

信达澳银先进智造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	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	16
§6 审计报告	16
§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	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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	84

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	84
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	84
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	85
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	85
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	85
8.12 投资组合报告附注	85
§9 基金份额持有人信息	86
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	86
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	87
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	87
§10 开放式基金份额变动	87
§11 重大事件揭示	88
11.1 基金份额持有人大会决议	88
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	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	88
11.4 基金投资策略的改变	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	89
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	89
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	89
11.8 其他重大事件	91
§12 影响投资者决策的其他重要信息	95
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	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	96
§13 备查文件目录	96
13.1 备查文件目录	96
13.2 存放地点	96
13.3 查阅方式	97

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信达澳银先进智造股票型证券投资基金
基金简称	信达澳银先进智造股票型
基金主代码	006257
交易代码	006257
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 17 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	1,084,308,785.51 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘中国经济结构转型、产业升级大背景下，先进智造主题相关行业的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
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*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金若投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场

	实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。
--	--

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 1 月 17 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	535,817,592.97	192,862,394.75	9,685,645.59
本期利润	739,032,732.19	386,757,957.47	31,711,084.85
加权平均基金份额本期利润	0.9048	0.6757	0.3453
本期加权平均净值利润率	31.75%	34.44%	31.82%
本期基金份额净值增长率	45.88%	62.02%	39.64%
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	1,144,061,238.45	298,463,193.59	10,772,177.06

期末可供分配基金份额利润	1.0551	0.4432	0.1148
期末基金资产净值	3,578,760,875.49	1,523,644,874.66	131,086,040.69
期末基金份额净值	3.3005	2.2624	1.3964
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	230.05%	126.24%	39.64%

注：1、本基金基金合同于 2019 年 1 月 17 日生效，截至本报告期末，本基金成立不满三年。

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

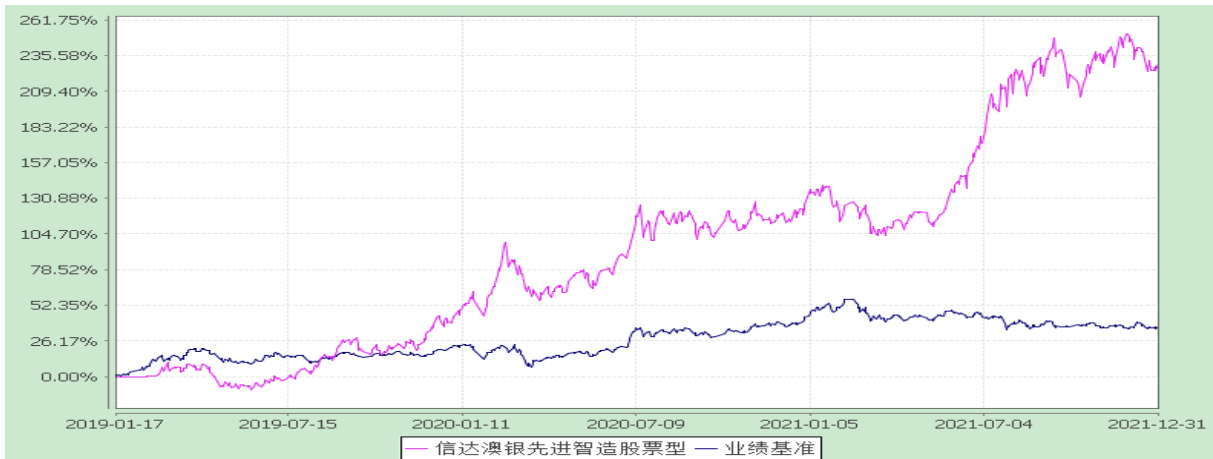
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.61%	1.43%	-0.16%	0.61%	2.77%	0.82%
过去六个月	19.46%	1.85%	-6.61%	0.81%	26.07%	1.04%
过去一年	45.88%	1.72%	-4.84%	0.90%	50.72%	0.82%
自基金合同生效起至今	230.05%	1.81%	36.58%	0.96%	193.47%	0.85%

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

信达澳银先进智造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

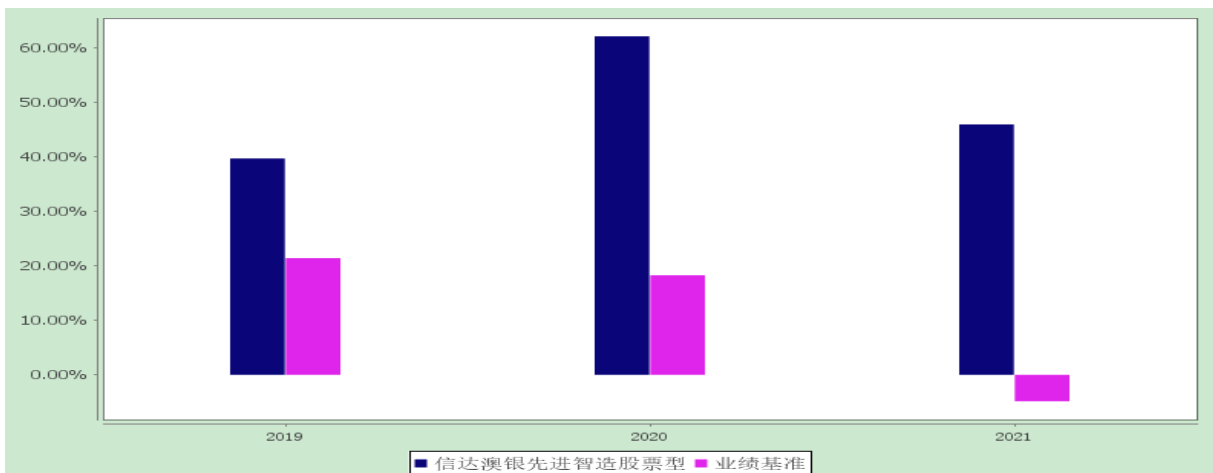
历史走势对比图

(2019 年 1 月 17 日至 2021 年 12 月 31 日)



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

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2019 年 1 月 17 日生效，因此 2019 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

本基金从 2019 年 1 月 17 日（基金合同生效日）至本报告期末未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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	2019-01-17	-	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 3.3005 元，份额累计净值为 3.3005 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 45.88%，同期业绩比较基准收益率为-4.84%。

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《信达澳银先进智造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 1,144,061,238.45 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

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_H14 号

信达澳银先进智造股票型证券投资基金

信达澳银先进智造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先进智造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，后附的信达澳银先进智造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先进智造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先进智造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

信达澳银先进智造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先进智造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先进智造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先进智造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先进智造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：信达澳银先进智造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	217,232,728.17	268,758,857.07
结算备付金		7,744,761.63	1,695,378.01
存出保证金		525,763.71	230,385.64
交易性金融资产	7.4.7.2	3,383,498,315.69	1,322,174,873.33
其中：股票投资		3,382,065,990.68	1,321,247,833.07
基金投资		-	-
债券投资		1,432,325.01	927,040.26
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		1,871,152.60	8,000,000.31

应收利息	7.4.7.5	26,947.40	14,006.90
应收股利		-	-
应收申购款		3,506,813.64	3,964,601.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,614,406,482.84	1,604,838,102.47
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		6,643,911.13	35,576,995.07
应付赎回款		19,081,160.86	41,433,655.66
应付管理人报酬		4,581,852.52	1,836,496.03
应付托管费		763,642.09	306,082.68
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,335,711.39	1,751,461.00
应交税费		9.95	13.31
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	239,319.41	288,524.06
负债合计		35,645,607.35	81,193,227.81
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,084,308,785.51	673,459,687.85
未分配利润	7.4.7.10	2,494,452,089.98	850,185,186.81
所有者权益合计		3,578,760,875.49	1,523,644,874.66
负债和所有者权益总计		3,614,406,482.84	1,604,838,102.47

