

信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	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	25
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	61
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	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	81

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	81
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	81
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	82
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	82
§9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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	84
§10 开放式基金份额变动	84
§11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
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	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	89
§12 影响投资者决策的其他重要信息	94
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	94
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	94
§13 备查文件目录	94
13.1 备查文件目录	94
13.2 存放地点	94
13.3 查阅方式	94

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金
基金简称	信达澳银新能源股票
基金主代码	001410
交易代码	001410
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,258,326,850.85 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过积极主动的管理，在有效控制风险的前提下，精选新能源及其相关产业的优秀企业进行投资，为投资者追求长期稳定的投资回报。
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。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 ×85%+上证国债指数收益率 ×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，长期预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金，属于较高风险、较高预期收益率的基金产品。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	徐伟文	李申
	联系电话	0755-83172666	021-60637102
	电子邮箱	disclosure@fscinda.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-118	021-60637111
传真		0755-83196151	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		518054	100033
法定代表人		朱永强	田国立

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	4,462,970,873.14	2,137,656,671.24	539,953,260.61
本期利润	4,437,577,721.03	3,912,358,288.13	989,145,997.57
加权平均基金份额本期利润	1.5765	1.0438	1.1529
本期加权平均净值利润率	34.63%	32.99%	66.72%
本期基金份额净值增长率	45.37%	59.88%	94.11%
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	9,084,636,073.62	4,350,047,457.41	858,868,014.93
期末可供分配基金份额利润	2.7881	1.2762	0.6673
期末基金资产净值	17,477,493,124.56	12,576,482,476.87	2,970,424,198.11
期末基金份额净值	5.364	3.690	2.308

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	462.61%	287.03%	142.08%

注：1、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。

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

3、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

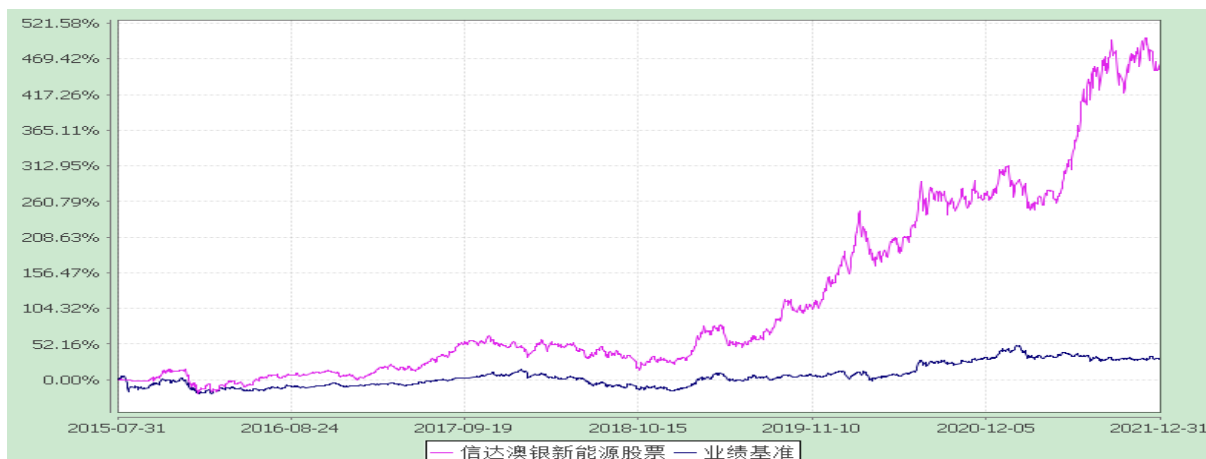
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.70%	1.45%	1.47%	0.67%	1.23%	0.78%
过去六个月	19.28%	1.90%	-4.20%	0.87%	23.48%	1.03%
过去一年	45.37%	1.76%	-3.64%	1.00%	49.01%	0.76%
过去三年	351.14%	1.92%	56.34%	1.09%	294.80%	0.83%
过去五年	427.28%	1.76%	46.08%	1.02%	381.20%	0.74%
自基金合同生效起至今	462.61%	1.74%	31.53%	1.13%	431.08%	0.61%

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

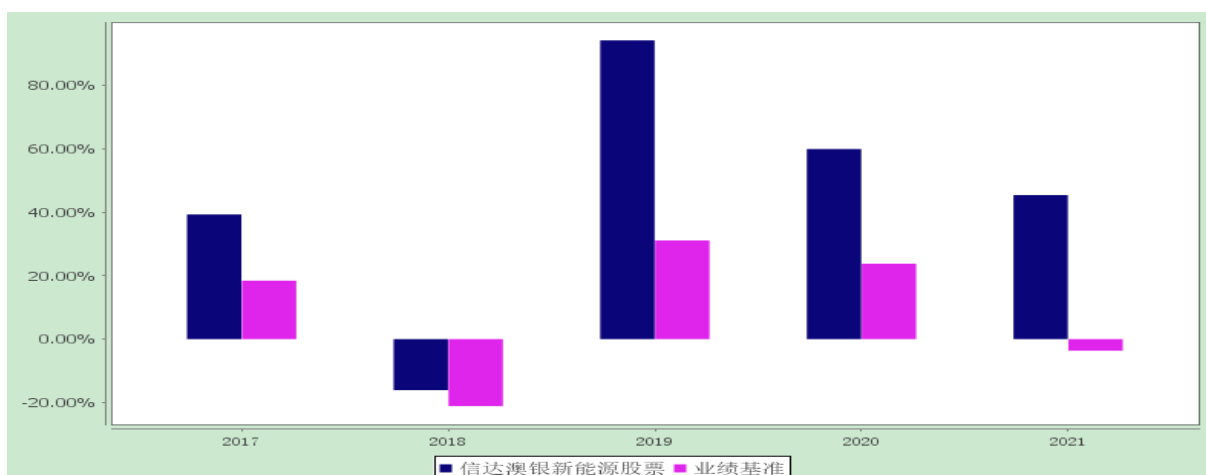
信达澳银新能源产业股票型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015 年 7 月 31 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



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	2016-10-19	-	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

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。

4.4.2 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 5.364 元，份额累计净值为 5.426 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 45.37%，同期业绩比较基准收益率为-3.64%。

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，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。

4.6 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

4.7.1 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金合同》关于收益分配的规定，基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配

利润的 20%。截止报告期末，本基金可供分配利润为 9,084,636,073.62 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。

报告期内本基金未进行利润分配。

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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§6 审计报告

安永华明（2022）审字第 60467227_H12 号

信达澳银新能源产业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能源产业股票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，后附的信达澳银新能源产业股票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能源产业股票型证券投资基金 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能源产业股票型证券投资基金，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

信达澳银新能源产业股票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能源产业股票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能源产业股票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能源产业股票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能源产业股票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：信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

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	996,576,359.77	1,443,062,366.03
结算备付金		37,612,209.45	14,724,567.70
存出保证金		2,585,912.43	2,032,444.57
交易性金融资产	7.4.7.2	16,525,096,744.52	11,409,543,419.00
其中：股票投资		16,513,814,758.87	11,400,387,637.36
基金投资		-	-
债券投资		11,281,985.65	9,155,781.64
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		-	65,899,982.43

应收利息	7.4.7.5	134,759.03	109,454.94
应收股利		-	-
应收申购款		138,980,274.60	30,032,664.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		17,700,986,259.80	12,965,404,898.96
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负 债:		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		89,733,041.38	146,073,287.37
应付赎回款		85,920,747.08	208,249,166.74
应付管理人报酬		22,343,436.67	16,213,996.72
应付托管费		3,723,906.10	2,702,332.78
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	21,368,198.76	14,941,786.53
应交税费		87.49	130.28
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	403,717.76	741,721.67
负债合计		223,493,135.24	388,922,422.09
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	3,258,326,850.85	3,408,644,841.54
未分配利润	7.4.7.10	14,219,166,273.71	9,167,837,635.33
所有者权益合计		17,477,493,124.56	12,576,482,476.87
负债和所有者权益总计		17,700,986,259.80	12,965,404,898.96

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金份额净值 5.364 元，基金份额总额 3,258,326,850.85 份。

7.2 利润表

会计主体：信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

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
一、收入		4,780,238,693.50	4,196,902,257.93
1.利息收入		3,788,118.13	5,271,389.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,776,164.30	5,243,056.03
债券利息收入		11,953.83	28,333.31
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）		4,745,789,516.49	2,326,056,633.37
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,693,269,979.64	2,249,086,940.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	992,975.37	13,147,127.36
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	51,526,561.48	63,822,565.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-25,393,152.11	1,774,701,616.89
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	56,054,210.99	90,872,618.33
减：二、费用		342,660,972.47	284,543,969.80
1. 管理人报酬	7.4.10.2	190,940,601.40	175,766,003.29
2. 托管费	7.4.10.2	31,823,433.44	29,294,333.80
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	119,585,846.99	79,175,574.12
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		42.92	102.08
7. 其他费用	7.4.7.19	311,047.72	307,956.51
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,437,577,721.03	3,912,358,288.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,437,577,721.03	3,912,358,288.13

