243.16
2.基金赎回款	-344,364,729.96	-155,163,772.02	-499,528,501.98
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）	29,777,299.43	16,149,307.14	45,926,606.57

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

信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]第 2163 号《关于信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》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《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,033,188.40 元,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明验字(2016)第 60467227\_H04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")于 2016 年 11 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,033,188.40 份基金份额,未发生认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称"招商银行")。

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监管机构允许投资的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上市的股票等)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据)、债券回购、现金、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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。如果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:股票资产占基金资产的比例为 0%-95%,;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;权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%,资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×50%+上证国债指数收益率×50%。

## 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 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

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

### 7.4.4.2 记账本位币

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

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，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)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定；

#### 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	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	5,630,851.25	1,814,859.18
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	5,630,851.25	1,814,859.18

#### 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	276,289,582.99	292,767,269.42	16,477,686.43	
贵金属投资-金交所黄金 合约	-	-	-	
债券	交易所市场	446,205,301.50	455,265,124.69	9,059,823.19
	银行间市场	420,184,898.90	420,161,000.00	-23,898.90
	合计	866,390,200.40	875,426,124.69	9,035,924.29
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计		1,142,679,783.39	1,168,193,394.11	25,513,610.72
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		7,996,072.46	9,150,821.92	1,154,749.46
贵金属投资-金交所黄金 合约		-	-	-
债券	交易所市场	31,627,124.56	31,511,735.20	-115,389.36
	银行间市场	-	-	-
	合计	31,627,124.56	31,511,735.20	-115,389.36
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		39,623,197.02	40,662,557.12	1,039,360.10

#### 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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,711.22	171.30

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	2,941.18	1,572.23
应收债券利息	8,458,891.92	569,108.98
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	299.94	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	100.21	37.73
合计	8,464,944.47	570,890.24

注：其他为应收结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,221,890.97	164,795.33
银行间市场应付交易费用	2,250.00	-
合计	1,224,140.97	164,795.33

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	189,300.00	169,000.00
合计	189,300.00	169,000.00

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,777,299.43	29,777,299.43
本期申购	816,397,035.33	816,397,035.33
本期赎回（以“-”号填列）	-155,582,199.21	-155,582,199.21
本期末	690,592,135.55	690,592,135.55

注：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。

**7.4.7.10 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

上年度末	23,972,422.02	-7,823,114.88	16,149,307.14
本期利润	35,984,240.53	24,474,250.62	60,458,491.15
本期基金份额交易产生的变动数	577,884,943.88	-159,311,698.37	418,573,245.51
其中：基金申购款	712,235,999.99	-195,624,078.46	516,611,921.53
基金赎回款	-134,351,056.11	36,312,380.09	-98,038,676.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	637,841,606.43	-142,660,562.63	495,181,043.80

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	64,671.18	155,807.81
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	42,172.82	16,718.23
其他	47,985.60	8,747.31
合计	154,829.60	181,273.35

注：其他为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,244,588,233.06	312,737,893.75
减：卖出股票成本总额	1,218,632,483.49	237,047,063.52
买卖股票差价收入	25,955,749.57	75,690,830.23

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	962,161,531.03	33,635,654.07
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	944,003,650.20	32,889,274.92
减：应收利息总额	8,473,608.86	824,570.67
买卖债券差价收入	9,684,271.97	-78,191.52

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	797,944.71	2,361,948.23

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	797,944.71	2,361,948.23

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	24,474,250.62	-20,176,933.15
——股票投资	15,322,936.97	-20,062,243.79
——债券投资	9,151,313.65	-114,689.36
——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	24,474,250.62	-20,176,933.15

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	209,257.43	1,822.72
合计	209,257.43	1,822.72

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产即为基金赎回费收入。

**7.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	3,515,856.06	687,867.79
银行间市场交易费用	4,575.00	-
合计	3,520,431.06	687,867.79

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	60,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00

证券出借违约金	-	-
银行结算费用	6,402.82	5,309.64
帐户维护费	37,500.00	37,200.00
合计	223,902.82	202,509.64

#### 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
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

本基金本期及上年度可比期间无通过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1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,325,458.21	1,486,455.33
其中：支付销售机构的客户维护费	135,455.20	7,892.90

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 0.70% 的年费率计提，每日计算，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×0.70%/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1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	475,065.54	212,350.74

注：支付基金托管人招商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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
信达澳银基金公司	818,843.02
信达证券	135.82
招商银行	424.16
合计	819,403.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
信达证券	76.13
招商银行	603.95
信达澳银基金公司	420,425.76
合计	421,105.84

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，每日计提，按月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 × 0.20% / 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

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

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

本基金本期及上年度可比期间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

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	5,630,851.25	64,671.18	1,814,859.18	155,807.81

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本期及上年度可比期间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

本基金本期及上年度可比期间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
600941	中国移动	2021-12-24	2022-07-05	新股流通受限	57.58	57.58	87,363	5,030,361.54	5,030,361.54	-
600941	中国移动	2021-12-24	2022-01-05	新股未上市	57.58	57.58	37,440	2,155,795.20	2,155,795.20	-
68817	亚	2021-	2022	新股	22.9	22.98	37,448	860,555.04	860,555.04	-

6	虹医药	12-29	-01-07	未上市	8						
688303	大全能源	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	21.49	60.51	5,521	118,646.29	334,075.71	-	
688779	长远锂科	2021-08-03	2022-02-11	新股流通受限	5.65	22.86	9,232	52,160.80	211,043.52	-	
688121	卓然股份	2021-08-30	2022-03-07	新股流通受限	18.16	36.42	3,043	55,260.88	110,826.06	-	
688509	正元地信	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-	
688501	青达环保	2021-07-09	2022-01-17	新股流通受限	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-	
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	-	
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	新股流通受限	58.08	49.85	381	22,128.48	18,992.85	-	
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	-	
301188	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	-	
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-	

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	-
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	-
001234	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	-
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	-
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	-
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	-

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

截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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，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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金,属于风险收益水平较高的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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招商银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	116,432,862.70	7,668,233.10
合计	116,432,862.70	7,668,233.10

注：1、未评级债券为国债和短期融资券。

2、短期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以内（含 1 年）的债券。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	77,897,000.00	-
合计	77,897,000.00	-

#### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	364,729,031.20	17,669,817.10
AAA 以下	159,373,567.59	2,000.00
未评级	156,993,663.20	6,171,685.00
合计	681,096,261.99	23,843,502.10