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，信达澳银先进智造股票型证券投资基金基金份额净值 3.3005 元，基金份额总额 1,084,308,785.51 份。

7.2 利润表

会计主体：信达澳银先进智造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		800,729,127.82	413,695,703.02
1.利息收入		794,304.25	576,730.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	792,914.94	573,816.75
债券利息收入		1,389.31	2,913.81
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）		588,981,469.59	209,429,417.09
其中：股票投资收益	7.4.7.12	579,907,643.98	202,412,891.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	68,020.05	1,357,806.61
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	9,005,805.56	5,658,718.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	203,215,139.22	193,895,562.72
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	7,738,214.76	9,793,992.65
减：二、费用		61,696,395.63	26,937,745.55
1. 管理人报酬	7.4.10.2	34,695,262.09	16,608,202.33
2. 托管费	7.4.10.2	5,782,543.55	2,768,033.76
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	20,953,212.13	7,307,787.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6. 税金及附加		4.71	10.09
7. 其他费用	7.4.7.19	265,373.15	253,711.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		739,032,732.19	386,757,957.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		739,032,732.19	386,757,957.47

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信达澳银先进智造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）	673,459,687.85	850,185,186.81	1,523,644,874.66
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	739,032,732.19	739,032,732.19
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）	410,849,097.66	905,234,170.98	1,316,083,268.64
其中：1.基金申购款	1,372,227,471.21	2,529,222,910.71	3,901,450,381.92
2.基金赎回款	-961,378,373.55	-1,623,988,739.73	-2,585,367,113.28
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）	1,084,308,785.51	2,494,452,089.98	3,578,760,875.49
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）	93,873,795.08	37,212,245.61	131,086,040.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	386,757,957.47	386,757,957.47
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）	579,585,892.77	426,214,983.73	1,005,800,876.50
其中：1.基金申购款	1,806,659,260.92	1,591,267,734.99	3,397,926,995.91
2.基金赎回款	-1,227,073,368.15	-1,165,052,751.26	-2,392,126,119.41
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）	673,459,687.85	850,185,186.81	1,523,644,874.66

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

信达澳银先进智造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[2018]第 1171 号《关于准予信达澳银先进智造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《信达澳银先进智造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(2019)第 60467227_H01 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2019 年 1 月 17 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 306,751,651.14 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 75,496.62 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 306,827,147.76 元,折合 306,827,147.76 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")。

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)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票")、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、货币市场工具(含同业存单)、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为 80%-95%,其中,港股通标的股票投资比例为股票资产的 0%-50%;投资于先进智造主题相关的上市公司证券的比例不低于基金非现金资产的 80%;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,保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零,本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择

将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中证综合债指数收益率*20%。

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小层次输入值，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	217,232,728.17	268,758,857.07
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	217,232,728.17	268,758,857.07

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		2,963,496,474.49	3,382,065,990.68	418,569,516.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	865,700.00	1,432,325.01	566,625.01
	银行间市场	-	-	-
	合计	865,700.00	1,432,325.01	566,625.01
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,964,362,174.49	3,383,498,315.69	419,136,141.20
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		1,105,461,571.35	1,321,247,833.07	215,786,261.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	792,300.00	927,040.26	134,740.26
	银行间市场	-	-	-
	合计	792,300.00	927,040.26	134,740.26
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-

其他	-	-	-
合计	1,106,253,871.35	1,322,174,873.33	215,921,001.98

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	22,610.71	12,901.25
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	3,833.61	839.19
应收债券利息	242.82	152.39
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	260.26	114.07
合计	26,947.40	14,006.90

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	4,335,711.39	1,751,461.00
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	4,335,711.39	1,751,461.00

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	24,819.41	84,024.06
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	214,500.00	204,500.00
合计	239,319.41	288,524.06

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	673,459,687.85	673,459,687.85
本期申购	1,372,227,471.21	1,372,227,471.21
本期赎回（以“-”号填列）	-961,378,373.55	-961,378,373.55
本期末	1,084,308,785.51	1,084,308,785.51

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	298,463,193.59	551,721,993.22	850,185,186.81
本期利润	535,817,592.97	203,215,139.22	739,032,732.19
本期基金份额交易产生的变动数	309,780,451.89	595,453,719.09	905,234,170.98
其中：基金申购款	924,692,972.94	1,604,529,937.77	2,529,222,910.71
基金赎回款	-614,912,521.05	-1,009,076,218.68	-1,623,988,739.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,144,061,238.45	1,350,390,851.53	2,494,452,089.98

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	649,701.97	534,128.83
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	94,204.56	25,636.19
其他	49,008.41	14,051.73
合计	792,914.94	573,816.75

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	6,738,694,871.21	2,214,242,095.04
减：卖出股票成本总额	6,158,787,227.23	2,011,829,203.31
买卖股票差价收入	579,907,643.98	202,412,891.73

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	190,312.73	3,751,751.94
减：卖出债券（债转股	122,100.00	2,391,100.00

及债券到期兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	192.68	2,845.33
买卖债券差价收入	68,020.05	1,357,806.61

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	9,005,805.56	5,658,718.75
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	9,005,805.56	5,658,718.75

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	203,215,139.22	193,895,562.72
——股票投资	202,783,254.47	193,760,822.46

——债券投资	431,884.75	134,740.26
——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	203,215,139.22	193,895,562.72

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	7,574,493.63	9,781,985.53
基金转换费收入	163,721.13	12,007.12
合计	7,738,214.76	9,793,992.65

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	20,953,212.13	7,307,787.81
银行间市场交易费用	-	-
合计	20,953,212.13	7,307,787.81

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	90,000.00	80,000.00
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	37,013.15	35,351.56
合计	265,373.15	253,711.56

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	1,050,181,928.43	7.15%	5,196,850.00	0.10%

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

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债券交易。

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	978,038.31	7.60%	698,597.68	16.11%
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	4,915.75	0.11%	-	-

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	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

当期发生的基金应支付的管理费	34,695,262.09	16,608,202.33
其中：支付销售机构的客户维护费	7,218,475.34	5,325,297.35

注：支付基金管理人信达澳银基金管理公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，每日计提，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	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
当期发生的基金应支付的托管费	5,782,543.55	2,768,033.76

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，每日计提，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自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自有资金投资本基金。

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	217,232,728.17	649,701.97	268,758,857.07	534,128.83

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

本基金本期及上年度可比期间无利润分配。

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
60145 6	国 联 证 券	2021- 10-19	2022 -04- 15	非 公 开 发 行 流 通 受 限	11.2 2	13.45	926,916	10,399,997.52	12,467,020.20	-

				限						
300745	欣锐科技	2021-10-20	2022-04-22	非公开发行流通受限	29.25	56.84	104,274	3,050,014.50	5,926,934.16	-
002837	英维克	2021-12-13	2022-06-13	大宗交易买入	41.76	36.04	120,000	5,011,200.00	4,324,800.00	-
002837	英维克	2021-10-21	2022-04-25	非公开发行流通受限	25.58	36.94	79,359	2,030,003.22	2,931,521.46	-
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	-
688800	瑞可达	2021-07-14	2022-01-24	新股流通受限	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	-
688767	博拓生物	2021-09-01	2022-03-08	新股流通受限	34.55	66.38	2,220	76,701.00	147,363.60	-
688071	华依科技	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
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	-
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	-
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	-
301058	中粮工	2021-09-01	2022-03-09	新股流通受限	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-