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银新能源产业股票型证券投资基金

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）	3,408,644,841.54	9,167,837,635.33	12,576,482,476.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,437,577,721.03	4,437,577,721.03
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）	-150,317,990.69	613,750,917.35	463,432,926.66
其中：1.基金申购款	4,429,599,939.53	16,264,072,086.84	20,693,672,026.37
2.基金赎回款	-4,579,917,930.22	-15,650,321,169.49	-20,230,239,099.71
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）	3,258,326,850.85	14,219,166,273.71	17,477,493,124.56
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）	1,287,134,927.43	1,683,289,270.68	2,970,424,198.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,912,358,288.13	3,912,358,288.13
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）	2,121,509,914.11	3,572,190,076.52	5,693,699,990.63
其中：1.基金申购款	9,298,319,478.95	18,840,269,152.44	28,138,588,631.39
2.基金赎回款	-7,176,809,564.84	-15,268,079,075.92	-22,444,888,640.76
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）	3,408,644,841.54	9,167,837,635.33	12,576,482,476.87

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

信达澳银新能源产业股票型证券投资基金(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 984 号《关于准予信达澳银新能源产业股票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《信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明验字(2015)第 60467227_H01 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2015 年 7 月 31 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 286,342,869.31 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 354,644.33 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 286,697,513.64 元,折合 286,697,513.64 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")。

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上市的股票等)、债券(含中小企业私募债、可转换债券等)、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 80%-95%,其中投资于本基金定义的新能源产业主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%;债券(含中小企业私募债、可转换债券等)资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%;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%；资产支持证券的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×85%+上证国债指数收益率×15%。

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。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，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	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	996,576,359.77	1,443,062,366.03
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	996,576,359.77	1,443,062,366.03

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		14,334,951,469.55	16,513,814,758.87	2,178,863,289.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	6,892,900.00	11,281,985.65	4,389,085.65
	银行间市场	-	-	-
	合计	6,892,900.00	11,281,985.65	4,389,085.65
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		14,341,844,369.55	16,525,096,744.52	2,183,252,374.97
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		9,193,362,691.92	11,400,387,637.36	2,207,024,945.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	7,535,200.00	9,155,781.64	1,620,581.64
	银行间市场	-	-	-
	合计	7,535,200.00	9,155,781.64	1,620,581.64
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	9,200,897,891.92	11,409,543,419.00	2,208,645,527.08

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	113,282.38	99,148.09
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	18,617.94	7,288.60
应收债券利息	1,578.75	2,012.19
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	1,279.96	1,006.06
合计	134,759.03	109,454.94

注：其他指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	21,368,198.76	14,941,786.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	21,368,198.76	14,941,786.53

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	129,217.76	477,221.67
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	274,500.00	264,500.00
合计	403,717.76	741,721.67

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	3,408,644,841.54	3,408,644,841.54
本期申购	4,429,599,939.53	4,429,599,939.53
本期赎回（以“-”号填列）	-4,579,917,930.22	-4,579,917,930.22
本期末	3,258,326,850.85	3,258,326,850.85

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	4,350,047,457.41	4,817,790,177.92	9,167,837,635.33
本期利润	4,462,970,873.14	-25,393,152.11	4,437,577,721.03
本期基金份额交易产生的变动数	271,617,743.07	342,133,174.28	613,750,917.35
其中：基金申购款	8,960,045,660.47	7,304,026,426.37	16,264,072,086.84
基金赎回款	-8,688,427,917.40	-6,961,893,252.09	-15,650,321,169.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,084,636,073.62	5,134,530,200.09	14,219,166,273.71

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

	月 31 日	月 31 日
活期存款利息收入	3,102,792.17	4,743,370.02
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	495,927.71	317,904.22
其他	177,444.42	181,781.79
合计	3,776,164.30	5,243,056.03

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 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
卖出股票成交总额	40,463,922,107.86	25,534,748,569.58
减：卖出股票成本总额	35,770,652,128.22	23,285,661,628.87
买卖股票差价收入	4,693,269,979.64	2,249,086,940.71

7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,779,189.72	36,297,499.18
减：卖出债券（债转股	1,783,400.00	23,123,200.00

及债券到期兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	2,814.35	27,171.82
买卖债券差价收入	992,975.37	13,147,127.36

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 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
股票投资产生的股利收益	51,526,561.48	63,822,565.30
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	51,526,561.48	63,822,565.30

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	-25,393,152.11	1,774,701,616.89
——股票投资	-28,161,656.12	1,773,081,035.25

——债券投资	2,768,504.01	1,620,581.64
——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	-25,393,152.11	1,774,701,616.89

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	55,640,380.61	89,691,205.10
基金转换费收入	413,830.38	1,181,413.23
合计	56,054,210.99	90,872,618.33

注：1、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。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	119,585,846.99	79,175,574.12
银行间市场交易费用	-	-
合计	119,585,846.99	79,175,574.12

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	150,000.00	140,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
债券托管账户维护费	18,360.00	18,360.00
银行费用	22,687.72	29,596.51
合计	311,047.72	307,956.51

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
信达证券	21,525,234,448.26	26.55%	8,624,624,709.36	15.56%

7.4.10.1.2 权证交易

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权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
信达证券	-	-	35,036,036.68	96.52%

7.4.10.1.4 债券回购交易

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回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	20,046,464.51	27.88%	8,311,536.64	38.90%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
信达证券	8,032,878.24	16.52%	4,339,008.96	29.04%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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	190,940,601.40	175,766,003.29
其中：支付销售机构的客户维护费	60,189,362.94	53,784,981.42

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，每日计算，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 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	31,823,433.44	29,294,333.80

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，每日计算，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/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

本期末及上年度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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	996,576,359.77	3,102,792.17	1,443,062,366.03	4,743,370.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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
601456	国联证券	2021-10-19	2022-04-15	非公开发行流通受限	11.22	13.45	4,760,249	53,409,993.78	64,025,349.05	-
601728	中国电信	2021-08-11	2022-02-21	新股流通受限	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
002837	英维克	2021-10-21	2022-04-25	非公开发行流通受限	25.58	36.94	410,867	10,509,977.86	15,177,426.98	-
002837	英维克	2021-12-13	2022-06-13	大宗交易买入	41.76	36.04	670,000	27,979,200.00	24,146,800.00	-
300745	欣锐科技	2021-10-20	2022-04-22	非公开发行流通受限	29.25	56.84	539,486	15,779,965.50	30,664,384.24	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
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	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	新股流通受限	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	新股流通受限	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-

301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	新股流通受限	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	新股流通受限	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	新股流通受限	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	新股流通受限	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-

301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	新股流通受限	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	新股流通受限	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
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	2021-08-31	2022-03-	新股流通	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-

	新材		09	受限						
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	2021-10-19	2022-04-	新股流通	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-

	股份		28	受限						
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	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	新股流通受限	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
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	-
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	-
688768	容知日新	2021-07-16	2022-01-26	新股流通受限	18.23	108.54	907	16,534.61	98,445.78	-
688772	珠海冠宇	2021-09-30	2022-04-15	新股流通受限	14.43	39.09	12,960	187,012.80	506,606.40	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	新股流通受限	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
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	-
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：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	-	-	3,621,083	35,460,833.15	39,650,858.85	-

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, 无抵押债券。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 2021 年 12 月 31 日止, 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股票型证券投资基金, 其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金, 属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。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中国建设银行，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	-	-
AAA 以下	11,281,985.65	4,976,781.64
未评级	-	4,179,000.00
合计	11,281,985.65	9,155,781.64

注：1.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。

2.未评级债券投资为未上市可转债

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同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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
资产					
银行存款	996,576,359.77	-	-	-	996,576,359.77
结算备付金	37,612,209.45	-	-	-	37,612,209.45