注：1、未评级债券为国债及政策性金融债。2、长期债券为债券发行日至到期日的期间在 1 年以上的债券。

#### 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、存出保证金及债券投资等。

## 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	5,630,851.25	-	-	-	5,630,851.25
结算备付金	5,941,925.38	-	-	-	5,941,925.38
存出保证金	202,394.59	-	-	-	202,394.59
交易性金融资产	425,594,822.70	310,160,423.47	139,670,878.52	292,767,269.42	1,168,193,394.11
应收利息	-	-	-	8,464,944.47	8,464,944.47
应收申购款	-	-	-	19,438.06	19,438.06
应收证券清算款	-	-	-	3,551,782.33	3,551,782.33
<b>资产总计</b>	<b>437,369,993.92</b>	<b>310,160,423.47</b>	<b>139,670,878.52</b>	<b>304,803,434.28</b>	<b>1,192,004,730.19</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	24,620.26	24,620.26
应付管理人报酬	-	-	-	673,868.30	673,868.30
应付托管费	-	-	-	96,266.92	96,266.92
应付证券清算款	-	-	-	3,806,570.82	3,806,570.82
应付销售服务费	-	-	-	192,533.79	192,533.79
应付交易费用	-	-	-	1,224,140.97	1,224,140.97
应交税费	-	-	-	24,249.78	24,249.78
其他负债	-	-	-	189,300.00	189,300.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>6,231,550.84</b>	<b>6,231,550.84</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>437,369,993.92</b>	<b>310,160,423.47</b>	<b>139,670,878.52</b>	<b>298,571,883.44</b>	<b>1,185,773,179.35</b>
<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	1,814,859.18	-	-	-	1,814,859.18
结算备付金	3,176,114.41	-	-	-	3,176,114.41

存出保证金	76,294.11	-	-	-	76,294.11
交易性金融资产	28,404,240.00	3,105,495.20	2,000.00	9,150,821.92	40,662,557.12
应收利息	-	-	-	570,890.24	570,890.24
应收申购款	-	-	-	141.00	141.00
<b>资产总计</b>	<b>33,471,507.70</b>	<b>3,105,495.20</b>	<b>2,000.00</b>	<b>9,721,853.16</b>	<b>46,300,856.06</b>
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,797.22	1,797.22
应付管理人报酬	-	-	-	26,932.30	26,932.30
应付托管费	-	-	-	3,847.48	3,847.48
应付销售服务费	-	-	-	7,694.94	7,694.94
应付交易费用	-	-	-	164,795.33	164,795.33
应交税费	-	-	-	182.22	182.22
其他负债	-	-	-	169,000.00	169,000.00
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>374,249.49</b>	<b>374,249.49</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>33,471,507.70</b>	<b>3,105,495.20</b>	<b>2,000.00</b>	<b>9,347,603.67</b>	<b>45,926,606.57</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

假设	除市场利率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	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	405.00	2.00
	2.市场利率上升25个基点	-389.00	-2.00

#### 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。

本基金将在风险管理的前提下进行积极的投资，其投资策略主要包括两个方面：自下而上精选并长期投资于具有长期投资价值和有持续成长能力的个股；运用战略资产配置和策略灵活配置模型衡量资产的投资吸引力，有纪律地进行资产的动态配置，在有效控制系统风险前提下实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产为基金资产的 0%-95%；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，基金保留的现金或投资于到期日在一年内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%；权证的投资比例不超过基金资产净值的 3%，资产支持证券投资比例不超过基金资产净值的 20%。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		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	292,767,269.42	24.69	9,150,821.92	19.92
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	292,767,269.42	24.69	9,150,821.92	19.92

#### 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		
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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 5%	1,004.00	50.00
	沪深 300 指数下降 5%	-1,004.00	-50.00

#### 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 502,535,202.48 元，属于第二层次的余额为人民币 665,658,191.63 元，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 8,551,819.46 元，属于第二层次的余额为人民币 32,110,737.66 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	292,767,269.42	24.56
	其中：股票	292,767,269.42	24.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	875,426,124.69	73.44
	其中：债券	875,426,124.69	73.44
	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	11,572,776.63	0.97
8	其他各项资产	12,238,559.45	1.03
9	合计	1,192,004,730.19	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	183,795,199.64	15.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,424,509.00	0.54
E	建筑业	6,913,265.80	0.58
F	批发和零售业	58,465.70	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,366,680.00	1.13
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	54,879,505.18	4.63
J	金融业	5,766,114.69	0.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	95,221.61	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	21,463,699.80	1.81
S	综合	-	-

合计	292,767,269.42	24.69
----	----------------	-------

### 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	300413	芒果超媒	231,900	13,269,318.00	1.12
2	002483	润邦股份	1,464,900	11,836,392.00	1.00
3	300705	九典制药	327,809	11,519,208.26	0.97
4	300737	科顺股份	701,700	11,402,625.00	0.96
5	300093	金刚玻璃	274,562	10,405,899.80	0.88
6	300674	宇信科技	406,700	9,720,130.00	0.82
7	300800	力合科技	320,600	9,290,988.00	0.78
8	300041	回天新材	448,000	8,305,920.00	0.70
9	300251	光线传媒	635,400	8,164,890.00	0.69
10	601222	林洋能源	672,800	8,161,064.00	0.69
11	603920	世运电路	364,590	8,130,357.00	0.69
12	688039	当虹科技	101,743	7,815,897.26	0.66
13	300014	亿纬锂能	65,700	7,764,426.00	0.65
14	002466	天齐锂业	71,000	7,597,000.00	0.64
15	603885	吉祥航空	420,300	7,460,325.00	0.63
16	688087	英科再生	78,652	7,429,467.92	0.63
17	600941	中国移动	124,803	7,186,156.74	0.61
18	688521	芯原股份	91,526	7,080,451.36	0.60
19	002815	崇达技术	414,700	6,987,695.00	0.59
20	600039	四川路桥	573,800	6,908,552.00	0.58
21	300738	奥飞数据	293,400	6,660,180.00	0.56
22	300502	新易盛	160,300	6,280,554.00	0.53
23	600529	山东药玻	141,800	6,225,020.00	0.52
24	300571	平治信息	104,200	6,101,952.00	0.51
25	601111	中国国航	644,100	5,880,633.00	0.50
26	600330	天通股份	361,900	5,873,637.00	0.50
27	300059	东方财富	155,379	5,766,114.69	0.49
28	002212	天融信	280,000	5,367,600.00	0.45
29	688568	中科星图	62,483	4,934,907.34	0.42