	科									
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	409	23,754.72	20,388.65	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
301185	鸥玛	2021-11-11	2022-05-	新股流通	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-

	软件		19	受限							
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	-	
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-18	新股流通受限	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-	
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	-	
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-07	新股流通受限	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-	
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	-	
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	-	
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	-	
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-19	新股流通受限	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-	
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	-	
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	-	
301033	迈普医	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-	

	学									
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
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	-
30103	保	2021-	2022	新股	14.8	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-

7	立佳	07-21	-02-07	流通受限	2					
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	-
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	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	新股流通受限	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
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

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	-	-	770,500	7,413,891.72	8,436,975.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无质押债券。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

本基金为股票型基金，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。本基金若投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。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）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、货币市场工具（含同业存单）、银行存款、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金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	1,432,325.01	927,040.26
未评级	-	-
合计	1,432,325.01	927,040.26

注：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、及存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	217,232,728.17	-	-	-	217,232,728.17
结算备付金	7,744,761.63	-	-	-	7,744,761.63

存出保证金	525,763.71	-	-	-	525,763.71
交易性金融资产	-	1,048,343.46	383,981.55	3,382,065,990.68	3,383,498,315.69
应收利息	-	-	-	26,947.40	26,947.40
应收申购款	7,125.78	-	-	3,499,687.86	3,506,813.64
应收证券清算款	-	-	-	1,871,152.60	1,871,152.60
资产总计	225,510,379.29	1,048,343.46	383,981.55	3,387,463,778.54	3,614,406,482.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,081,160.86	19,081,160.86
应付管理人报酬	-	-	-	4,581,852.52	4,581,852.52
应付托管费	-	-	-	763,642.09	763,642.09
应付证券清算款	-	-	-	6,643,911.13	6,643,911.13
应付交易费用	-	-	-	4,335,711.39	4,335,711.39
应交税费	-	-	-	9.95	9.95
其他负债	-	-	-	239,319.41	239,319.41
负债总计	-	-	-	35,645,607.35	35,645,607.35
利率敏感度缺口	225,510,379.29	1,048,343.46	383,981.55	3,351,818,171.19	3,578,760,875.49
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	268,758,857.07	-	-	-	268,758,857.07
结算备付金	1,695,378.01	-	-	-	1,695,378.01
存出保证金	230,385.64	-	-	-	230,385.64
交易性金融资产	927,040.26	-	-	1,321,247,833.07	1,322,174,873.33
应收证券清算款	-	-	-	8,000,000.31	8,000,000.31
应收利息	-	-	-	14,006.90	14,006.90
应收申购款	-	-	-	3,964,601.21	3,964,601.21
资产总计	271,611,660.98	-	-	1,333,226,441.49	1,604,838,102.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	35,576,995.07	35,576,995.07
应付赎回款	-	-	-	41,433,655.66	41,433,655.66
应付管理人报酬	-	-	-	1,836,496.03	1,836,496.03

应付托管费	-	-	-	306,082.68	306,082.68
应付交易费用	-	-	-	1,751,461.00	1,751,461.00
应交税费	-	-	-	13.31	13.31
其他负债	-	-	-	288,524.06	288,524.06
负债总计	-	-	-	81,193,227.81	81,193,227.81
利率敏感度缺口	271,611,660.98	-	-	1,252,033,213.68	1,523,644,874.66

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

本年度末，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

上年度末，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为 0.0608%，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金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，港股通标的股票投资比例为股票资产的 0%-50%；投资于先进智造主题相关的上市公司证券的比例不低于基金非现金资产的 80%；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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低

于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。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	3,382,065,990.68	94.50	1,321,247,833.07	86.72
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	3,382,065,990.68	94.50	1,321,247,833.07	86.72

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%	12,840.00	8,239.00
沪深 300 指数下降 5%	-12,840.00	-8,239.00

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 3,347,558,342.34 元，属于第二层次的余额为人民币 35,939,973.35 元，无属于第三层次余额。(于 2020 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 1,267,021,062.56 元，属于第二层次的余额为人民币 55,153,810.77 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	3,382,065,990.68	93.57
	其中：股票	3,382,065,990.68	93.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,432,325.01	0.04

	其中：债券	1,432,325.01	0.04
	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	224,977,489.80	6.22
8	其他各项资产	5,930,677.35	0.16
9	合计	3,614,406,482.84	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	1,940,169.60	0.05
B	采矿业	14,551,147.96	0.41
C	制造业	2,904,562,630.01	81.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	121,590,102.77	3.40
E	建筑业	59,226,910.97	1.65
F	批发和零售业	12,760,478.35	0.36
G	交通运输、仓储和邮政业	33,302,164.45	0.93

H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	116,815,212.66	3.26
J	金融业	22,709,534.83	0.63
K	房地产业	19,382,416.22	0.54
L	租赁和商务服务业	4,344,407.23	0.12
M	科学研究和技术服务业	1,263,919.80	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	13,978,055.63	0.39
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	55,578,163.98	1.55
	合计	3,382,065,990.68	94.50

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	769,273	123,552,936.53	3.45
2	000063	中兴通讯	2,413,237	80,843,439.50	2.26
3	002466	天齐锂业	633,212	67,753,684.00	1.89
4	600563	法拉电子	262,484	61,001,281.60	1.70
5	600673	东阳光	6,251,285	55,511,410.80	1.55
6	300750	宁德时代	90,276	53,082,288.00	1.48

7	300207	欣旺达	1,253,792	52,859,870.72	1.48
8	002876	三利谱	782,764	48,907,094.72	1.37
9	002460	赣锋锂业	331,871	47,407,772.35	1.32
10	600516	方大炭素	4,288,999	46,406,969.18	1.30
11	300035	中科电气	1,466,471	44,360,747.75	1.24
12	688772	珠海冠宇	864,529	42,059,335.85	1.18
13	002179	中航光电	415,688	41,801,585.28	1.17
14	300457	赢合科技	1,282,191	39,388,907.52	1.10
15	601877	正泰电器	711,700	38,353,513.00	1.07
16	600210	紫江企业	3,948,086	36,243,429.48	1.01
17	002741	光华科技	1,624,400	34,079,912.00	0.95
18	300638	广和通	613,120	33,415,040.00	0.93
19	600703	三安光电	835,027	31,363,614.12	0.88
20	600741	华域汽车	1,081,705	30,612,251.50	0.86
21	002664	长鹰信质	1,504,700	29,868,295.00	0.83
22	688187	时代电气	363,163	29,779,366.00	0.83
23	300679	电连技术	562,100	29,510,250.00	0.82
24	002484	江海股份	1,050,281	28,693,676.92	0.80
25	002273	水晶光电	1,591,282	27,672,393.98	0.77
26	300593	新雷能	469,827	25,549,192.26	0.71
27	002635	安洁科技	1,489,300	25,362,779.00	0.71
28	603982	泉峰汽车	526,100	24,726,700.00	0.69
29	603989	艾华集团	581,910	24,091,074.00	0.67
30	600745	闻泰科技	185,263	23,954,505.90	0.67
31	688595	芯海科技	190,970	23,766,216.50	0.66
32	000858	五粮液	106,411	23,693,473.26	0.66
33	688148	芳源股份	670,627	23,465,238.73	0.66
34	600114	东睦股份	1,920,600	22,567,050.00	0.63
35	002824	和胜股份	493,719	22,400,031.03	0.63
36	002916	深南电路	182,551	22,238,362.82	0.62
37	603799	华友钴业	200,166	22,080,311.46	0.62
38	601919	中远海控	1,180,763	22,068,460.47	0.62
39	300088	长信科技	1,631,203	21,662,375.84	0.61
40	002988	豪美新材	1,049,839	21,637,181.79	0.60
41	600905	三峡能源	2,842,042	21,343,735.42	0.60
42	002060	粤水电	3,837,753	21,299,529.15	0.60
43	600519	贵州茅台	10,333	21,182,650.00	0.59
44	603383	顶点软件	578,300	20,760,970.00	0.58
45	300115	长盈精密	1,030,524	20,445,596.16	0.57
46	002705	新宝股份	816,609	20,170,242.30	0.56
47	300811	铂科新材	201,400	19,793,592.00	0.55
48	002837	英维克	501,221	19,599,458.64	0.55