信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2021 年年度报告

存出保证金	2,585,912.43	-	-	-	2,585,912.43
交易性金融资产	-	9,040,751.14	2,241,234.51	16,513,814,758.87	16,525,096,744.52
应收利息	-	-	-	134,759.03	134,759.03
应收申购款	70,412,854.51	-	-	68,567,420.09	138,980,274.60
资产总计	1,107,187,336.16	9,040,751.14	2,241,234.51	16,582,516,937.99	17,700,986,259.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	85,920,747.08	85,920,747.08
应付管理人报酬	-	-	-	22,343,436.67	22,343,436.67
应付托管费	-	-	-	3,723,906.10	3,723,906.10
应付证券清算款	-	-	-	89,733,041.38	89,733,041.38
应付交易费用	-	-	-	21,368,198.76	21,368,198.76
应交税费	-	-	-	87.49	87.49
其他负债	-	-	-	403,717.76	403,717.76
负债总计	-	-	-	223,493,135.24	223,493,135.24
利率敏感度缺口	1,107,187,336.16	9,040,751.14	2,241,234.51	16,359,023,802.75	17,477,493,124.56
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,443,062,366.03	-	-	-	1,443,062,366.03
结算备付金	14,724,567.70	-	-	-	14,724,567.70
存出保证金	2,032,444.57	-	-	-	2,032,444.57
交易性金融资产	-	-	9,155,781.64	11,400,387,637.36	11,409,543,419.00
应收证券清算款	-	-	-	65,899,982.43	65,899,982.43
应收利息	-	-	-	109,454.94	109,454.94
应收申购款	264.42	-	-	30,032,399.87	30,032,664.29
资产总计	1,459,819,642.72	-	9,155,781.64	11,496,429,474.60	12,965,404,898.96
负债					
应付证券清算款	-	-	-	146,073,287.37	146,073,287.37
应付赎回款	-	-	-	208,249,166.74	208,249,166.74

应付管理人报酬	-	-	-	16,213,996.72	16,213,996.72
应付托管费	-	-	-	2,702,332.78	2,702,332.78
应付交易费用	-	-	-	14,941,786.53	14,941,786.53
应交税费	-	-	-	130.28	130.28
其他负债	-	-	-	741,721.67	741,721.67
负债总计	-	-	-	388,922,422.09	388,922,422.09
利率敏感度缺口	1,459,819,642.72	-	9,155,781.64	11,107,507,052.51	12,576,482,476.87

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券为可转换债券，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。（于 2020 年 12 月 31 日：同）

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。由于本基金为股票型基金，核心投资策略为股票精选策略，同时辅以资产配置策略优化投资组合的风险收益，提升投资组合回报。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，其中投资于本基金定义的新能源产业主题相关的股票资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；债券（含中小企业私募债、可转换债券等）资产、现金、货币市场工具、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例为 5%-20%；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%；资产支持证券的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	16,513,814,758.87	94.49	11,400,387,637.36	90.65
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	16,513,814,758.87	94.49	11,400,387,637.36	90.65

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
1. 沪深 300 指数上升 5%	62,868.00	71,321.00
2. 沪深 300 指数下降 5%	-62,868.00	-71,321.00

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 16,347,407,940.14 元，属于第二层次的余额为人民币 177,688,804.38 元，无属于第三层次余额。(2020 年 12 月 31 日，第一层次的余额为人民币 11,005,373,185.53 元，属于第二层次的余额为人民币 404,170,233.47 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	16,513,814,758.87	93.29
	其中：股票	16,513,814,758.87	93.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	11,281,985.65	0.06
	其中：债券	11,281,985.65	0.06

	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	1,034,188,569.22	5.84
8	其他各项资产	141,700,946.06	0.80
9	合计	17,700,986,259.80	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	9,501,708.48	0.05
B	采矿业	88,947,760.27	0.51
C	制造业	14,254,479,667.14	81.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	550,703,207.37	3.15
E	建筑业	287,333,535.14	1.64
F	批发和零售业	59,718,049.41	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	158,907,271.52	0.91
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	541,662,583.05	3.10
J	金融业	108,684,600.79	0.62
K	房地产业	100,255,228.12	0.57
L	租赁和商务服务业	20,942,903.91	0.12
M	科学研究和技术服务业	2,297,221.16	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	67,230,269.72	0.38
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	37,906.44	0.00
S	综合	263,090,076.57	1.51
	合计	16,513,814,758.87	94.49

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	3,868,437	621,309,666.57	3.55
2	000063	中兴通讯	11,849,131	396,945,888.50	2.27
3	002466	天齐锂业	3,083,345	329,917,915.00	1.89
4	600563	法拉电子	1,298,419	301,752,575.60	1.73
5	600673	东阳光	29,588,594	262,746,714.72	1.50
6	300750	宁德时代	439,183	258,239,604.00	1.48
7	300207	欣旺达	6,058,850	255,441,116.00	1.46
8	002876	三利谱	3,839,662	239,902,081.76	1.37

9	300035	中科电气	7,535,626	227,952,686.50	1.30
10	600516	方大炭素	20,946,675	226,643,023.50	1.30
11	688772	珠海冠宇	4,459,401	216,825,961.05	1.24
12	002179	中航光电	2,034,703	204,609,733.68	1.17
13	300457	赢合科技	6,262,039	192,369,838.08	1.10
14	601877	正泰电器	3,462,001	186,567,233.89	1.07
15	002460	赣锋锂业	1,270,873	181,544,208.05	1.04
16	600210	紫江企业	18,901,728	173,517,863.04	0.99
17	002741	光华科技	8,232,273	172,713,087.54	0.99
18	300593	新雷能	3,029,325	164,734,693.50	0.94
19	300638	广和通	2,980,342	162,428,639.00	0.93
20	600703	三安光电	4,037,242	151,638,809.52	0.87
21	600741	华域汽车	5,230,298	148,017,433.40	0.85
22	002664	长鹰信质	7,345,500	145,808,175.00	0.83
23	688187	时代电气	1,778,106	145,804,692.00	0.83
24	300679	电连技术	2,776,950	145,789,875.00	0.83
25	603989	艾华集团	3,417,708	141,493,111.20	0.81
26	002484	江海股份	5,128,318	140,105,647.76	0.80
27	002273	水晶光电	7,482,559	130,121,701.01	0.74
28	688595	芯海科技	996,167	123,972,983.15	0.71
29	002635	安洁科技	7,203,700	122,679,011.00	0.70
30	603982	泉峰汽车	2,551,608	119,925,576.00	0.69
31	600519	贵州茅台	58,120	119,146,000.00	0.68
32	600745	闻泰科技	902,006	116,629,375.80	0.67
33	688148	芳源股份	3,315,629	116,013,858.71	0.66
34	002824	和胜股份	2,387,960	108,341,745.20	0.62
35	603799	华友钴业	980,319	108,138,988.89	0.62
36	600114	东睦股份	9,154,440	107,564,670.00	0.62
37	002916	深南电路	881,500	107,384,330.00	0.61
38	300088	长信科技	7,903,700	104,961,136.00	0.60
39	601919	中远海控	5,603,414	104,727,807.66	0.60
40	000568	泸州老窖	412,239	104,655,114.93	0.60
41	600905	三峡能源	13,879,268	104,233,302.68	0.60
42	002988	豪美新材	5,043,160	103,939,527.60	0.59
43	002060	粤水电	18,724,359	103,920,192.45	0.59
44	002050	三花智控	4,098,508	103,692,252.40	0.59
45	300115	长盈精密	5,100,789	101,199,653.76	0.58
46	603383	顶点软件	2,807,857	100,802,066.30	0.58
47	000858	五粮液	446,454	99,407,447.64	0.57
48	300811	铂科新材	994,760	97,765,012.80	0.56
49	002705	新宝股份	3,946,247	97,472,300.90	0.56
50	300890	翔丰华	1,533,508	94,816,799.64	0.54

51	002837	英维克	2,426,291	94,338,614.34	0.54
52	002594	比亚迪	351,800	94,324,616.00	0.54
53	300769	德方纳米	190,047	93,343,484.52	0.53
54	002101	广东鸿图	7,796,100	91,838,058.00	0.53
55	002436	兴森科技	6,388,442	89,438,188.00	0.51
56	300432	富临精工	2,981,869	87,666,948.60	0.50
57	002463	沪电股份	5,206,786	86,328,511.88	0.49
58	002049	紫光国微	376,924	84,807,900.00	0.49
59	600418	江淮汽车	4,854,791	84,473,363.40	0.48
60	002472	双环传动	3,050,100	84,121,758.00	0.48
61	002706	良信股份	4,548,400	81,052,488.00	0.46
62	002540	亚太科技	10,021,529	77,165,773.30	0.44
63	300687	赛意信息	2,578,673	75,245,678.14	0.43
64	688390	固德威	159,276	73,200,064.08	0.42
65	000539	粤电力A	11,479,509	70,598,980.35	0.40
66	300568	星源材质	1,911,027	70,192,021.71	0.40
67	002136	安纳达	4,277,365	69,549,954.90	0.40
68	688077	大地熊	877,092	67,702,731.48	0.39
69	300748	金力永磁	1,440,768	64,676,075.52	0.37
70	601456	国联证券	4,760,249	64,025,349.05	0.37
71	002459	晶澳科技	681,280	63,154,656.00	0.36
72	000030	富奥股份	8,440,827	62,630,936.34	0.36
73	002284	亚太股份	5,983,900	62,292,399.00	0.36
74	002583	海能达	10,933,667	60,353,841.84	0.35
75	688599	天合光能	757,782	59,788,999.80	0.34
76	601985	中国核电	7,184,363	59,630,212.90	0.34
77	300531	优博讯	2,899,189	59,230,431.27	0.34
78	002139	拓邦股份	3,153,603	58,940,840.07	0.34
79	300930	屹通新材	1,778,400	57,691,296.00	0.33
80	001914	招商积余	2,841,400	57,566,764.00	0.33
81	002918	蒙娜丽莎	1,991,700	57,022,371.00	0.33
82	601012	隆基股份	658,432	56,756,838.40	0.32
83	603319	湘油泵	2,193,823	56,425,127.56	0.32
84	002957	科瑞技术	2,157,780	54,872,345.40	0.31
85	688005	容百科技	466,358	53,901,657.64	0.31
86	601800	中国交建	6,228,874	53,443,738.92	0.31
87	600728	佳都科技	6,334,881	52,769,558.73	0.30
88	002475	立讯精密	1,069,511	52,619,941.20	0.30
89	002182	云海金属	2,288,508	52,498,373.52	0.30
90	688036	传音控股	332,211	52,123,905.90	0.30
91	603626	科森科技	4,273,740	51,669,516.60	0.30
92	600963	岳阳林纸	6,446,400	50,797,632.00	0.29