30	000423	东阿阿胶	99,600	4,855,500.00	0.41
31	002135	东南网架	403,200	4,660,992.00	0.39
32	000977	浪潮信息	123,200	4,414,256.00	0.37
33	600217	中再资环	575,700	4,358,049.00	0.37
34	600600	青岛啤酒	40,500	4,009,500.00	0.34
35	002304	洋河股份	23,304	3,838,867.92	0.32
36	603700	宁水集团	195,000	3,779,100.00	0.32
37	600875	东方电气	174,162	3,730,550.04	0.31
38	688159	有方科技	116,231	3,672,899.60	0.31
39	603985	恒润股份	65,900	3,520,378.00	0.30
40	000059	华锦股份	479,694	3,492,172.32	0.29
41	600023	浙能电力	839,400	3,391,176.00	0.29
42	600887	伊利股份	81,182	3,365,805.72	0.28
43	000887	中鼎股份	153,000	3,336,930.00	0.28
44	603855	华荣股份	130,593	3,301,391.04	0.28
45	000875	吉电股份	333,700	3,033,333.00	0.26
46	688176	亚虹医药	37,448	860,555.04	0.07
47	002937	兴瑞科技	29,400	592,704.00	0.05
48	688303	大全能源	5,521	334,075.71	0.03
49	688779	长远锂科	9,232	211,043.52	0.02
50	688121	卓然股份	3,043	110,826.06	0.01
51	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.01
52	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
53	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.00
54	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
55	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
56	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
57	301093	华兰股份	381	18,992.85	0.00
58	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
59	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
60	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
61	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
62	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
63	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
64	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
65	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
66	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
67	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
68	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601222	林洋能源	20,156,180.82	43.89
2	002466	天齐锂业	16,520,258.00	35.97
3	601688	华泰证券	15,354,036.00	33.43
4	601877	正泰电器	14,750,693.00	32.12
5	601238	广汽集团	14,507,019.58	31.59
6	300093	金刚玻璃	13,867,685.00	30.20
7	600021	上海电力	12,434,365.78	27.07
8	601012	隆基股份	11,777,959.91	25.65
9	002483	润邦股份	11,703,694.00	25.48
10	300705	九典制药	11,683,121.56	25.44
11	300737	科顺股份	11,357,010.00	24.73
12	600926	杭州银行	11,140,991.88	24.26
13	300413	芒果超媒	11,110,565.84	24.19
14	600690	海尔智家	10,970,864.52	23.89
15	603348	文灿股份	10,631,018.00	23.15
16	300628	亿联网络	10,512,501.38	22.89
17	688518	联赢激光	10,473,141.14	22.80
18	600887	伊利股份	10,410,412.00	22.67
19	603507	振江股份	10,285,225.00	22.39
20	601166	兴业银行	10,003,022.00	21.78
21	600549	厦门钨业	9,984,632.18	21.74
22	002241	歌尔股份	9,728,785.00	21.18
23	603985	恒润股份	9,532,564.00	20.76
24	002179	中航光电	9,466,725.27	20.61
25	300674	宇信科技	9,383,950.80	20.43
26	600875	东方电气	9,259,630.00	20.16
27	002459	晶澳科技	9,043,737.00	19.69
28	300800	力合科技	8,998,744.20	19.59
29	000887	中鼎股份	8,989,046.00	19.57
30	600884	杉杉股份	8,983,002.40	19.56
31	300014	亿纬锂能	8,965,359.00	19.52
32	300059	东方财富	8,791,245.76	19.14
33	002304	洋河股份	8,727,875.00	19.00
34	000776	广发证券	8,696,586.35	18.94

35	002833	弘亚数控	8,585,230.05	18.69
36	002539	云图控股	8,517,479.00	18.55
37	002088	鲁阳节能	8,489,497.00	18.48
38	000877	天山股份	8,484,764.97	18.47
39	000858	五粮液	8,483,130.86	18.47
40	601966	玲珑轮胎	8,481,576.00	18.47
41	300863	卡倍亿	8,299,103.00	18.07
42	603920	世运电路	8,201,059.90	17.86
43	300041	回天新材	8,170,258.00	17.79
44	601985	中国核电	7,980,004.79	17.38
45	002643	万润股份	7,979,776.00	17.38
46	601888	中国中免	7,963,013.00	17.34
47	002221	东华能源	7,953,269.00	17.32
48	000423	东阿阿胶	7,950,976.00	17.31
49	688300	联瑞新材	7,814,848.77	17.02
50	688521	芯原股份	7,730,038.64	16.83
51	600702	舍得酒业	7,660,717.20	16.68
52	600660	福耀玻璃	7,529,681.00	16.40
53	300832	新产业	7,509,440.00	16.35
54	688390	固德威	7,497,057.94	16.32
55	300308	中际旭创	7,492,097.00	16.31
56	600096	云天化	7,486,136.24	16.30
57	600171	上海贝岭	7,483,352.00	16.29
58	600600	青岛啤酒	7,481,939.00	16.29
59	600941	中国移动	7,186,156.74	15.65
60	002815	崇达技术	7,029,689.00	15.31
61	688087	英科再生	6,989,437.73	15.22
62	300490	华自科技	6,984,661.35	15.21
63	300994	久祺股份	6,978,528.25	15.19
64	300035	中科电气	6,830,134.01	14.87
65	600023	浙能电力	6,806,658.00	14.82
66	002595	豪迈科技	6,789,820.00	14.78
67	601689	拓普集团	6,784,657.00	14.77
68	600217	中再资环	6,772,720.79	14.75
69	300738	奥飞数据	6,667,387.73	14.52
70	601857	中国石油	6,666,502.00	14.52
71	603885	吉祥航空	6,641,819.64	14.46
72	002879	长缆科技	6,631,138.60	14.44
73	601868	中国能建	6,600,487.00	14.37
74	300502	新易盛	6,520,753.06	14.20
75	600009	上海机场	6,495,191.00	14.14
76	300512	中亚股份	6,487,550.00	14.13

77	002080	中材科技	6,487,243.00	14.13
78	600039	四川路桥	6,471,914.17	14.09
79	688039	当虹科技	6,395,088.87	13.92
80	300251	光线传媒	6,284,586.00	13.68
81	600519	贵州茅台	6,133,893.00	13.36
82	603678	火炬电子	6,004,621.36	13.07
83	002555	三七互娱	5,994,246.00	13.05
84	688128	中国电研	5,993,613.77	13.05
85	603259	药明康德	5,990,775.00	13.04
86	300443	金雷股份	5,989,167.00	13.04
87	600873	梅花生物	5,977,970.00	13.02
88	002434	万里扬	5,919,833.00	12.89
89	600330	天通股份	5,919,367.00	12.89
90	600988	赤峰黄金	5,913,375.92	12.88
91	002791	坚朗五金	5,841,356.00	12.72
92	300571	平治信息	5,839,460.00	12.71
93	002714	牧原股份	5,836,541.20	12.71
94	601009	南京银行	5,787,273.00	12.60
95	600863	内蒙华电	5,763,046.35	12.55
96	600529	山东药玻	5,727,452.00	12.47
97	603063	禾望电气	5,680,172.00	12.37
98	002636	金安国纪	5,662,138.00	12.33
99	601058	赛轮轮胎	5,545,523.54	12.07
100	603700	宁水集团	5,540,395.40	12.06
101	002212	天融信	5,525,698.00	12.03
102	000768	中航西飞	5,525,314.00	12.03
103	000875	吉电股份	5,505,662.00	11.99
104	688033	天宜上佳	5,494,607.97	11.96
105	003011	海象新材	5,492,832.40	11.96
106	603855	华荣股份	5,488,007.00	11.95
107	000830	鲁西化工	5,487,006.00	11.95
108	300986	志特新材	5,482,052.89	11.94
109	601111	中国国航	5,454,872.00	11.88
110	605089	味知香	5,155,348.10	11.23
111	600048	保利发展	5,028,275.48	10.95
112	002243	力合科创	5,022,168.00	10.94
113	000301	东方盛虹	5,016,042.00	10.92
114	600172	黄河旋风	5,011,428.40	10.91
115	002240	盛新锂能	5,009,596.30	10.91
116	688196	卓越新能	4,998,456.19	10.88
117	600063	皖维高新	4,998,088.00	10.88
118	603986	兆易创新	4,995,262.00	10.88