49	002594	比亚迪	72,784	19,514,846.08	0.55
50	300769	德方纳米	38,903	19,107,597.48	0.53
51	002101	广东鸿图	1,604,200	18,897,476.00	0.53
52	002436	兴森科技	1,301,410	18,219,740.00	0.51
53	300432	富临精工	615,390	18,092,466.00	0.51
54	002050	三花智控	710,121	17,966,061.30	0.50
55	300890	翔丰华	289,259	17,884,883.97	0.50
56	002463	沪电股份	1,061,325	17,596,768.50	0.49
57	000568	泸州老窖	68,904	17,492,658.48	0.49
58	002472	双环传动	626,220	17,271,147.60	0.48
59	002049	紫光国微	76,601	17,235,225.00	0.48
60	300687	赛意信息	560,723	16,361,897.14	0.46
61	002706	良信股份	914,300	16,292,826.00	0.46
62	002540	亚太科技	2,101,978	16,185,230.60	0.45
63	600418	江淮汽车	886,300	15,421,620.00	0.43
64	688390	固德威	32,734	15,043,891.72	0.42
65	000539	粤电力A	2,359,604	14,511,564.60	0.41
66	600098	广州发展	1,694,334	13,690,218.72	0.38
67	688077	大地熊	173,779	13,414,001.01	0.37
68	300748	金力永磁	292,600	13,134,814.00	0.37
69	000030	富奥股份	1,759,175	13,053,078.50	0.36
70	002459	晶澳科技	138,772	12,864,164.40	0.36
71	002583	海能达	2,325,800	12,838,416.00	0.36
72	688036	传音控股	81,650	12,810,885.00	0.36
73	002284	亚太股份	1,225,100	12,753,291.00	0.36
74	002136	安纳达	774,235	12,589,061.10	0.35
75	601456	国联证券	926,916	12,467,020.20	0.35
76	002139	拓邦股份	661,478	12,363,023.82	0.35
77	601985	中国核电	1,484,355	12,320,146.50	0.34
78	300531	优博讯	601,508	12,288,808.44	0.34
79	603319	湘油泵	476,300	12,250,436.00	0.34
80	300930	屹通新材	377,000	12,229,880.00	0.34
81	688599	天合光能	154,331	12,176,715.90	0.34
82	002918	蒙娜丽莎	412,000	11,795,560.00	0.33
83	601012	隆基股份	135,160	11,650,792.00	0.33
84	002957	科瑞技术	444,393	11,300,913.99	0.32
85	688005	容百科技	96,500	11,153,470.00	0.31
86	601800	中国交建	1,276,741	10,954,437.78	0.31
87	600728	佳都科技	1,313,000	10,937,290.00	0.31
88	688123	聚辰股份	160,692	10,904,559.12	0.30
89	002182	云海金属	473,400	10,859,796.00	0.30
90	002475	立讯精密	218,569	10,753,594.80	0.30

91	300568	星源材质	291,818	10,718,475.14	0.30
92	001914	招商积余	529,000	10,717,540.00	0.30
93	603626	科森科技	883,400	10,680,306.00	0.30
94	600963	岳阳林纸	1,318,590	10,390,489.20	0.29
95	000422	湖北宜化	487,160	10,381,379.60	0.29
96	601669	中国电建	1,262,533	10,201,266.64	0.29
97	601868	中国能建	3,732,090	10,188,605.70	0.28
98	300502	新易盛	253,412	9,928,682.16	0.28
99	601778	晶科科技	1,148,492	9,796,636.76	0.27
100	002745	木林森	635,615	9,616,854.95	0.27
101	688388	嘉元科技	76,401	9,592,145.55	0.27
102	603063	禾望电气	228,788	9,222,444.28	0.26
103	000792	盐湖股份	258,779	9,158,188.81	0.26
104	000810	创维数字	929,000	9,150,650.00	0.26
105	300611	美力科技	810,000	9,136,800.00	0.26
106	300343	联创股份	527,579	8,979,394.58	0.25
107	600110	诺德股份	562,791	8,976,516.45	0.25
108	002959	小熊电器	138,841	8,867,774.67	0.25
109	300919	中伟股份	57,910	8,773,944.10	0.25
110	002176	江特电机	422,500	8,771,100.00	0.25
111	002341	新纶新材	1,582,496	8,719,552.96	0.24
112	300409	道氏技术	357,346	8,665,640.50	0.24
113	603927	中科软	312,400	8,547,264.00	0.24
114	000780	ST 平能	770,500	8,436,975.00	0.24
115	300870	欧陆通	99,800	8,359,248.00	0.23
116	601016	节能风电	1,272,216	8,282,126.16	0.23
117	600933	爱柯迪	423,600	8,167,008.00	0.23
118	002937	兴瑞科技	399,800	8,059,968.00	0.23
119	002236	大华股份	330,002	7,748,446.96	0.22
120	000875	吉电股份	852,331	7,747,688.79	0.22
121	600236	桂冠电力	1,185,360	7,610,011.20	0.21
122	300468	四方精创	376,671	7,604,987.49	0.21
123	002011	盾安环境	552,286	7,566,318.20	0.21
124	300450	先导智能	98,786	7,346,714.82	0.21
125	000049	德赛电池	125,602	7,325,108.64	0.20
126	688499	利元亨	24,909	7,298,337.00	0.20
127	603348	文灿股份	124,100	7,248,681.00	0.20
128	300487	蓝晓科技	73,400	7,218,890.00	0.20
129	300390	天华超净	88,485	7,167,285.00	0.20
130	002600	领益智造	946,148	6,963,649.28	0.19
131	300745	欣锐科技	117,274	6,761,534.16	0.19
132	002328	新朋股份	1,122,400	6,734,400.00	0.19