93	601669	中国电建	6,124,699	49,487,567.92	0.28
94	601868	中国能建	18,091,241	49,389,087.93	0.28
95	300502	新易盛	1,225,263	48,005,804.34	0.27
96	601778	晶科科技	5,622,351	47,958,654.03	0.27
97	688388	嘉元科技	375,417	47,133,604.35	0.27
98	688123	聚辰股份	694,252	47,111,940.72	0.27
99	002745	木林森	3,105,668	46,988,756.84	0.27
100	000422	湖北宜化	2,094,336	44,630,300.16	0.26
101	000810	创维数字	4,502,160	44,346,276.00	0.25
102	603063	禾望电气	1,095,535	44,161,015.85	0.25
103	300611	美力科技	3,914,800	44,158,944.00	0.25
104	600110	诺德股份	2,763,409	44,076,373.55	0.25
105	002176	江特电机	2,112,625	43,858,095.00	0.25
106	300343	联创股份	2,568,825	43,721,401.50	0.25
107	003012	东鹏控股	3,145,000	43,149,400.00	0.25
108	002959	小熊电器	671,321	42,877,272.27	0.25
109	300409	道氏技术	1,754,987	42,558,434.75	0.24
110	002341	新纶新材	7,674,822	42,288,269.22	0.24
111	603927	中科软	1,542,881	42,213,224.16	0.24
112	300919	中伟股份	278,210	42,151,597.10	0.24
113	300870	欧陆通	493,900	41,369,064.00	0.24
114	601016	节能风电	6,163,420	40,123,864.20	0.23
115	600933	爱柯迪	2,078,032	40,064,456.96	0.23
116	000780	ST 平能	3,621,083	39,650,858.85	0.23
117	002937	兴瑞科技	1,933,900	38,987,424.00	0.22
118	000875	吉电股份	4,163,607	37,847,187.63	0.22
119	002236	大华股份	1,596,561	37,487,252.28	0.21
120	600236	桂冠电力	5,789,530	37,168,782.60	0.21
121	002011	盾安环境	2,670,100	36,580,370.00	0.21
122	300450	先导智能	488,278	36,313,234.86	0.21
123	688499	利元亨	122,700	35,951,100.00	0.21
124	000792	盐湖股份	1,009,623	35,730,557.97	0.20
125	300487	蓝晓科技	360,000	35,406,000.00	0.20
126	300390	天华超净	432,596	35,040,276.00	0.20
127	300468	四方精创	1,698,678	34,296,308.82	0.20
128	603348	文灿股份	578,900	33,813,549.00	0.19
129	002600	领益智造	4,574,801	33,670,535.36	0.19
130	002328	新朋股份	5,595,610	33,573,660.00	0.19
131	000049	德赛电池	571,901	33,353,266.32	0.19
132	688323	瑞华泰	854,058	32,906,854.74	0.19
133	300745	欣锐科技	571,386	32,712,364.24	0.19
134	603713	密尔克卫	240,426	32,404,616.28	0.19

135	603693	江苏新能	1,091,000	31,049,860.00	0.18
136	603290	斯达半导	78,150	29,775,150.00	0.17
137	603359	东珠生态	2,080,900	29,756,870.00	0.17
138	600887	伊利股份	717,405	29,743,611.30	0.17
139	002859	洁美科技	786,765	29,267,658.00	0.17
140	002782	可立克	1,634,000	29,199,580.00	0.17
141	600499	科达制造	1,150,879	28,564,816.78	0.16
142	688536	思瑞浦	36,877	28,321,536.00	0.16
143	601615	明阳智能	1,081,300	28,221,930.00	0.16
144	688519	南亚新材	556,515	28,053,921.15	0.16
145	002536	飞龙股份	3,263,682	27,839,207.46	0.16
146	002008	大族激光	514,500	27,783,000.00	0.16
147	000762	西藏矿业	521,781	27,722,224.53	0.16
148	300827	上能电气	301,345	27,392,260.50	0.16
149	300917	特发服务	827,600	27,054,244.00	0.15
150	603105	芯能科技	1,626,680	27,035,421.60	0.15
151	603816	顾家家居	349,288	26,951,062.08	0.15
152	600378	昊华科技	557,638	26,878,151.60	0.15
153	600885	宏发股份	356,907	26,639,538.48	0.15
154	002993	奥海科技	667,080	26,269,610.40	0.15
155	600098	广州发展	3,232,800	26,121,024.00	0.15
156	002756	永兴材料	176,400	26,110,728.00	0.15
157	600995	文山电力	1,308,991	26,009,651.17	0.15
158	002415	海康威视	496,193	25,960,817.76	0.15
159	002091	江苏国泰	1,886,007	25,894,876.11	0.15
160	603385	惠达卫浴	2,324,500	25,801,950.00	0.15
161	600285	羚锐制药	1,630,500	25,761,900.00	0.15
162	002245	蔚蓝锂芯	921,629	25,354,013.79	0.15
163	605111	新洁能	135,731	24,173,691.10	0.14
164	688711	宏微科技	192,433	23,844,373.03	0.14
165	300661	圣邦股份	77,061	23,811,849.00	0.14
166	600152	维科技术	2,895,700	23,802,654.00	0.14
167	002138	顺络电子	617,652	23,581,953.36	0.13
168	000045	深纺织 A	2,477,720	23,538,340.00	0.13
169	601689	拓普集团	443,193	23,489,229.00	0.13
170	002384	东山精密	865,900	23,465,890.00	0.13
171	603040	新坐标	1,161,731	23,408,879.65	0.13
172	000519	中兵红箭	870,018	23,203,380.06	0.13
173	600690	海尔智家	770,723	23,036,910.47	0.13
174	603345	安井食品	134,822	23,024,901.16	0.13
175	600500	中化国际	2,662,400	22,790,144.00	0.13
176	300604	长川科技	395,242	22,726,415.00	0.13

177	000333	美的集团	306,137	22,595,971.97	0.13
178	600809	山西汾酒	70,985	22,415,643.30	0.13
179	300656	民德电子	418,571	22,247,048.65	0.13
180	300124	汇川技术	316,955	21,743,113.00	0.12
181	002407	多氟多	476,278	21,427,747.22	0.12
182	300674	宇信科技	880,038	21,032,908.20	0.12
183	601888	中国中免	95,451	20,942,903.91	0.12
184	688518	联赢激光	422,048	20,794,304.96	0.12
185	000661	长春高新	76,500	20,762,100.00	0.12
186	603166	福达股份	2,325,000	20,204,250.00	0.12
187	002832	比音勒芬	784,900	19,975,705.00	0.11
188	002371	北方华创	57,556	19,973,083.12	0.11
189	603596	伯特利	284,605	19,808,508.00	0.11
190	603978	深圳新星	714,500	19,591,590.00	0.11
191	002368	太极股份	706,800	19,465,272.00	0.11
192	300647	超频三	2,366,597	19,358,763.46	0.11
193	688378	奥来德	235,468	18,860,986.80	0.11
194	002938	鹏鼎控股	435,709	18,487,132.87	0.11
195	600491	龙元建设	2,673,795	18,422,447.55	0.11
196	600522	中天科技	1,070,162	18,149,947.52	0.10
197	002708	光洋股份	2,580,439	18,011,464.22	0.10
198	603690	至纯科技	371,041	17,865,624.15	0.10
199	000921	海信家电	1,175,200	17,804,280.00	0.10
200	300480	光力科技	514,925	17,672,226.00	0.10
201	300059	东方财富	474,371	17,603,907.81	0.10
202	300655	晶瑞电材	419,731	17,536,361.18	0.10
203	603118	共进股份	1,828,500	17,480,460.00	0.10
204	000883	湖北能源	3,326,896	17,432,935.04	0.10
205	002851	麦格米特	542,749	17,378,822.98	0.10
206	600216	浙江医药	1,013,400	17,308,872.00	0.10
207	600460	士兰微	319,113	17,295,924.60	0.10
208	600361	华联综超	3,007,500	17,293,125.00	0.10
209	300308	中际旭创	405,910	17,251,175.00	0.10
210	603138	海量数据	1,085,122	17,242,588.58	0.10
211	002488	金固股份	1,960,615	17,214,199.70	0.10
212	600702	舍得酒业	75,409	17,140,465.70	0.10
213	603288	海天味业	162,797	17,111,592.67	0.10
214	600237	铜峰电子	1,797,200	16,983,540.00	0.10
215	000799	酒鬼酒	79,600	16,915,000.00	0.10
216	600038	中直股份	209,353	16,811,045.90	0.10
217	002068	黑猫股份	1,592,313	16,719,286.50	0.10
218	000591	太阳能	1,489,390	16,681,168.00	0.10