119	600150	中国船舶	4,994,180.00	10.87
120	601377	兴业证券	4,993,833.78	10.87
121	002028	思源电气	4,992,223.00	10.87
122	603606	东方电缆	4,990,207.00	10.87
123	000560	我爱我家	4,987,486.76	10.86
124	301033	迈普医学	4,986,530.50	10.86
125	300763	锦浪科技	4,917,899.00	10.71
126	688667	菱电电控	4,907,105.39	10.68
127	002460	赣锋锂业	4,834,146.00	10.53
128	002415	海康威视	4,829,952.00	10.52
129	688568	中科星图	4,645,151.85	10.11
130	002283	天润工业	4,586,999.00	9.99
131	600745	闻泰科技	4,533,459.00	9.87
132	603993	洛阳钼业	4,494,491.00	9.79
133	603997	继峰股份	4,493,477.41	9.78
134	002531	天顺风能	4,493,188.00	9.78
135	600210	紫江企业	4,491,201.39	9.78
136	000825	太钢不锈	4,489,049.00	9.77
137	603882	金域医学	4,474,529.00	9.74
138	002594	比亚迪	4,445,174.78	9.68
139	300219	鸿利智汇	4,437,523.17	9.66
140	000977	浪潮信息	4,435,854.82	9.66
141	000059	华锦股份	4,426,160.50	9.64
142	600487	亨通光电	4,402,341.00	9.59
143	603989	艾华集团	4,372,892.00	9.52
144	600703	三安光电	4,287,121.73	9.33
145	688621	阳光诺和	4,173,105.82	9.09
146	300896	爱美客	4,120,890.00	8.97
147	001914	招商积余	4,049,982.95	8.82
148	002135	东南网架	4,020,799.00	8.75
149	002176	江特电机	4,015,338.00	8.74
150	688191	智洋创新	4,004,408.85	8.72
151	688077	大地熊	3,997,379.95	8.70
152	002810	山东赫达	3,996,336.00	8.70
153	600305	恒顺醋业	3,995,496.88	8.70
154	300438	鹏辉能源	3,994,293.00	8.70
155	002508	老板电器	3,993,986.78	8.70
156	603589	口子窖	3,993,783.00	8.70
157	000012	南玻 A	3,991,524.00	8.69
158	000683	远兴能源	3,990,771.44	8.69
159	600760	中航沈飞	3,990,308.00	8.69
160	605111	新洁能	3,985,566.00	8.68

161	600395	盘江股份	3,983,521.83	8.67
162	002709	天赐材料	3,983,416.00	8.67
163	688100	威胜信息	3,976,566.77	8.66
164	603195	公牛集团	3,975,389.00	8.66
165	002705	新宝股份	3,793,628.00	8.26
166	002340	格林美	3,791,599.00	8.26
167	601137	博威合金	3,785,522.24	8.24
168	603486	科沃斯	3,773,495.00	8.22
169	688700	东威科技	3,573,737.51	7.78
170	688006	杭可科技	3,556,310.56	7.74
171	300343	联创股份	3,552,216.00	7.73
172	002697	红旗连锁	3,526,196.00	7.68
173	000911	南宁糖业	3,521,716.00	7.67
174	688159	有方科技	3,519,461.33	7.66
175	300961	深水海纳	3,515,575.13	7.65
176	603712	七一二	3,515,203.00	7.65
177	688107	安路科技	3,504,069.10	7.63
178	002988	豪美新材	3,493,958.00	7.61
179	601388	怡球资源	3,490,518.00	7.60
180	603236	移远通信	3,477,679.40	7.57
181	600285	羚锐制药	3,476,873.50	7.57
182	600570	恒生电子	3,383,907.00	7.37
183	688696	极米科技	3,366,009.22	7.33
184	600276	恒瑞医药	3,334,723.80	7.26
185	688677	海泰新光	3,263,210.71	7.11
186	688202	美迪西	3,244,421.96	7.06
187	002142	宁波银行	3,194,877.00	6.96
188	600460	士兰微	3,139,613.00	6.84
189	002281	光迅科技	3,008,237.00	6.55
190	605080	浙江自然	3,007,770.44	6.55
191	002108	沧州明珠	3,007,305.00	6.55
192	002484	江海股份	3,004,644.00	6.54
193	688550	瑞联新材	2,999,133.57	6.53
194	603197	保隆科技	2,998,528.00	6.53
195	688698	伟创电气	2,997,874.64	6.53
196	300903	科翔股份	2,997,058.00	6.53
197	688023	安恒信息	2,996,707.77	6.52
198	600741	华域汽车	2,996,593.00	6.52
199	600406	国电南瑞	2,996,583.46	6.52
200	688636	智明达	2,996,181.87	6.52
201	600233	圆通速递	2,995,951.06	6.52
202	002174	游族网络	2,995,604.00	6.52