133	603713	密尔克卫	49,700	6,698,566.00	0.19
134	603693	江苏新能	228,037	6,489,933.02	0.18
135	002859	洁美科技	170,008	6,324,297.60	0.18
136	603359	东珠生态	426,500	6,098,950.00	0.17
137	603290	斯达半导	15,917	6,064,377.00	0.17
138	600887	伊利股份	145,262	6,022,562.52	0.17
139	002782	可立克	335,800	6,000,746.00	0.17
140	601615	明阳智能	228,400	5,961,240.00	0.17
141	600499	科达制造	238,384	5,916,690.88	0.17
142	688519	南亚新材	115,120	5,803,199.20	0.16
143	688536	思瑞浦	7,515	5,771,520.00	0.16
144	002008	大族激光	106,700	5,761,800.00	0.16
145	002536	飞龙股份	670,800	5,721,924.00	0.16
146	600378	昊华科技	117,070	5,642,774.00	0.16
147	300827	上能电气	61,354	5,577,078.60	0.16
148	603816	顾家家居	72,241	5,574,115.56	0.16
149	300917	特发服务	168,500	5,508,265.00	0.15
150	600885	宏发股份	73,468	5,483,651.52	0.15
151	603105	芯能科技	327,861	5,449,049.82	0.15
152	600995	文山电力	272,523	5,415,032.01	0.15
153	600285	羚锐制药	341,500	5,395,700.00	0.15
154	002756	永兴材料	36,400	5,387,928.00	0.15
155	002993	奥海科技	136,500	5,375,370.00	0.15
156	603385	惠达卫浴	481,573	5,345,460.30	0.15
157	002415	海康威视	101,498	5,310,375.36	0.15
158	002091	江苏国泰	386,071	5,300,754.83	0.15
159	003012	东鹏控股	385,100	5,283,572.00	0.15
160	002245	蔚蓝锂芯	189,088	5,201,810.88	0.15
161	605111	新洁能	28,385	5,055,368.50	0.14
162	688711	宏微科技	39,392	4,881,062.72	0.14
163	300661	圣邦股份	15,784	4,877,256.00	0.14
164	600152	维科技术	592,500	4,870,350.00	0.14
165	002138	顺络电子	127,322	4,861,153.96	0.14
166	000045	深纺织 A	511,540	4,859,630.00	0.14
167	601689	拓普集团	90,798	4,812,294.00	0.13
168	000519	中兵红箭	179,920	4,798,466.40	0.13
169	002384	东山精密	176,200	4,775,020.00	0.13
170	600500	中化国际	556,100	4,760,216.00	0.13
171	600690	海尔智家	159,231	4,759,414.59	0.13
172	603040	新坐标	235,200	4,739,280.00	0.13
173	603345	安井食品	27,681	4,727,361.18	0.13
174	300604	长川科技	81,763	4,701,372.50	0.13

175	000333	美的集团	63,298	4,672,025.38	0.13
176	300674	宇信科技	193,297	4,619,798.30	0.13
177	300656	民德电子	86,567	4,601,036.05	0.13
178	002407	多氟多	98,265	4,420,942.35	0.12
179	300124	汇川技术	64,361	4,415,164.60	0.12
180	688323	瑞华泰	113,753	4,382,903.09	0.12
181	601888	中国中免	19,735	4,330,056.35	0.12
182	688518	联赢激光	86,689	4,271,167.03	0.12
183	600809	山西汾酒	13,444	4,245,346.32	0.12
184	000661	长春高新	15,400	4,179,560.00	0.12
185	603166	福达股份	478,000	4,153,820.00	0.12
186	603596	伯特利	58,946	4,102,641.60	0.11
187	002371	北方华创	11,787	4,090,324.74	0.11
188	002832	比音勒芬	160,000	4,072,000.00	0.11
189	002368	太极股份	146,511	4,034,912.94	0.11
190	603978	深圳新星	145,400	3,986,868.00	0.11
191	002938	鹏鼎控股	90,100	3,822,943.00	0.11
192	600491	龙元建设	551,381	3,799,015.09	0.11
193	002708	光洋股份	542,903	3,789,462.94	0.11
194	600522	中天科技	221,564	3,757,725.44	0.11
195	603690	至纯科技	76,174	3,667,778.10	0.10
196	300480	光力科技	106,472	3,654,119.04	0.10
197	688378	奥来德	45,519	3,646,071.90	0.10
198	300647	超频三	444,243	3,633,907.74	0.10
199	603118	共进股份	377,300	3,606,988.00	0.10
200	300059	东方财富	97,085	3,602,824.35	0.10
201	600361	华联综超	625,100	3,594,325.00	0.10
202	300308	中际旭创	84,001	3,570,042.50	0.10
203	600460	士兰微	65,538	3,552,159.60	0.10
204	002851	麦格米特	110,826	3,548,648.52	0.10
205	000883	湖北能源	677,034	3,547,658.16	0.10
206	600216	浙江医药	207,400	3,542,392.00	0.10
207	603288	海天味业	33,628	3,534,639.08	0.10
208	603026	石大胜华	17,784	3,521,054.16	0.10
209	002068	黑猫股份	331,248	3,478,104.00	0.10
210	600237	铜峰电子	367,800	3,475,710.00	0.10
211	601727	上海电气	713,121	3,465,768.06	0.10
212	600038	中直股份	42,979	3,451,213.70	0.10
213	000591	太阳能	307,582	3,444,918.40	0.10
214	300655	晶瑞电材	82,432	3,444,008.96	0.10
215	600702	舍得酒业	14,956	3,399,498.80	0.09
216	002557	洽洽食品	54,700	3,356,392.00	0.09

217	300037	新宙邦	29,451	3,327,963.00	0.09
218	002884	凌霄泵业	118,470	3,313,605.90	0.09
219	603899	晨光文具	51,300	3,309,363.00	0.09
220	300659	中孚信息	71,600	3,247,060.00	0.09
221	300660	江苏雷利	108,800	3,187,840.00	0.09
222	600309	万华化学	31,008	3,131,808.00	0.09
223	300083	创世纪	217,309	3,103,172.52	0.09
224	601222	林洋能源	255,500	3,099,215.00	0.09
225	002063	远光软件	308,800	3,069,472.00	0.09
226	688678	福立旺	93,000	3,049,470.00	0.09
227	600562	国睿科技	164,800	3,029,024.00	0.08
228	600406	国电南瑞	74,800	2,994,244.00	0.08
229	600660	福耀玻璃	63,265	2,982,312.10	0.08
230	300428	立中集团	112,945	2,970,453.50	0.08
231	603138	海量数据	182,246	2,895,888.94	0.08
232	300433	蓝思科技	125,968	2,894,744.64	0.08
233	688299	长阳科技	88,255	2,885,938.50	0.08
234	300614	百川畅银	59,835	2,872,080.00	0.08
235	002025	航天电器	34,200	2,871,090.00	0.08
236	600366	宁波韵升	216,000	2,853,360.00	0.08
237	300775	三角防务	57,403	2,806,432.67	0.08
238	600600	青岛啤酒	28,300	2,801,700.00	0.08
239	601238	广汽集团	182,369	2,770,185.11	0.08
240	002709	天赐材料	24,100	2,763,065.00	0.08
241	688107	安路科技	37,584	2,694,772.80	0.08
242	000408	藏格矿业	64,923	2,661,843.00	0.07
243	002922	伊戈尔	129,234	2,624,742.54	0.07
244	600111	北方稀土	56,918	2,606,844.40	0.07
245	002497	雅化集团	90,314	2,588,399.24	0.07
246	688200	华峰测控	5,012	2,565,642.80	0.07
247	688368	晶丰明源	7,982	2,555,038.20	0.07
248	002531	天顺风能	129,400	2,509,066.00	0.07
249	600776	东方通信	216,700	2,494,217.00	0.07
250	002352	顺丰控股	36,000	2,481,120.00	0.07
251	600577	精达股份	332,600	2,474,544.00	0.07
252	300408	三环集团	54,723	2,440,645.80	0.07
253	002085	万丰奥威	438,600	2,407,914.00	0.07
254	300319	麦捷科技	156,549	2,395,199.70	0.07
255	300001	特锐德	96,300	2,394,981.00	0.07
256	300188	美亚柏科	134,419	2,310,662.61	0.06
257	603305	旭升股份	45,900	2,289,492.00	0.06
258	603020	爱普股份	160,458	2,281,712.76	0.06