219	600600	青岛啤酒	167,600	16,592,400.00	0.09
220	601727	上海电气	3,406,752	16,556,814.72	0.09
221	300037	新宙邦	142,885	16,146,005.00	0.09
222	002557	洽洽食品	261,900	16,070,184.00	0.09
223	300083	创世纪	1,112,647	15,888,599.16	0.09
224	300659	中孚信息	347,500	15,759,125.00	0.09
225	603899	晨光文具	244,204	15,753,600.04	0.09
226	002884	凌霄泵业	556,642	15,569,276.74	0.09
227	688107	安路科技	215,183	15,428,621.10	0.09
228	300660	江苏雷利	525,600	15,400,080.00	0.09
229	600309	万华化学	150,779	15,228,679.00	0.09
230	002709	天赐材料	132,100	15,145,265.00	0.09
231	002063	远光软件	1,494,300	14,853,342.00	0.08
232	300428	立中集团	559,340	14,710,642.00	0.08
233	600562	国睿科技	799,000	14,685,620.00	0.08
234	600406	国电南瑞	364,300	14,582,929.00	0.08
235	600660	福耀玻璃	305,483	14,400,468.62	0.08
236	300433	蓝思科技	623,804	14,335,015.92	0.08
237	601222	林洋能源	1,171,400	14,209,082.00	0.08
238	600366	宁波韵升	1,065,800	14,079,218.00	0.08
239	002531	天顺风能	726,000	14,077,140.00	0.08
240	300614	百川畅银	292,296	14,030,208.00	0.08
241	300775	三角防务	283,710	13,870,581.90	0.08
242	688299	长阳科技	423,793	13,858,031.10	0.08
243	603026	石大胜华	69,680	13,795,943.20	0.08
244	600111	北方稀土	298,437	13,668,414.60	0.08
245	601238	广汽集团	887,078	13,474,714.82	0.08
246	688678	福立旺	406,640	13,333,725.60	0.08
247	603020	爱普股份	920,724	13,092,695.28	0.07
248	002922	伊戈尔	640,675	13,012,109.25	0.07
249	688200	华峰测控	24,880	12,736,072.00	0.07
250	002025	航天电器	151,593	12,726,232.35	0.07
251	688368	晶丰明源	39,704	12,709,250.40	0.07
252	002497	雅化集团	442,299	12,676,289.34	0.07
253	600577	精达股份	1,647,888	12,260,286.72	0.07
254	000408	藏格矿业	295,853	12,129,973.00	0.07
255	600776	东方通信	1,047,500	12,056,725.00	0.07
256	002352	顺丰控股	173,900	11,985,188.00	0.07
257	300408	三环集团	262,481	11,706,652.60	0.07
258	300319	麦捷科技	759,647	11,622,599.10	0.07
259	002085	万丰奥威	2,099,700	11,527,353.00	0.07
260	603305	旭升股份	219,000	10,923,720.00	0.06

261	688800	瑞可达	77,978	10,860,775.84	0.06
262	688025	杰普特	137,313	10,579,966.65	0.06
263	002056	横店东磁	559,666	10,560,897.42	0.06
264	002196	方正电机	889,900	10,394,032.00	0.06
265	300274	阳光电源	71,271	10,391,311.80	0.06
266	300671	富满微	125,800	10,196,090.00	0.06
267	688020	方邦股份	110,588	10,080,096.20	0.06
268	300438	鹏辉能源	210,200	9,929,848.00	0.06
269	600085	同仁堂	220,338	9,910,803.24	0.06
270	000559	万向钱潮	1,547,800	9,859,486.00	0.06
271	600872	中炬高新	259,418	9,850,101.46	0.06
272	688080	映翰通	111,317	9,762,500.90	0.06
273	600970	中材国际	842,436	9,629,043.48	0.06
274	002266	浙富控股	1,343,960	9,568,995.20	0.05
275	002714	牧原股份	178,068	9,501,708.48	0.05
276	688007	光峰科技	274,352	9,423,991.20	0.05
277	688008	澜起科技	109,550	9,187,958.50	0.05
278	002212	天融信	478,950	9,181,471.50	0.05
279	688359	三孚新科	156,033	9,152,895.78	0.05
280	002241	歌尔股份	167,365	9,054,446.50	0.05
281	002036	联创电子	369,375	8,961,037.50	0.05
282	603516	淳中科技	441,595	8,955,546.60	0.05
283	603612	索通发展	433,779	8,901,145.08	0.05
284	003021	兆威机电	111,249	8,883,232.65	0.05
285	300131	英唐智控	1,080,100	8,792,014.00	0.05
286	000938	紫光股份	383,060	8,752,921.00	0.05
287	002142	宁波银行	228,258	8,737,716.24	0.05
288	600036	招商银行	177,879	8,664,486.09	0.05
289	002507	涪陵榨菜	228,400	8,633,520.00	0.05
290	300693	盛弘股份	235,115	8,626,369.35	0.05
291	300505	川金诺	281,485	8,624,700.40	0.05
292	300623	捷捷微电	272,923	8,586,157.58	0.05
293	603893	瑞芯微	62,700	8,583,630.00	0.05
294	002805	丰元股份	267,932	8,453,254.60	0.05
295	002080	中材科技	248,179	8,443,049.58	0.05
296	000596	古井贡酒	34,000	8,296,000.00	0.05
297	002240	盛新锂能	141,180	8,181,381.00	0.05
298	688408	中信博	46,330	8,177,708.30	0.05
299	600585	海螺水泥	202,400	8,156,720.00	0.05
300	000400	许继电气	302,129	7,885,566.90	0.05
301	600297	广汇汽车	2,871,000	7,665,570.00	0.04
302	603897	长城科技	151,600	7,555,744.00	0.04

303	002405	四维图新	466,800	7,431,456.00	0.04
304	603936	博敏电子	432,061	7,431,449.20	0.04
305	300014	亿纬锂能	62,265	7,358,477.70	0.04
306	600487	亨通光电	482,294	7,292,285.28	0.04
307	600141	兴发集团	191,598	7,257,732.24	0.04
308	002335	科华数据	198,635	7,222,368.60	0.04
309	688128	中国电研	242,639	7,172,408.84	0.04
310	002312	川发龙蟒	544,725	7,125,003.00	0.04
311	688608	恒玄科技	23,294	7,104,670.00	0.04
312	603588	高能环境	402,471	7,071,415.47	0.04
313	600011	华能国际	724,788	7,023,195.72	0.04
314	300114	中航电测	394,221	6,969,827.28	0.04
315	001979	招商蛇口	514,906	6,868,846.04	0.04
316	300699	光威复材	80,800	6,825,984.00	0.04
317	600850	电科数字	199,700	6,815,761.00	0.04
318	688181	八亿时空	139,713	6,622,396.20	0.04
319	603283	赛腾股份	222,870	6,552,378.00	0.04
320	603179	新泉股份	151,100	6,539,608.00	0.04
321	600096	云天化	332,298	6,519,686.76	0.04
322	688023	安恒信息	25,984	6,515,228.16	0.04
323	300077	国民技术	260,398	6,504,742.04	0.04
324	300866	安克创新	62,840	6,441,100.00	0.04
325	601633	长城汽车	129,595	6,290,541.30	0.04
326	688122	西部超导	64,819	6,283,553.86	0.04
327	002970	锐明技术	152,440	6,274,430.40	0.04
328	002192	融捷股份	47,302	6,156,355.30	0.04
329	002897	意华股份	107,800	6,102,558.00	0.03
330	002271	东方雨虹	112,091	5,904,953.88	0.03
331	300351	永贵电器	397,500	5,898,900.00	0.03
332	300454	深信服	29,505	5,635,455.00	0.03
333	688793	倍轻松	52,110	5,445,495.00	0.03
334	002895	川恒股份	215,232	5,314,078.08	0.03
335	688127	蓝特光学	230,164	5,291,470.36	0.03
336	600048	保利发展	337,919	5,281,673.97	0.03
337	603505	金石资源	145,454	5,269,798.42	0.03
338	002434	万里扬	356,300	5,251,862.00	0.03
339	300211	亿通科技	407,200	5,212,160.00	0.03
340	603100	川仪股份	245,190	5,188,220.40	0.03
341	688508	芯朋微	43,883	5,084,284.38	0.03
342	600888	新疆众和	614,200	5,079,434.00	0.03
343	000777	中核科技	322,400	5,068,128.00	0.03
344	000027	深圳能源	623,131	5,047,361.10	0.03