203	002006	精功科技	2,994,966.00	6.52
204	300360	炬华科技	2,994,467.30	6.52
205	300258	精锻科技	2,994,243.00	6.52
206	600483	福能股份	2,994,179.14	6.52
207	300709	精研科技	2,993,136.00	6.52
208	300384	三联虹普	2,992,871.00	6.52
209	688019	安集科技	2,992,763.36	6.52
210	603668	天马科技	2,991,287.00	6.51
211	603727	博迈科	2,991,070.00	6.51
212	002258	利尔化学	2,991,031.76	6.51
213	002392	北京利尔	2,989,332.93	6.51
214	600740	山西焦化	2,987,817.84	6.51
215	603035	常熟汽饰	2,986,321.00	6.50
216	300751	迈为股份	2,929,531.80	6.38
217	300598	诚迈科技	2,879,032.00	6.27
218	300390	天华超净	2,812,835.00	6.12
219	601636	旗滨集团	2,792,616.00	6.08
220	000333	美的集团	2,789,316.00	6.07
221	603806	福斯特	2,782,037.40	6.06
222	300620	光库科技	2,684,465.00	5.85
223	601628	中国人寿	2,653,818.00	5.78
224	603610	麒盛科技	2,648,471.74	5.77
225	603659	璞泰来	2,628,243.00	5.72
226	601677	明泰铝业	2,595,312.00	5.65
227	601872	招商轮船	2,497,460.00	5.44
228	600872	中炬高新	2,495,210.00	5.43
229	603666	亿嘉和	2,494,237.60	5.43
230	300073	当升科技	2,489,795.00	5.42
231	688559	海目星	2,297,586.56	5.00
232	688499	利元亨	2,297,318.57	5.00
233	600123	兰花科创	2,292,091.00	4.99
234	603799	华友钴业	2,274,593.00	4.95
235	603186	华正新材	2,221,160.00	4.84
236	600110	诺德股份	2,109,637.00	4.59
237	600900	长江电力	2,072,031.00	4.51
238	605305	中际联合	2,008,347.92	4.37
239	688598	金博股份	1,998,797.49	4.35
240	600367	红星发展	1,998,126.00	4.35
241	002727	一心堂	1,997,617.00	4.35
242	688063	派能科技	1,997,103.34	4.35
243	002092	中泰化学	1,997,078.00	4.35
244	688599	天合光能	1,996,921.47	4.35

245	301035	润丰股份	1,996,808.00	4.35
246	603214	爱婴室	1,996,278.00	4.35
247	600480	凌云股份	1,996,230.00	4.35
248	000400	许继电气	1,996,072.00	4.35
249	600089	特变电工	1,995,766.00	4.35
250	688408	中信博	1,995,698.72	4.35
251	002120	韵达股份	1,995,312.00	4.34
252	300568	星源材质	1,995,183.95	4.34
253	003006	百亚股份	1,994,853.00	4.34
254	000709	河钢股份	1,994,645.00	4.34
255	002266	浙富控股	1,994,637.00	4.34
256	301002	崧盛股份	1,994,500.00	4.34
257	603690	至纯科技	1,993,736.00	4.34
258	300395	菲利华	1,993,668.00	4.34
259	688075	安旭生物	1,992,512.81	4.34
260	600737	中粮糖业	1,990,582.21	4.33
261	601939	建设银行	1,990,149.00	4.33
262	603605	珀莱雅	1,979,579.00	4.31
263	603323	苏农银行	1,799,941.00	3.92
264	603027	千禾味业	1,793,525.00	3.91
265	003022	联泓新科	1,792,818.70	3.90
266	002930	宏川智慧	1,773,354.00	3.86
267	688357	建龙微纳	1,762,383.03	3.84
268	000932	华菱钢铁	1,698,872.00	3.70
269	600298	安琪酵母	1,599,429.00	3.48
270	300911	亿田智能	1,588,884.00	3.46
271	300687	赛意信息	1,544,701.00	3.36
272	605117	德业股份	1,511,650.71	3.29
273	002236	大华股份	1,499,600.00	3.27
274	688680	海优新材	1,499,055.30	3.26
275	002831	裕同科技	1,498,908.60	3.26
276	300638	广和通	1,498,140.00	3.26
277	603583	捷昌驱动	1,497,726.60	3.26
278	603881	数据港	1,497,553.80	3.26
279	002675	东诚药业	1,497,532.00	3.26
280	603587	地素时尚	1,497,528.00	3.26
281	600141	兴发集团	1,497,349.00	3.26
282	000001	平安银行	1,496,513.00	3.26
283	601899	紫金矿业	1,496,333.00	3.26
284	600315	上海家化	1,495,625.00	3.26
285	600219	南山铝业	1,493,048.00	3.25
286	603501	韦尔股份	1,272,792.70	2.77

287	300601	康泰生物	1,087,518.00	2.37
288	601988	中国银行	999,750.00	2.18
289	000591	太阳能	999,342.00	2.18
290	000422	湖北宜化	999,123.00	2.18
291	300982	苏文电能	998,429.00	2.17
292	002597	金禾实业	998,280.00	2.17
293	002268	卫士通	998,108.00	2.17
294	000902	新洋丰	997,942.00	2.17
295	002937	兴瑞科技	997,376.00	2.17
296	601838	成都银行	996,835.00	2.17
297	603688	石英股份	996,619.00	2.17
298	000983	山西焦煤	996,020.00	2.17
299	600461	洪城环境	995,717.94	2.17
300	601633	长城汽车	993,714.00	2.16
301	688561	奇安信	992,005.83	2.16
302	601398	工商银行	980,720.00	2.14
303	600886	国投电力	966,849.00	2.11
304	600765	中航重机	944,403.00	2.06

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601688	华泰证券	15,713,042.10	34.21
2	601877	正泰电器	14,988,265.70	32.64
3	601238	广汽集团	14,447,282.60	31.46
4	688518	联赢激光	13,822,149.43	30.10
5	600021	上海电力	12,261,669.92	26.70
6	603507	振江股份	11,800,309.72	25.69
7	601222	林洋能源	11,708,622.08	25.49
8	688300	联瑞新材	11,263,779.15	24.53
9	601012	隆基股份	11,087,634.33	24.14
10	002459	晶澳科技	10,759,325.47	23.43
11	300628	亿联网络	10,660,568.37	23.21
12	600690	海尔智家	10,632,010.60	23.15
13	600926	杭州银行	10,590,096.00	23.06
14	603348	文灿股份	10,573,260.50	23.02

15	002241	歌尔股份	10,496,029.52	22.85
16	002466	天齐锂业	10,377,303.47	22.60
17	600549	厦门钨业	10,067,742.52	21.92
18	300994	久祺股份	10,049,307.40	21.88
19	000776	广发证券	10,029,519.29	21.84
20	601166	兴业银行	9,736,464.00	21.20
21	600884	杉杉股份	9,688,000.66	21.09
22	002179	中航光电	9,237,171.12	20.11
23	002833	弘亚数控	8,981,290.36	19.56
24	601966	玲珑轮胎	8,960,579.48	19.51
25	300093	金刚玻璃	8,877,935.83	19.33
26	002539	云图控股	8,863,523.90	19.30
27	300308	中际旭创	8,763,114.00	19.08
28	000858	五粮液	8,552,362.60	18.62
29	601985	中国核电	8,370,172.47	18.23
30	688390	固德威	8,181,140.43	17.81
31	600096	云天化	8,140,884.50	17.73
32	002088	鲁阳节能	8,061,934.70	17.55
33	601888	中国中免	7,726,336.76	16.82
34	002221	东华能源	7,651,613.32	16.66
35	300863	卡倍亿	7,614,596.66	16.58
36	600702	舍得酒业	7,510,353.00	16.35
37	002643	万润股份	7,501,645.00	16.33
38	000877	天山股份	7,451,065.02	16.22
39	600887	伊利股份	7,396,662.71	16.11
40	300035	中科电气	7,318,036.95	15.93
41	688667	菱电电控	7,117,712.12	15.50
42	300490	华自科技	6,986,719.58	15.21
43	000887	中鼎股份	6,928,113.91	15.09
44	002714	牧原股份	6,916,114.88	15.06
45	600660	福耀玻璃	6,836,237.00	14.89
46	600171	上海贝岭	6,804,175.43	14.82
47	603063	禾望电气	6,627,537.33	14.43
48	601058	赛轮轮胎	6,582,113.58	14.33
49	002434	万里扬	6,513,883.00	14.18
50	601868	中国能建	6,477,427.00	14.10
51	601857	中国石油	6,476,722.12	14.10
52	300832	新产业	6,427,348.90	13.99
53	002879	长缆科技	6,418,285.32	13.98
54	000768	中航西飞	6,324,953.09	13.77
55	600873	梅花生物	6,190,513.90	13.48
56	600519	贵州茅台	6,107,256.28	13.30