259	002271	东方雨虹	42,168	2,221,410.24	0.06
260	002056	横店东磁	117,231	2,212,148.97	0.06
261	300131	英唐智控	271,223	2,207,755.22	0.06
262	002196	方正电机	187,100	2,185,328.00	0.06
263	688800	瑞可达	15,671	2,171,346.63	0.06
264	300274	阳光电源	14,526	2,117,890.80	0.06
265	300671	富满微	25,600	2,074,880.00	0.06
266	688025	杰普特	26,819	2,066,403.95	0.06
267	300438	鹏辉能源	43,700	2,064,388.00	0.06
268	600970	中材国际	178,206	2,036,894.58	0.06
269	000559	万向钱潮	318,000	2,025,660.00	0.06
270	600085	同仁堂	44,370	1,995,762.60	0.06
271	002266	浙富控股	278,201	1,980,791.12	0.06
272	688080	映翰通	22,469	1,970,531.30	0.06
273	002180	纳思达	41,153	1,965,467.28	0.05
274	002714	牧原股份	36,360	1,940,169.60	0.05
275	002036	联创电子	78,100	1,894,706.00	0.05
276	002212	天融信	98,745	1,892,941.65	0.05
277	002241	歌尔股份	34,299	1,855,575.90	0.05
278	688008	澜起科技	22,060	1,850,172.20	0.05
279	000799	酒鬼酒	8,700	1,848,750.00	0.05
280	688396	华润微	28,618	1,848,722.80	0.05
281	688007	光峰科技	53,591	1,840,850.85	0.05
282	002507	涪陵榨菜	48,600	1,837,080.00	0.05
283	603612	索通发展	89,281	1,832,046.12	0.05
284	000762	西藏矿业	34,391	1,827,193.83	0.05
285	000921	海信家电	120,600	1,827,090.00	0.05
286	300505	川金诺	59,002	1,807,821.28	0.05
287	002643	万润股份	76,100	1,799,004.00	0.05
288	002142	宁波银行	46,884	1,794,719.52	0.05
289	002240	盛新锂能	30,813	1,785,613.35	0.05
290	600036	招商银行	36,594	1,782,493.74	0.05
291	300693	盛弘股份	48,204	1,768,604.76	0.05
292	300623	捷捷微电	56,046	1,763,207.16	0.05
293	688359	三孚新科	29,972	1,758,157.52	0.05
294	603893	瑞芯微	12,700	1,738,630.00	0.05
295	002805	丰元股份	55,050	1,736,827.50	0.05
296	002080	中材科技	51,037	1,736,278.74	0.05
297	000938	紫光股份	75,792	1,731,847.20	0.05
298	688408	中信博	9,594	1,693,436.94	0.05
299	603516	淳中科技	83,070	1,684,659.60	0.05
300	600585	海螺水泥	41,800	1,684,540.00	0.05

301	600872	中炬高新	43,900	1,666,883.00	0.05
302	688020	方邦股份	18,047	1,644,984.05	0.05
303	000596	古井贡酒	6,700	1,634,800.00	0.05
304	603588	高能环境	90,440	1,589,030.80	0.04
305	600297	广汇汽车	593,700	1,585,179.00	0.04
306	000400	许继电气	60,539	1,580,067.90	0.04
307	603897	长城科技	31,300	1,559,992.00	0.04
308	002405	四维图新	96,400	1,534,688.00	0.04
309	600487	亨通光电	99,888	1,510,306.56	0.04
310	600141	兴发集团	39,218	1,485,577.84	0.04
311	300014	亿纬锂能	12,563	1,484,695.34	0.04
312	002335	科华数据	40,680	1,479,124.80	0.04
313	688128	中国电研	49,822	1,472,738.32	0.04
314	688608	恒玄科技	4,816	1,468,880.00	0.04
315	002312	川发龙蟒	112,208	1,467,680.64	0.04
316	600011	华能国际	150,091	1,454,381.79	0.04
317	603938	三孚股份	39,500	1,453,205.00	0.04
318	603936	博敏电子	83,833	1,441,927.60	0.04
319	601577	长沙银行	183,400	1,432,354.00	0.04
320	001979	招商蛇口	106,791	1,424,591.94	0.04
321	300699	光威复材	16,700	1,410,816.00	0.04
322	600850	电科数字	40,600	1,385,678.00	0.04
323	603179	新泉股份	31,900	1,380,632.00	0.04
324	688023	安恒信息	5,476	1,373,052.24	0.04
325	600096	云天化	69,930	1,372,026.60	0.04
326	603283	赛腾股份	45,842	1,347,754.80	0.04
327	300866	安克创新	12,761	1,308,002.50	0.04
328	601633	长城汽车	26,446	1,283,688.84	0.04
329	300114	中航电测	72,100	1,274,728.00	0.04
330	300077	国民技术	50,868	1,270,682.64	0.04
331	002192	融捷股份	9,729	1,266,229.35	0.04
332	002897	意华股份	22,300	1,262,403.00	0.04
333	688122	西部超导	12,647	1,226,000.18	0.03
334	688181	八亿时空	25,048	1,187,275.20	0.03
335	300351	永贵电器	79,300	1,176,812.00	0.03
336	003021	兆威机电	14,660	1,170,601.00	0.03
337	002970	锐明技术	27,674	1,139,061.84	0.03
338	300346	南大光电	24,321	1,129,467.24	0.03
339	300454	深信服	5,900	1,126,900.00	0.03
340	603505	金石资源	30,769	1,114,760.87	0.03
341	600048	保利发展	70,474	1,101,508.62	0.03
342	002895	川恒股份	44,494	1,098,556.86	0.03

343	002434	万里扬	73,700	1,086,338.00	0.03
344	603203	快克股份	29,431	1,085,120.97	0.03
345	300211	亿通科技	84,200	1,077,760.00	0.03
346	688793	倍轻松	10,303	1,076,663.50	0.03
347	600023	浙能电力	260,495	1,052,399.80	0.03
348	688508	芯朋微	9,064	1,050,155.04	0.03
349	300729	乐歌股份	35,500	1,043,700.00	0.03
350	000777	中核科技	66,300	1,042,236.00	0.03
351	000027	深圳能源	127,335	1,031,413.50	0.03
352	603606	东方电缆	20,000	1,023,200.00	0.03
353	300474	景嘉微	6,663	1,014,108.60	0.03
354	600990	四创电子	17,800	999,826.00	0.03
355	002906	华阳集团	18,050	992,028.00	0.03
356	300763	锦浪科技	4,279	990,802.45	0.03
357	000876	新希望	64,700	984,087.00	0.03
358	002649	博彦科技	82,900	968,272.00	0.03
359	300473	德尔股份	40,600	940,296.00	0.03
360	603109	神驰机电	32,167	917,081.17	0.03
361	600367	红星发展	49,345	916,830.10	0.03
362	003022	联泓新科	25,075	913,733.00	0.03
363	600888	新疆众和	110,000	909,700.00	0.03
364	600674	川投能源	72,700	908,750.00	0.03
365	002074	国轩高科	17,687	906,458.75	0.03
366	603267	鸿远电子	4,996	896,482.24	0.03
367	300709	精研科技	14,699	881,205.05	0.02
368	000821	京山轻机	63,400	874,286.00	0.02
369	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.02
370	688561	奇安信	9,921	872,254.32	0.02
371	002920	德赛西威	6,094	862,361.94	0.02
372	002752	昇兴股份	127,500	860,625.00	0.02
373	300365	恒华科技	79,936	859,312.00	0.02
374	300648	星云股份	13,816	831,585.04	0.02
375	300979	华利集团	9,246	823,356.30	0.02
376	002326	永太科技	15,990	818,847.90	0.02
377	603100	川仪股份	38,178	807,846.48	0.02
378	600477	杭萧钢构	195,296	806,572.48	0.02
379	301067	显盈科技	16,400	802,616.00	0.02
380	002135	东南网架	69,292	801,015.52	0.02
381	600875	东方电气	36,800	788,256.00	0.02
382	603501	韦尔股份	2,533	787,180.41	0.02
383	600025	华能水电	119,297	786,167.23	0.02
384	002043	兔宝宝	64,400	777,952.00	0.02