345	300729	乐歌股份	171,200	5,033,280.00	0.03
346	603606	东方电缆	98,200	5,023,912.00	0.03
347	600023	浙能电力	1,237,202	4,998,296.08	0.03
348	603267	鸿远电子	27,631	4,958,106.64	0.03
349	002906	华阳集团	89,843	4,937,771.28	0.03
350	300474	景嘉微	32,186	4,898,709.20	0.03
351	603918	金桥信息	535,500	4,878,405.00	0.03
352	600990	四创电子	86,200	4,841,854.00	0.03
353	300763	锦浪科技	20,870	4,832,448.50	0.03
354	002649	博彦科技	405,800	4,739,744.00	0.03
355	603195	公牛集团	28,100	4,701,130.00	0.03
356	000876	新希望	304,300	4,628,403.00	0.03
357	600674	川投能源	366,200	4,577,500.00	0.03
358	300473	德尔股份	196,400	4,548,624.00	0.03
359	002074	国轩高科	87,787	4,499,083.75	0.03
360	603109	神驰机电	156,736	4,468,543.36	0.03
361	600367	红星发展	240,274	4,464,290.92	0.03
362	603938	三孚股份	117,900	4,337,541.00	0.02
363	003022	联泓新科	118,627	4,322,767.88	0.02
364	300709	精研科技	71,949	4,313,342.55	0.02
365	000821	京山轻机	312,600	4,310,754.00	0.02
366	300365	恒华科技	398,018	4,278,693.50	0.02
367	002752	昇兴股份	619,800	4,183,650.00	0.02
368	002920	德赛西威	29,564	4,183,601.64	0.02
369	603501	韦尔股份	13,459	4,182,653.43	0.02
370	002180	纳思达	85,400	4,078,704.00	0.02
371	300648	星云股份	67,344	4,053,435.36	0.02
372	603078	江化微	148,543	3,948,272.94	0.02
373	301067	显盈科技	80,000	3,915,200.00	0.02
374	002043	兔宝宝	320,900	3,876,472.00	0.02
375	600477	杭萧钢构	933,555	3,855,582.15	0.02
376	002135	东南网架	331,426	3,831,284.56	0.02
377	600875	东方电气	178,500	3,823,470.00	0.02
378	688598	金博股份	10,635	3,775,850.40	0.02
379	600025	华能水电	569,131	3,750,573.29	0.02
380	600893	航发动力	57,746	3,664,561.16	0.02
381	002326	永太科技	70,600	3,615,426.00	0.02
382	300799	左江科技	37,711	3,544,834.00	0.02
383	002645	华宏科技	145,100	3,540,440.00	0.02
384	002386	天原股份	275,433	3,506,262.09	0.02
385	300477	合纵科技	435,286	3,504,052.30	0.02
386	600150	中国船舶	140,853	3,491,745.87	0.02

387	002986	宇新股份	92,659	3,333,870.82	0.02
388	000831	五矿稀土	85,300	3,328,406.00	0.02
389	002409	雅克科技	40,770	3,309,300.90	0.02
390	688521	芯原股份	42,406	3,280,528.16	0.02
391	002845	同兴达	110,413	3,262,704.15	0.02
392	000012	南玻A	327,305	3,250,138.65	0.02
393	002149	西部材料	174,183	3,225,869.16	0.02
394	300369	绿盟科技	199,100	3,157,726.00	0.02
395	600219	南山铝业	667,822	3,145,441.62	0.02
396	600199	金种子酒	183,900	3,109,749.00	0.02
397	601111	中国国航	337,100	3,077,723.00	0.02
398	688210	统联精密	73,833	3,061,116.18	0.02
399	600029	南方航空	446,200	3,038,622.00	0.02
400	002533	金杯电工	351,500	3,026,415.00	0.02
401	000570	苏常柴A	505,640	2,957,994.00	0.02
402	600170	上海建工	798,300	2,873,880.00	0.02
403	603663	三祥新材	98,600	2,736,150.00	0.02
404	601225	陕西煤业	223,639	2,728,395.80	0.02
405	601177	杭齿前进	300,357	2,706,216.57	0.02
406	688116	天奈科技	17,807	2,658,407.03	0.02
407	605399	晨光新材	66,766	2,651,277.86	0.02
408	603650	彤程新材	52,617	2,647,687.44	0.02
409	300097	智云股份	311,341	2,637,058.27	0.02
410	603931	格林达	74,748	2,466,684.00	0.01
411	601728	中国电信	562,873	2,413,599.43	0.01
412	603678	火炬电子	30,455	2,303,920.75	0.01
413	601226	华电重工	331,503	2,247,590.34	0.01
414	603568	伟明环保	60,520	2,210,795.60	0.01
415	300034	钢研高纳	36,900	2,125,440.00	0.01
416	002738	中矿资源	29,862	2,101,090.32	0.01
417	002191	劲嘉股份	138,704	2,098,591.52	0.01
418	601636	旗滨集团	120,648	2,063,080.80	0.01
419	002039	黔源电力	96,787	2,040,269.96	0.01
420	600742	一汽富维	170,050	2,033,798.00	0.01
421	300379	东方通	67,281	1,986,807.93	0.01
422	600021	上海电力	154,865	1,985,369.30	0.01
423	000915	华特达因	65,087	1,982,550.02	0.01
424	300112	万讯自控	137,143	1,936,459.16	0.01
425	600496	精工钢构	444,971	1,895,576.46	0.01
426	600619	海立股份	231,066	1,878,566.58	0.01
427	000776	广发证券	75,492	1,856,348.28	0.01
428	002743	富煌钢构	257,858	1,846,263.28	0.01

429	601179	中国西电	324,714	1,802,162.70	0.01
430	601688	华泰证券	101,297	1,799,034.72	0.01
431	601006	大秦铁路	280,807	1,797,164.80	0.01
432	601838	成都银行	149,217	1,790,604.00	0.01
433	600256	广汇能源	272,937	1,785,007.98	0.01
434	300046	台基股份	76,627	1,783,110.29	0.01
435	300852	四会富仕	30,400	1,775,968.00	0.01
436	601127	小康股份	29,786	1,773,756.30	0.01
437	000002	万 科 A	89,724	1,772,946.24	0.01
438	300459	汤 姆 猫	318,700	1,768,785.00	0.01
439	300041	回天新材	95,214	1,765,267.56	0.01
440	002125	湘潭电化	154,503	1,761,334.20	0.01
441	603587	地素时尚	91,868	1,760,190.88	0.01
442	000902	新 洋 丰	103,854	1,754,094.06	0.01
443	000911	南宁糖业	163,612	1,750,648.40	0.01
444	000630	铜陵有色	502,362	1,748,219.76	0.01
445	601377	兴业证券	176,941	1,748,177.08	0.01
446	688233	神工股份	19,715	1,738,863.00	0.01
447	600104	上汽集团	84,245	1,737,974.35	0.01
448	300619	金 银 河	19,914	1,735,903.38	0.01
449	300082	奥克股份	111,856	1,728,175.20	0.01
450	002885	京 泉 华	65,680	1,712,934.40	0.01
451	601000	唐 山 港	622,002	1,710,505.50	0.01
452	600821	金开新能	178,860	1,697,381.40	0.01
453	000731	四川美丰	163,097	1,692,946.86	0.01
454	600800	渤海化学	357,900	1,692,867.00	0.01
455	002759	天际股份	57,773	1,692,748.90	0.01
456	688019	安集科技	6,193	1,691,927.60	0.01
457	688037	芯 源 微	9,996	1,687,324.80	0.01
458	000625	长安汽车	110,977	1,685,740.63	0.01
459	688286	敏芯股份	18,127	1,680,372.90	0.01
460	603218	日月股份	50,878	1,676,430.10	0.01
461	600795	国电电力	528,365	1,674,917.05	0.01
462	600760	中航沈飞	24,490	1,666,299.60	0.01
463	688686	奥 普 特	5,899	1,664,520.83	0.01
464	600744	华银电力	282,402	1,652,051.70	0.01
465	000958	东方能源	319,072	1,627,267.20	0.01
466	603876	鼎胜新材	43,205	1,626,668.25	0.01
467	600966	博汇纸业	156,720	1,620,484.80	0.01
468	688663	新 风 光	34,115	1,609,886.85	0.01
469	688661	和林微纳	15,953	1,604,233.68	0.01
470	300236	上海新阳	39,015	1,593,762.75	0.01