57	601689	拓普集团	6,065,479.24	13.21
58	002595	豪迈科技	6,046,604.00	13.17
59	600009	上海机场	6,033,815.00	13.14
60	002080	中材科技	6,014,776.00	13.10
61	600863	内蒙华电	5,962,709.60	12.98
62	600063	皖维高新	5,955,520.00	12.97
63	300443	金雷股份	5,902,856.00	12.85
64	601009	南京银行	5,816,717.65	12.67
65	603997	继峰股份	5,813,380.00	12.66
66	002460	赣锋锂业	5,761,650.41	12.55
67	600988	赤峰黄金	5,715,903.16	12.45
68	603678	火炬电子	5,665,815.00	12.34
69	002791	坚朗五金	5,642,231.00	12.29
70	688128	中国电研	5,617,836.34	12.23
71	300512	中亚股份	5,542,418.12	12.07
72	603985	恒润股份	5,511,212.00	12.00
73	300763	锦浪科技	5,478,893.46	11.93
74	605089	味知香	5,418,187.70	11.80
75	002555	三七互娱	5,369,789.00	11.69
76	002243	力合科创	5,352,245.14	11.65
77	300986	志特新材	5,291,748.34	11.52
78	000301	东方盛虹	5,288,429.00	11.51
79	002240	盛新锂能	5,237,479.75	11.40
80	301033	迈普医学	5,201,825.91	11.33
81	000830	鲁西化工	5,133,451.15	11.18
82	002636	金安国纪	5,124,031.00	11.16
83	003011	海象新材	5,108,863.00	11.12
84	603259	药明康德	5,085,643.22	11.07
85	002283	天润工业	5,049,050.00	10.99
86	600150	中国船舶	5,035,139.00	10.96
87	603606	东方电缆	5,031,765.60	10.96
88	603986	兆易创新	5,024,116.00	10.94
89	002028	思源电气	4,975,879.00	10.83
90	688033	天宜上佳	4,934,305.67	10.74
91	688196	卓越新能	4,922,652.30	10.72
92	600740	山西焦化	4,922,089.96	10.72
93	600745	闻泰科技	4,843,109.00	10.55
94	000560	我爱我家	4,795,307.00	10.44
95	601137	博威合金	4,752,494.00	10.35
96	600172	黄河旋风	4,714,050.00	10.26
97	600875	东方电气	4,698,102.16	10.23
98	603806	福斯特	4,671,508.88	10.17

99	600048	保利发展	4,598,240.00	10.01
100	600487	亨通光电	4,573,918.86	9.96
101	600703	三安光电	4,478,642.71	9.75
102	000825	太钢不锈	4,471,018.00	9.74
103	601377	兴业证券	4,352,320.00	9.48
104	603989	艾华集团	4,330,758.57	9.43
105	300360	炬华科技	4,327,391.60	9.42
106	300219	鸿利智汇	4,310,079.00	9.38
107	603993	洛阳钼业	4,286,895.00	9.33
108	002304	洋河股份	4,258,795.36	9.27
109	002415	海康威视	4,230,315.86	9.21
110	000683	远兴能源	4,210,985.86	9.17
111	002531	天顺风能	4,203,377.00	9.15
112	688700	东威科技	4,200,761.80	9.15
113	603727	博迈科	4,193,541.08	9.13
114	002594	比亚迪	4,146,826.80	9.03
115	600210	紫江企业	4,088,796.00	8.90
116	600217	中再资环	4,087,742.50	8.90
117	688202	美迪西	4,014,495.28	8.74
118	300896	爱美客	3,969,070.00	8.64
119	600760	中航沈飞	3,905,692.19	8.50
120	002176	江特电机	3,904,307.00	8.50
121	688621	阳光诺和	3,864,103.50	8.41
122	603486	科沃斯	3,859,623.16	8.40
123	601677	明泰铝业	3,854,183.00	8.39
124	603195	公牛集团	3,844,978.63	8.37
125	001914	招商积余	3,842,470.00	8.37
126	605111	新洁能	3,831,541.14	8.34
127	603589	口子窖	3,822,228.00	8.32
128	002705	新宝股份	3,805,178.60	8.29
129	002006	精功科技	3,774,519.00	8.22
130	605117	德业股份	3,753,663.27	8.17
131	603236	移远通信	3,753,000.60	8.17
132	300059	东方财富	3,737,264.10	8.14
133	600305	恒顺醋业	3,725,623.00	8.11
134	300438	鹏辉能源	3,720,991.50	8.10
135	002508	老板电器	3,695,110.78	8.05
136	000012	南玻A	3,658,151.40	7.97
137	002340	格林美	3,650,862.88	7.95
138	688100	威胜信息	3,643,683.40	7.93
139	688696	极米科技	3,639,137.89	7.92
140	600395	盘江股份	3,634,133.28	7.91