385	688598	金博股份	2,181	774,342.24	0.02
386	603078	江化微	29,006	770,979.48	0.02
387	300799	左江科技	7,866	739,404.00	0.02
388	600536	中国软件	14,433	720,639.69	0.02
389	600150	中国船舶	28,953	717,744.87	0.02
390	002386	天原股份	56,352	717,360.96	0.02
391	300477	合纵科技	89,086	717,142.30	0.02
392	600170	上海建工	197,000	709,200.00	0.02
393	600893	航发动力	11,068	702,375.28	0.02
394	688425	铁建重工	135,282	685,879.74	0.02
395	002986	宇新股份	18,990	683,260.20	0.02
396	603918	金桥信息	74,200	675,962.00	0.02
397	002845	同兴达	22,770	672,853.50	0.02
398	300456	赛微电子	27,291	670,266.96	0.02
399	600438	通威股份	14,900	669,904.00	0.02
400	600219	南山铝业	142,143	669,493.53	0.02
401	688521	芯原股份	8,599	665,218.64	0.02
402	002149	西部材料	35,417	655,922.84	0.02
403	300598	诚迈科技	10,172	650,906.28	0.02
404	300369	绿盟科技	41,000	650,260.00	0.02
405	601111	中国国航	71,000	648,230.00	0.02
406	002409	雅克科技	7,958	645,950.86	0.02
407	600199	金种子酒	38,100	644,271.00	0.02
408	600029	南方航空	94,100	640,821.00	0.02
409	688110	东芯股份	14,044	634,507.92	0.02
410	688002	睿创微纳	8,054	632,802.78	0.02
411	600884	杉杉股份	19,168	628,135.36	0.02
412	002533	金杯电工	72,500	624,225.00	0.02
413	000831	五矿稀土	15,700	612,614.00	0.02
414	601225	陕西煤业	46,687	569,581.40	0.02
415	000570	苏常柴A	97,153	568,345.05	0.02
416	603663	三祥新材	20,000	555,000.00	0.02
417	002645	华宏科技	22,700	553,880.00	0.02
418	601177	杭齿前进	61,408	553,286.08	0.02
419	688133	泰坦科技	2,527	551,391.40	0.02
420	605399	晨光新材	13,707	544,304.97	0.02
421	000012	南玻A	54,709	543,260.37	0.02
422	600066	宇通客车	48,700	536,674.00	0.01
423	300097	智云股份	63,076	534,253.72	0.01
424	002488	金固股份	60,800	533,824.00	0.01
425	300822	贝仕达克	22,709	510,498.32	0.01
426	002439	启明星辰	17,100	487,863.00	0.01

427	603931	格林达	14,362	473,946.00	0.01
428	603650	彤程新材	9,387	472,353.84	0.01
429	601226	华电重工	69,494	471,169.32	0.01
430	002191	劲嘉股份	30,877	467,169.01	0.01
431	603568	伟明环保	12,528	457,647.84	0.01
432	600619	海立股份	55,000	447,150.00	0.01
433	300379	东方通	15,106	446,080.18	0.01
434	688116	天奈科技	2,896	432,343.84	0.01
435	002738	中矿资源	6,133	431,517.88	0.01
436	603678	火炬电子	5,637	426,439.05	0.01
437	002039	黔源电力	20,220	426,237.60	0.01
438	600021	上海电力	32,466	416,214.12	0.01
439	000915	华特达因	13,555	412,885.30	0.01
440	688526	科前生物	14,620	402,488.60	0.01
441	600742	一汽富维	33,138	396,330.48	0.01
442	600496	精工钢构	92,956	395,992.56	0.01
443	000776	广发证券	15,722	386,603.98	0.01
444	002743	富煌钢构	53,868	385,694.88	0.01
445	300112	万讯自控	27,220	384,346.40	0.01
446	601231	环旭电子	23,700	380,622.00	0.01
447	000887	中鼎股份	17,390	379,275.90	0.01
448	601006	大秦铁路	58,662	375,436.80	0.01
449	601838	成都银行	31,172	374,064.00	0.01
450	300041	回天新材	19,896	368,871.84	0.01
451	603195	公牛集团	2,200	368,060.00	0.01
452	300852	四会富仕	6,300	368,046.00	0.01
453	603587	地素时尚	19,192	367,718.72	0.01
454	601127	小康股份	6,163	367,006.65	0.01
455	000002	万科A	18,573	367,002.48	0.01
456	300046	台基股份	15,736	366,176.72	0.01
457	002125	湘潭电化	31,728	361,699.20	0.01
458	002881	美格智能	8,389	359,720.32	0.01
459	601377	兴业证券	36,336	358,999.68	0.01
460	600104	上汽集团	17,351	357,951.13	0.01
461	000630	铜陵有色	102,837	357,872.76	0.01
462	300459	汤姆猫	64,400	357,420.00	0.01
463	601000	唐山港	129,938	357,329.50	0.01
464	688233	神工股份	4,049	357,121.80	0.01
465	000911	南宁糖业	33,316	356,481.20	0.01
466	300082	奥克股份	23,038	355,937.10	0.01
467	000731	四川美丰	34,239	355,400.82	0.01
468	002885	京泉华	13,590	354,427.20	0.01

469	300034	钢研高纳	6,100	351,360.00	0.01
470	600795	国电电力	110,759	351,106.03	0.01
471	300619	金 银 河	4,022	350,597.74	0.01
472	000625	长安汽车	22,962	348,792.78	0.01
473	002759	天际股份	11,899	348,640.70	0.01
474	600800	渤海化学	73,700	348,601.00	0.01
475	600821	金开新能	36,614	347,466.86	0.01
476	688037	芯 源 微	2,053	346,546.40	0.01
477	688286	敏芯股份	3,694	342,433.80	0.01
478	000958	东方能源	66,888	341,128.80	0.01
479	688686	奥 普 特	1,207	340,579.19	0.01
480	600744	华银电力	57,992	339,253.20	0.01
481	600760	中航沈飞	4,947	336,593.88	0.01
482	603876	鼎胜新材	8,873	334,068.45	0.01
483	300236	上海新阳	8,153	333,050.05	0.01
484	688663	新 风 光	7,026	331,556.94	0.01
485	601827	三峰环境	36,775	328,033.00	0.01
486	601636	旗滨集团	19,068	326,062.80	0.01
487	600426	华鲁恒升	10,399	325,488.70	0.01
488	600312	平高电气	35,699	324,503.91	0.01
489	603906	龙蟠科技	8,757	324,359.28	0.01
490	002034	旺能环境	18,742	323,674.34	0.01
491	603218	日月股份	9,792	322,646.40	0.01
492	688779	长远锂科	13,650	319,956.00	0.01
493	688019	安集科技	1,122	306,530.40	0.01
494	600323	瀚蓝环境	14,609	306,496.82	0.01
495	600316	洪都航空	7,796	304,511.76	0.01
496	600392	盛和资源	15,435	302,834.70	0.01
497	600395	盘江股份	41,645	302,759.15	0.01
498	600346	恒力石化	12,995	298,495.15	0.01
499	000933	神火股份	32,652	296,806.68	0.01
500	300129	泰胜风能	32,073	296,354.52	0.01
501	603993	洛阳钼业	53,027	295,890.66	0.01
502	000100	TCL 科技	46,500	286,905.00	0.01
503	002913	奥 士 康	3,616	283,566.72	0.01
504	601600	中国铝业	45,174	275,109.66	0.01
505	688777	中控技术	3,592	272,560.96	0.01
506	600171	上海贝岭	10,582	271,534.12	0.01
507	000968	蓝焰控股	28,769	268,990.15	0.01
508	603228	景旺电子	7,785	268,816.05	0.01
509	002129	中环股份	6,358	265,446.50	0.01
510	600966	博汇纸业	25,537	264,052.58	0.01