471	603228	景旺电子	45,962	1,587,067.86	0.01
472	603906	龙蟠科技	42,643	1,579,496.72	0.01
473	688779	长远锂科	67,210	1,575,402.40	0.01
474	600316	洪都航空	40,166	1,568,883.96	0.01
475	601827	三峰环境	175,420	1,564,746.40	0.01
476	600426	华鲁恒升	49,933	1,562,902.90	0.01
477	002340	格林美	151,000	1,562,850.00	0.01
478	300598	诚迈科技	24,328	1,556,748.72	0.01
479	002034	旺能环境	89,400	1,543,938.00	0.01
480	300129	泰胜风能	164,587	1,520,783.88	0.01
481	002913	奥士康	18,794	1,473,825.48	0.01
482	002881	美格智能	34,224	1,467,525.12	0.01
483	600395	盘江股份	201,181	1,462,585.87	0.01
484	600323	瀚蓝环境	69,683	1,461,949.34	0.01
485	688396	华润微	22,449	1,450,205.40	0.01
486	600392	盛和资源	73,626	1,444,542.12	0.01
487	000933	神火股份	156,785	1,425,175.65	0.01
488	600346	恒力石化	61,986	1,423,818.42	0.01
489	603993	洛阳钼业	254,618	1,420,768.44	0.01
490	603027	千禾味业	58,780	1,415,422.40	0.01
491	600171	上海贝岭	54,202	1,390,823.32	0.01
492	600312	平高电气	151,196	1,374,371.64	0.01
493	688777	中控技术	17,566	1,332,908.08	0.01
494	601600	中国铝业	217,987	1,327,540.83	0.01
495	605117	德业股份	4,700	1,286,813.00	0.01
496	002487	大金重工	33,000	1,278,750.00	0.01
497	301011	华立科技	21,175	1,274,735.00	0.01
498	000807	云铝股份	112,702	1,258,881.34	0.01
499	002092	中泰化学	128,788	1,228,637.52	0.01
500	600438	通威股份	26,800	1,204,928.00	0.01
501	000768	中航西飞	32,953	1,202,784.50	0.01
502	300373	扬杰科技	17,647	1,185,525.46	0.01
503	300389	艾比森	114,400	1,181,752.00	0.01
504	688079	美迪凯	79,594	1,167,643.98	0.01
505	688662	富信科技	26,294	1,117,495.00	0.01
506	002129	中环股份	26,336	1,099,528.00	0.01
507	300965	恒宇信通	15,700	1,077,962.00	0.01
508	000893	亚钾国际	40,256	1,072,822.40	0.01
509	000968	蓝焰控股	107,406	1,004,246.10	0.01
510	600765	中航重机	19,015	960,067.35	0.01
511	002579	中京电子	91,080	938,124.00	0.01
512	600773	西藏城投	32,705	924,243.30	0.01

513	601011	宝泰隆	173,167	916,053.43	0.01
514	002268	卫士通	16,167	904,381.98	0.01
515	600160	巨化股份	68,864	889,034.24	0.01
516	300627	华测导航	19,212	883,752.00	0.01
517	002411	必康股份	70,723	880,501.35	0.01
518	002493	荣盛石化	48,248	876,183.68	0.01
519	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.00
520	600711	盛屯矿业	81,140	870,632.20	0.00
521	600863	内蒙华电	219,386	864,380.84	0.00
522	600536	中国软件	17,130	855,300.90	0.00
523	603068	博通集成	15,964	855,031.84	0.00
524	603429	集友股份	32,222	840,994.20	0.00
525	600282	南钢股份	227,184	840,580.80	0.00
526	600063	皖维高新	136,041	833,931.33	0.00
527	600926	杭州银行	64,876	831,710.32	0.00
528	002132	恒星科技	135,007	824,892.77	0.00
529	300979	华利集团	9,246	823,356.30	0.00
530	600019	宝钢股份	112,477	805,335.32	0.00
531	002866	传艺科技	63,603	798,853.68	0.00
532	002110	三钢闽光	117,075	796,110.00	0.00
533	002812	恩捷股份	3,178	795,771.20	0.00
534	002968	新大正	22,199	786,510.57	0.00
535	002518	科士达	30,803	773,155.30	0.00
536	000932	华菱钢铁	150,180	767,419.80	0.00
537	600596	新安股份	30,517	762,619.83	0.00
538	000825	太钢不锈	104,151	733,223.04	0.00
539	688560	明冠新材	21,039	727,739.01	0.00
540	600782	新钢股份	135,696	716,474.88	0.00
541	600581	八一钢铁	113,112	702,425.52	0.00
542	000962	东方钨业	54,939	647,730.81	0.00
543	688110	东芯股份	14,044	634,507.92	0.00
544	603738	泰晶科技	10,389	616,067.70	0.00
545	600884	杉杉股份	18,259	598,347.43	0.00
546	688138	清溢光电	30,488	585,979.36	0.00
547	688006	杭可科技	5,422	583,298.76	0.00
548	000683	远兴能源	75,668	552,376.40	0.00
549	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.00
550	600027	华电国际	65,970	352,939.50	0.00
551	000009	中国宝安	23,795	343,361.85	0.00
552	300855	图南股份	3,183	224,369.67	0.00
553	002971	和远气体	8,775	206,563.50	0.00
554	600699	均胜电子	9,170	201,464.90	0.00

555	603986	兆易创新	1,131	198,886.35	0.00
556	603043	广州酒家	7,943	191,108.58	0.00
557	300496	中科创达	1,376	190,465.92	0.00
558	000629	攀钢钒钛	48,959	190,450.51	0.00
559	000155	川能动力	6,911	183,348.83	0.00
560	688733	壹石通	2,281	181,932.56	0.00
561	688135	利扬芯片	4,327	180,825.33	0.00
562	688268	华特气体	1,989	179,407.80	0.00
563	601088	中国神华	7,914	178,223.28	0.00
564	603186	华正新材	4,248	177,523.92	0.00
565	688111	金山办公	668	177,020.00	0.00
566	601857	中国石油	35,782	175,689.62	0.00
567	300510	金冠股份	26,664	175,182.48	0.00
568	600497	驰宏锌锗	35,013	174,714.87	0.00
569	601168	西部矿业	12,801	174,221.61	0.00
570	601899	紫金矿业	17,942	174,037.40	0.00
571	300566	激智科技	6,106	173,532.52	0.00
572	300460	惠伦晶体	8,692	173,405.40	0.00
573	600328	中盐化工	10,549	173,109.09	0.00
574	002387	维信诺	18,570	172,329.60	0.00
575	300657	弘信电子	10,379	171,357.29	0.00
576	300741	华宝股份	3,568	170,728.80	0.00
577	601678	滨化股份	21,397	170,534.09	0.00
578	688029	南微医学	786	167,158.62	0.00
579	000089	深圳机场	22,629	165,644.28	0.00
580	300223	北京君正	1,236	165,624.00	0.00
581	002185	华天科技	12,815	162,878.65	0.00
582	601618	中国中冶	42,523	162,863.09	0.00
583	002511	中顺洁柔	9,547	159,530.37	0.00
584	603486	科沃斯	1,056	159,403.20	0.00
585	000066	中国长城	11,156	157,968.96	0.00
586	002396	星网锐捷	6,680	157,447.60	0.00
587	000822	山东海化	22,597	157,049.15	0.00
588	002156	通富微电	8,078	156,955.54	0.00
589	002987	京北方	4,979	156,440.18	0.00
590	002119	康强电子	10,789	155,577.38	0.00
591	688981	中芯国际	2,902	153,776.98	0.00
592	000725	京东方 A	30,238	152,701.90	0.00
593	600584	长电科技	4,876	151,253.52	0.00
594	688012	中微公司	1,094	138,500.40	0.00
595	002685	华东重机	33,681	128,324.61	0.00
596	688768	容知日新	907	98,445.78	0.00

597	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
598	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
599	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
600	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
601	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
602	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
603	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
604	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
605	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
606	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
607	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
608	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
609	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
610	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
611	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
612	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
613	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
614	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
615	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
616	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
617	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
618	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
619	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
620	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
621	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
622	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
623	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
624	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
625	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
626	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
627	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
628	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
629	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
630	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
631	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
632	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
633	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
634	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
635	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
636	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
637	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
638	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00