141	002709	天赐材料	3,571,436.00	7.78
142	688006	杭可科技	3,556,354.71	7.74
143	600570	恒生电子	3,548,978.00	7.73
144	603712	七一二	3,533,840.00	7.69
145	603882	金城医学	3,520,462.61	7.67
146	002142	宁波银行	3,486,029.00	7.59
147	000423	东阿阿胶	3,464,283.00	7.54
148	002697	红旗连锁	3,402,896.00	7.41
149	300258	精锻科技	3,374,232.48	7.35
150	600285	羚锐制药	3,314,650.00	7.22
151	600023	浙能电力	3,305,700.80	7.20
152	600276	恒瑞医药	3,255,397.60	7.09
153	000875	吉电股份	3,242,221.00	7.06
154	002810	山东赫达	3,217,260.20	7.01
155	605080	浙江自然	3,187,079.30	6.94
156	688077	大地熊	3,149,560.20	6.86
157	601636	旗滨集团	3,135,000.00	6.83
158	300343	联创股份	3,108,513.00	6.77
159	600600	青岛啤酒	3,106,833.70	6.76
160	002484	江海股份	3,102,119.00	6.75
161	601388	怡球资源	3,093,178.00	6.74
162	688019	安集科技	3,089,780.14	6.73
163	688107	安路科技	3,089,149.23	6.73
164	600406	国电南瑞	3,077,430.00	6.70
165	000911	南宁糖业	3,052,374.00	6.65
166	603035	常熟汽饰	3,049,942.00	6.64
167	300961	深水海纳	3,048,698.38	6.64
168	300903	科翔股份	3,031,156.94	6.60
169	300384	三联虹普	3,028,969.00	6.60
170	002988	豪美新材	3,007,042.01	6.55
171	688191	智洋创新	3,001,715.70	6.54
172	688357	建龙微纳	3,000,830.14	6.53
173	688636	智明达	2,986,088.73	6.50
174	600233	圆通速递	2,972,932.00	6.47
175	603799	华友钴业	2,943,700.75	6.41
176	300709	精研科技	2,937,768.05	6.40
177	002392	北京利尔	2,933,903.00	6.39
178	688550	瑞联新材	2,918,429.39	6.35
179	688559	海目星	2,916,038.48	6.35
180	688698	伟创电气	2,905,829.97	6.33
181	300751	迈为股份	2,904,453.00	6.32
182	688023	安恒信息	2,887,269.41	6.29

183	002174	游族网络	2,858,148.00	6.22
184	300598	诚迈科技	2,856,862.00	6.22
185	002281	光迅科技	2,853,733.00	6.21
186	600741	华域汽车	2,846,969.00	6.20
187	603668	天马科技	2,827,598.00	6.16
188	600141	兴发集团	2,825,645.20	6.15
189	600460	士 兰 微	2,813,949.43	6.13
190	600367	红星发展	2,813,745.00	6.13
191	002108	沧州明珠	2,811,808.00	6.12
192	688677	海泰新光	2,780,478.13	6.05
193	300620	光库科技	2,777,092.00	6.05
194	600483	福能股份	2,767,034.14	6.02
195	603659	璞 泰 来	2,739,387.00	5.96
196	002258	利尔化学	2,728,900.00	5.94
197	300073	当升科技	2,709,104.17	5.90
198	000333	美的集团	2,692,921.00	5.86
199	603690	至纯科技	2,659,529.48	5.79
200	688499	利 元 亨	2,647,263.53	5.76
201	603197	保隆科技	2,610,853.00	5.68
202	600123	兰花科创	2,539,824.35	5.53
203	300390	天华超净	2,514,398.00	5.47
204	603610	麒盛科技	2,431,453.00	5.29
205	603666	亿 嘉 和	2,422,800.00	5.28
206	601872	招商轮船	2,380,590.00	5.18
207	603855	华荣股份	2,370,822.47	5.16
208	300705	九典制药	2,329,738.86	5.07
209	601628	中国人寿	2,317,441.79	5.05
210	600872	中炬高新	2,182,424.00	4.75
211	688408	中 信 博	2,174,532.59	4.73
212	605305	中际联合	2,161,409.88	4.71
213	600480	凌云股份	2,148,057.00	4.68
214	003022	联泓新科	2,125,195.82	4.63
215	600110	诺德股份	2,094,416.50	4.56
216	600900	长江电力	2,053,058.00	4.47
217	300395	菲 利 华	2,046,229.00	4.46
218	688599	天合光能	2,026,586.68	4.41
219	600219	南山铝业	2,009,810.00	4.38
220	601939	建设银行	1,950,005.42	4.25
221	002092	中泰化学	1,937,676.00	4.22
222	603605	珀 莱 雅	1,932,470.00	4.21
223	603323	苏农银行	1,888,617.00	4.11
224	600089	特变电工	1,887,557.84	4.11

225	688063	派能科技	1,882,636.63	4.10
226	688598	金博股份	1,849,136.46	4.03
227	301035	润丰股份	1,842,897.00	4.01
228	000709	河钢股份	1,841,950.00	4.01
229	002727	一心堂	1,827,419.00	3.98
230	600737	中粮糖业	1,780,461.00	3.88
231	603186	华正新材	1,768,572.98	3.85
232	002268	卫士通	1,760,512.27	3.83
233	300568	星源材质	1,756,551.00	3.82
234	000400	许继电气	1,714,046.00	3.73
235	688075	安旭生物	1,710,688.96	3.72
236	002120	韵达股份	1,696,757.00	3.69
237	000932	华菱钢铁	1,669,270.00	3.63
238	603583	捷昌驱动	1,667,604.00	3.63
239	002930	宏川智慧	1,660,292.00	3.62
240	301002	崧盛股份	1,645,893.00	3.58
241	003006	百亚股份	1,617,428.00	3.52
242	603214	爱婴室	1,587,809.02	3.46
243	603027	千禾味业	1,570,762.40	3.42
244	002266	浙富控股	1,544,571.46	3.36
245	601899	紫金矿业	1,533,194.00	3.34
246	300911	亿田智能	1,527,059.46	3.32
247	603700	宁水集团	1,525,178.12	3.32
248	000661	长春高新	1,459,639.00	3.18
249	603587	地素时尚	1,457,102.00	3.17
250	600298	安琪酵母	1,453,919.00	3.17
251	002675	东诚药业	1,410,011.00	3.07
252	000001	平安银行	1,406,368.00	3.06
253	688680	海优新材	1,397,785.52	3.04
254	603501	韦尔股份	1,356,620.25	2.95
255	002236	大华股份	1,348,722.00	2.94
256	603881	数据港	1,331,707.20	2.90
257	600765	中航重机	1,327,814.00	2.89
258	600315	上海家化	1,269,833.00	2.76
259	300638	广和通	1,266,553.00	2.76
260	002831	裕同科技	1,250,539.00	2.72
261	000902	新洋丰	1,237,836.00	2.70
262	300687	赛意信息	1,202,120.39	2.62
263	000422	湖北宜化	1,201,908.00	2.62
264	300982	苏文电能	1,126,244.00	2.45
265	603688	石英股份	1,097,675.00	2.39
266	300601	康泰生物	1,094,096.60	2.38

267	300502	新易盛	1,089,243.10	2.37
268	000568	泸州老窖	1,088,487.00	2.37
269	600461	洪城环境	1,026,132.00	2.23
270	000591	太阳能	1,020,044.00	2.22
271	002597	金禾实业	1,006,312.00	2.19
272	601988	中国银行	990,075.00	2.16
273	688200	华峰测控	990,000.00	2.16
274	601398	工商银行	973,176.00	2.12

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（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