639	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
640	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
641	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
642	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
643	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
644	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
645	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
646	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
647	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
648	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
649	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
650	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
651	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
652	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	002466	天齐锂业	859,459,428.14	6.83
2	603993	洛阳钼业	773,709,076.29	6.15
3	002594	比亚迪	712,506,254.84	5.67
4	000063	中兴通讯	577,998,840.05	4.60
5	002156	通富微电	576,181,221.79	4.58
6	300750	宁德时代	532,562,008.21	4.23
7	600516	方大炭素	497,828,426.50	3.96
8	300457	赢合科技	493,873,120.94	3.93
9	300207	欣旺达	472,907,154.41	3.76
10	002460	赣锋锂业	449,809,450.56	3.58
11	002185	华天科技	437,440,877.75	3.48
12	000858	五粮液	436,565,205.61	3.47
13	600584	长电科技	421,592,470.80	3.35
14	002371	北方华创	415,584,567.91	3.30
15	600745	闻泰科技	406,430,523.91	3.23
16	603659	璞泰来	400,485,526.69	3.18
17	600519	贵州茅台	395,135,066.60	3.14
18	600460	士兰微	373,238,572.51	2.97
19	000568	泸州老窖	350,524,250.77	2.79

20	601669	中国电建	315,432,220.42	2.51
21	002475	立讯精密	307,870,038.33	2.45
22	600905	三峡能源	297,456,342.98	2.37
23	603799	华友钴业	294,656,182.37	2.34
24	002497	雅化集团	288,932,093.64	2.30
25	002407	多氟多	275,667,320.22	2.19
26	601012	隆基股份	264,346,701.38	2.10
27	300115	长盈精密	258,504,417.11	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	603993	洛阳钼业	980,672,490.68	7.80
2	002466	天齐锂业	836,875,813.78	6.65
3	002594	比亚迪	834,885,791.89	6.64
4	002371	北方华创	620,488,625.37	4.93
5	000725	京东方 A	585,351,670.44	4.65
6	600516	方大炭素	577,822,470.98	4.59
7	300750	宁德时代	574,006,230.05	4.56
8	600460	士兰微	556,548,753.11	4.43
9	002156	通富微电	515,893,654.06	4.10
10	300207	欣旺达	509,343,565.64	4.05
11	603026	石大胜华	459,307,217.85	3.65
12	603799	华友钴业	407,940,288.49	3.24
13	002475	立讯精密	402,967,408.18	3.20
14	002185	华天科技	386,972,812.55	3.08
15	300457	赢合科技	383,627,692.06	3.05
16	002497	雅化集团	379,533,030.16	3.02
17	300671	富满微	377,704,212.65	3.00
18	600584	长电科技	377,118,594.09	3.00
19	000049	德赛电池	374,343,803.51	2.98
20	002241	歌尔股份	373,656,024.24	2.97
21	601012	隆基股份	371,922,665.01	2.96
22	600745	闻泰科技	371,291,592.44	2.95
23	002138	顺络电子	367,710,137.27	2.92
24	601669	中国电建	363,030,378.33	2.89

25	300115	长盈精密	345,808,187.45	2.75
26	000858	五粮液	342,240,146.89	2.72
27	002460	赣锋锂业	341,153,048.24	2.71
28	603501	韦尔股份	307,169,054.93	2.44
29	600519	贵州茅台	297,795,460.28	2.37
30	300083	创世纪	292,707,117.49	2.33
31	601899	紫金矿业	289,597,043.34	2.30
32	688012	中微公司	284,921,145.94	2.27
33	300014	亿纬锂能	283,128,342.06	2.25
34	601919	中远海控	272,005,062.61	2.16
35	688037	芯源微	267,929,338.42	2.13
36	000568	泸州老窖	265,682,607.94	2.11
37	300604	长川科技	264,674,820.76	2.10
38	600563	法拉电子	259,256,488.83	2.06
39	002407	多氟多	257,071,939.85	2.04
40	000630	铜陵有色	253,935,603.55	2.02
41	300450	先导智能	252,448,262.43	2.01

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	40,912,240,905.85
卖出股票的收入（成交）总额	40,463,922,107.86

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	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	11,281,985.65	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	11,281,985.65	0.06

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	113616	韦尔转债	41,790	7,055,405.70	0.04
2	127038	国微转债	11,411	2,241,234.51	0.01
3	128136	立讯转债	15,728	1,985,345.44	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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	2,585,912.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	134,759.03
5	应收申购款	138,980,274.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,700,946.06

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	113616	韦尔转债	7,055,405.70	0.04
2	127038	国微转债	2,241,234.51	0.01
3	128136	立讯转债	1,985,345.44	0.01

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
1,254,453	2,597.41	1,145,584,616.76	35.16%	2,112,742,234.09	64.84%

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	2,710,288.11	0.08%

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 金	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年7月31日)基金份额总额	286,697,513.64
本报告期期初基金份额总额	3,408,644,841.54
本报告期基金总申购份额	4,429,599,939.53
减：本报告期基金总赎回份额	4,579,917,930.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,258,326,850.85

§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 15 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	2	10,964,677,279.97	13.53%	8,018,491.85	11.15%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	970,665,575.40	1.20%	903,981.26	1.26%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	1,973,630,595.14	2.43%	1,838,054.63	2.56%	-
光大证券	2	8,914,010,559.41	11.00%	8,301,621.53	11.54%	-
广发证券	1	289,774,677.82	0.36%	269,868.17	0.38%	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	3,037,360,658.40	3.75%	2,828,701.89	3.93%	退租 1 个
国信证券	2	1,620,204,713.50	2.00%	1,508,897.59	2.10%	-
海通证券	2	2,255,888,938.19	2.78%	2,100,912.50	2.92%	-
恒泰证券	1	3,053,430,745.56	3.77%	2,843,675.37	3.95%	-
华安证券	3	323,743,260.83	0.40%	236,753.96	0.33%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	397,567,623.35	0.49%	290,741.81	0.40%	-
华泰证券	3	201,697,888.43	0.25%	147,502.32	0.21%	-
华西证券	2	1,039,019,217.01	1.28%	759,836.06	1.06%	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	862,491,049.45	1.06%	630,740.61	0.88%	-

开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	372,388,635.08	0.46%	346,806.91	0.48%	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	1,688,542,284.29	2.08%	1,572,532.74	2.19%	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	47,851,322.28	0.06%	44,563.95	0.06%	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	21,525,234,448.26	26.55%	20,046,464.51	27.88%	-
兴业证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
野村东方	1	3,214,736,223.66	3.97%	2,350,942.30	3.27%	-
银河证券	1	3,217,677,367.39	3.97%	2,996,628.96	4.17%	-
粤开证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
长城证券	1	1,080,702,696.33	1.33%	1,006,474.14	1.40%	-
长江证券	2	4,790,747,367.84	5.91%	4,461,629.24	6.20%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	899,618,495.79	1.11%	837,809.49	1.17%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	3,563,194,694.22	4.40%	3,318,384.14	4.61%	-
中信建投	2	2,272,855,384.99	2.80%	2,116,730.64	2.94%	-
中信证券	4	2,489,312,093.13	3.07%	2,131,326.38	2.96%	-
中信证券 (华南)	1	-	-	-	-	-
中信证券 (山东)	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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
东方财富	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
东吴证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
方正证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
光大证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
广发证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国泰君安	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
国信证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
海通证券	2,779,189.72	100.00%	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华安证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华金证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
华西证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
金元证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-

申万宏源	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
天风证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
西南证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
信达证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
野村东方	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
银河证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
长城证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
长江证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
浙商证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中泰证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中信建投	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-
中信证券	0.00	0.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-14

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	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2020 年四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-21
6	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-01-21
7	信达澳银基金管理有限公司关于我司旗下部分基金参加腾安基金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	2021-02-22
8	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
9	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金在东方财富证券股份有限公司开通定投业务的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-18
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

13	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2020 年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-03-30
14	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
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	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2021 年一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-04-21
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	信达澳银基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行的公告	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
20	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-10
21	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金招募说明书摘要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2021-05-26
22	信达澳银新能源产业股票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	2021-05-26
23	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投	证监会指定信	2021-06-01

	资非公开发行股票的公告	息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	
24	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
25	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
26	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2021 年第二季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-07-20
27	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
28	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2021 年中期报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-08-27
29	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
30	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
31	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
32	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

33	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-21
34	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-22
35	信达澳银基金管理有限公司关于旗下部分基金投资非公开发行股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-25
36	信达澳银新能源产业股票型证券投资基金 2021 年第三季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2021-10-26
37	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
38	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
39	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
40	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
41	信达澳银基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金单笔最低赎回份额、转换转出及最低持有份额的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2021-12-27

§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、《信达澳银新能源产业股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银新能源产业股票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

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二二年三月二十九日