买入股票的成本（成交）总额	1,486,925,994.02
卖出股票的收入（成交）总额	1,244,588,233.06

注：本表中买入股票成本（成交）总额、卖出股票收入（成交）总额均按照买卖成交金额（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	193,005,525.90	16.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,345,000.00	2.56
	其中：政策性金融债	10,211,000.00	0.86
4	企业债券	45,978,168.00	3.88
5	企业短期融资券	70,210,000.00	5.92

6	中期票据	221,683,000.00	18.70
7	可转债(可交换债)	236,307,430.79	19.93
8	同业存单	77,897,000.00	6.57
9	其他	-	-
10	合计	875,426,124.69	73.83

### 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	019547	16 国债 19	666,640	66,750,663.20	5.63
2	019628	20 国债 02	600,000	60,006,000.00	5.06
3	113042	上银转债	478,680	50,543,821.20	4.26
4	019654	21 国债 06	462,090	46,222,862.70	3.90
5	102001391	20 北京国资 MTN002	300,000	30,411,000.00	2.56

### 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	202,394.59
2	应收证券清算款	3,551,782.33
3	应收股利	-
4	应收利息	8,464,944.47
5	应收申购款	19,438.06

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,238,559.45

#### 8.12.4 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	113042	上银转债	50,543,821.20	4.26
2	113037	紫银转债	23,077,546.80	1.95
3	128015	久其转债	11,539,605.00	0.97
4	132015	18 中油 EB	10,393,000.00	0.88
5	110052	贵广转债	10,367,929.60	0.87
6	128118	瀛通转债	9,878,441.62	0.83
7	128083	新北转债	9,580,590.30	0.81
8	113584	家悦转债	8,129,836.80	0.69
9	113017	吉视转债	7,021,679.20	0.59
10	113047	旗滨转债	6,236,158.40	0.53
11	123056	雪榕转债	6,148,997.82	0.52
12	128136	立讯转债	5,720,743.60	0.48
13	128037	岩土转债	5,101,735.20	0.43
14	123096	思创转债	5,004,115.63	0.42
15	127012	招路转债	4,969,794.60	0.42
16	128087	孚日转债	4,833,751.10	0.41
17	113530	大丰转债	4,712,799.60	0.40
18	123077	汉得转债	4,707,374.00	0.40
19	113578	全筑转债	4,546,684.80	0.38
20	123116	万兴转债	4,511,072.20	0.38
21	128066	亚泰转债	3,888,990.40	0.33
22	110073	国投转债	3,833,807.40	0.32
23	110072	广汇转债	3,791,899.80	0.32
24	132021	19 中电 EB	3,706,000.00	0.31
25	127013	创维转债	3,630,300.00	0.31
26	132008	17 山高 EB	3,487,440.00	0.29
27	123004	铁汉转债	3,282,900.00	0.28

28	113597	佳力转债	3,082,152.00	0.26
29	113596	城地转债	2,770,944.00	0.23
30	128039	三力转债	1,182,271.83	0.10

### 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

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
2,243	307,887.71	688,997,746.26	99.77%	1,594,389.29	0.23%

### 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	933.67	0.00%

### 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	0

基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年11月10日)基金份额总额	200,033,188.40
本报告期期初基金份额总额	29,777,299.43
本报告期基金总申购份额	816,397,035.33
减：本报告期基金总赎回份额	155,582,199.21
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	690,592,135.55

## §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。

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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 6 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	
中金公司	2	996,722,470.62	36.66%	728,909.54	36.66%	-
国泰君安	1	790,772,559.85	29.09%	578,294.08	29.09%	-
长江证券	1	510,462,650.84	18.78%	373,293.15	18.78%	-
安信证券	1	369,750,428.13	13.60%	270,400.26	13.60%	-

海通证券	1	50,901,367.42	1.87%	37,224.17	1.87%	-
------	---	---------------	-------	-----------	-------	---

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。

### 11.7.2 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		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中金公司	945,877,186.08	42.45%	802,000,000.00	26.49%	-	-	-	-
国泰君安	329,417,630.25	14.78%	-	-	-	-	-	-
长江证券	337,653,449.38	15.15%	1,700,300,000.00	56.17%	-	-	-	-
安信证券	587,124,254.08	26.35%	525,000,000.00	17.34%	-	-	-	-
海通证券	28,251,818.32	1.27%	-	-	-	-	-	-

### 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	信达澳银基金管理有限公司旗下基金年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-01
2	信达澳银基金管理有限公司关于系统维护对外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	2021-01-08

3	信达澳银新征程、新财富、新目标及安益基金经理助理任命公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-13
4	信达澳银基金管理有限公司关于网上交易系统、微信交易系统升级对外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	2021-01-19
5	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-21
6	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-22
7	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-26
8	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-26
9	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-10
10	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-18
11	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-19
12	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-24

		网站	
13	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-30
14	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-30
15	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-08
16	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金持有的债券调整估值的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-16
17	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金 2020 年四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-21
18	信达澳银基金管理有限公司基金管理人的法定名称、住所发生变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-06
19	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-20
20	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-22
21	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-22
22	信达澳银基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-06-19

23	信达澳银基金管理有限公司旗下基金 2021 半年度净值公告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-07-01
24	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第二季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-07-20
25	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
26	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年中期报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-08-27
27	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
28	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
29	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
30	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
31	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第三季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-26
32	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
33	信达澳银基金管理有限公司关于高级管理人员变	证监会指定信	2021-11-10

	更的公告	息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	
34	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
35	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
36	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	2021-12-21
37	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-12-24
38	信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-12-24

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021 年 01 月 01 日 - 2021 年 01 月 25 日	6,834,586.47	-	6,834,586.47	-	-
	2	2021 年 01	21,590,671.38	-	21,590,671	-	-

	月 01 日 -2021 年 04 月 29 日				.38		
3	2021 年 03 月 01 日 -2021 年 05 月 05 日	-	32,133,033. 42	32,133,033 .42		-	-
4	2021 年 02 月 10 日 -2021 年 02 月 28 日	-	12,730,108. 21	-		12,730,108.21	1.84%
5	2021 年 05 月 28 日 -2021 年 06 月 06 日	-	88,504,721. 60	44,384,175 .28		44,120,546.32	6.39%
6	2021 年 04 月 30 日 -2021 年 08 月 09 日,2021 年 11 月 12 日 -2021 年 11 月 14 日	-	100,223,957 .20	-		100,223,957.20	14.51 %

## 产品特有风险

1、赎回申请延期办理的风险 机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险； 2、基金净值大幅波动的风险 机构投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动； 3、提前终止基金合同的风险 机构投资者赎回后，可能出现基金资产净值低于5000万元的情形，若连续六十个工作日出现基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人可能提前终止基金合同，基金财产将进行清算； 4、基金规模过小导致的风险 机构投资者赎回后，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。

## 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、《信达澳银新财富灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银新财富灵活配置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