511	000807	云铝股份	23,627	263,913.59	0.01
512	002487	大金重工	6,800	263,500.00	0.01
513	002092	中泰化学	26,689	254,613.06	0.01
514	300248	新开普	16,700	252,504.00	0.01
515	605117	德业股份	900	246,411.00	0.01
516	002340	格林美	23,600	244,260.00	0.01
517	000004	国华网安	12,400	240,808.00	0.01
518	603027	千禾味业	10,000	240,800.00	0.01
519	301011	华立科技	3,975	239,295.00	0.01
520	601179	中国西电	41,190	228,604.50	0.01
521	300373	扬杰科技	3,388	227,605.84	0.01
522	688079	美迪凯	14,529	213,140.43	0.01
523	000893	亚钾国际	7,821	208,429.65	0.01
524	300389	艾比森	19,700	203,501.00	0.01
525	300735	光弘科技	13,381	201,651.67	0.01
526	300546	雄帝科技	10,949	195,330.16	0.01
527	600765	中航重机	3,841	193,932.09	0.01
528	300965	恒宇信通	2,800	192,248.00	0.01
529	002579	中京电子	18,572	191,291.60	0.01
530	000768	中航西飞	5,218	190,457.00	0.01
531	688662	富信科技	4,439	188,657.50	0.01
532	688529	豪森股份	6,125	187,363.75	0.01
533	601011	宝泰隆	34,975	185,017.75	0.01
534	300429	强力新材	15,253	184,561.30	0.01
535	002268	卫士通	3,266	182,700.04	0.01
536	600160	巨化股份	13,909	179,565.19	0.01
537	002411	必康股份	14,399	179,267.55	0.01
538	600711	盛屯矿业	16,610	178,225.30	0.00
539	600863	内蒙华电	44,910	176,945.40	0.00
540	600282	南钢股份	47,142	174,425.40	0.00
541	688510	航亚科技	5,991	174,158.37	0.00
542	688308	欧科亿	2,457	173,660.76	0.00
543	603068	博通集成	3,225	172,731.00	0.00
544	300627	华测导航	3,746	172,316.00	0.00
545	603429	集友股份	6,508	169,858.80	0.00
546	002493	荣盛石化	9,331	169,450.96	0.00
547	600926	杭州银行	13,208	169,326.56	0.00
548	600063	皖维高新	27,477	168,434.01	0.00
549	600019	宝钢股份	23,340	167,114.40	0.00
550	002132	恒星科技	27,268	166,607.48	0.00
551	688677	海泰新光	1,768	166,368.80	0.00
552	002110	三钢闽光	24,294	165,199.20	0.00

553	688256	寒武纪	1,709	162,525.90	0.00
554	000932	华菱钢铁	31,163	159,242.93	0.00
555	300241	瑞丰光电	19,678	156,636.88	0.00
556	002968	新大正	4,420	156,600.60	0.00
557	002518	科士达	6,222	156,172.20	0.00
558	002866	传艺科技	12,357	155,203.92	0.00
559	600596	新安股份	6,164	154,038.36	0.00
560	300579	数字认证	3,800	153,900.00	0.00
561	000825	太钢不锈	21,612	152,148.48	0.00
562	600782	新钢股份	28,158	148,674.24	0.00
563	688767	博拓生物	2,220	147,363.60	0.00
564	600581	八一钢铁	23,472	145,761.12	0.00
565	688560	明冠新材	4,103	141,922.77	0.00
566	688619	罗普特	5,856	127,719.36	0.00
567	000962	东方钨业	10,674	125,846.46	0.00
568	000021	深科技	7,695	121,888.80	0.00
569	603738	泰晶科技	2,020	119,786.00	0.00
570	605376	博迁新材	1,421	119,406.63	0.00
571	688006	杭可科技	1,109	119,306.22	0.00
572	002967	广电计量	4,357	117,987.56	0.00
573	300410	正业科技	9,958	116,906.92	0.00
574	603019	中科曙光	4,235	116,758.95	0.00
575	688138	清溢光电	5,927	113,916.94	0.00
576	000683	远兴能源	15,472	112,945.60	0.00
577	600773	西藏城投	3,783	106,907.58	0.00
578	002861	瀛通通讯	8,060	102,362.00	0.00
579	688216	气派科技	2,000	99,300.00	0.00
580	000070	特发信息	14,785	96,102.50	0.00
581	300865	大宏立	3,311	95,224.36	0.00
582	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.00
583	002812	恩捷股份	270	67,608.00	0.00
584	000009	中国宝安	4,626	66,753.18	0.00
585	688328	深科达	1,499	65,011.63	0.00
586	688096	京源环保	4,485	64,763.40	0.00
587	603995	甬金股份	1,094	63,298.84	0.00
588	300806	斯迪克	1,065	62,835.00	0.00
589	600027	华电国际	11,693	62,557.55	0.00
590	603279	景津环保	1,014	47,029.32	0.00
591	300825	阿尔特	1,642	45,992.42	0.00
592	300855	图南股份	632	44,549.68	0.00
593	600256	广汇能源	6,582	43,046.28	0.00
594	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00

595	603071	物产环能	1,627	41,098.02	0.00
596	002971	和远气体	1,706	40,159.24	0.00
597	600699	均胜电子	1,783	39,172.51	0.00
598	000629	攀钢钒钛	10,023	38,989.47	0.00
599	603986	兆易创新	220	38,687.00	0.00
600	603867	新化股份	1,045	38,518.70	0.00
601	002979	雷赛智能	1,457	37,692.59	0.00
602	000155	川能动力	1,415	37,539.95	0.00
603	300837	浙矿股份	737	37,424.86	0.00
604	002978	安宁股份	881	37,248.68	0.00
605	603043	广州酒家	1,544	37,148.64	0.00
606	601857	中国石油	7,475	36,702.25	0.00
607	601088	中国神华	1,620	36,482.40	0.00
608	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
609	300510	金冠股份	5,459	35,865.63	0.00
610	600497	驰宏锌锗	7,168	35,768.32	0.00
611	601168	西部矿业	2,621	35,671.81	0.00
612	601899	紫金矿业	3,673	35,628.10	0.00
613	300460	惠伦晶体	1,780	35,511.00	0.00
614	600328	中盐化工	2,160	35,445.60	0.00
615	688733	壹石通	443	35,333.68	0.00
616	688135	利扬芯片	841	35,145.39	0.00
617	300657	弘信电子	2,125	35,083.75	0.00
618	688268	华特气体	388	34,997.60	0.00
619	300741	华宝股份	731	34,978.35	0.00
620	601678	滨化股份	4,380	34,908.60	0.00
621	603186	华正新材	830	34,685.70	0.00
622	603217	元利科技	682	34,563.76	0.00
623	688029	南微医学	161	34,239.87	0.00
624	300566	激智科技	1,187	33,734.54	0.00
625	002387	维信诺	3,610	33,500.80	0.00
626	601618	中国中冶	8,681	33,248.23	0.00
627	300802	矩子科技	830	32,868.00	0.00
628	000822	山东海化	4,721	32,810.95	0.00
629	000089	深圳机场	4,399	32,200.68	0.00
630	002185	华天科技	2,505	31,838.55	0.00
631	300223	北京君正	237	31,758.00	0.00
632	002396	星网锐捷	1,326	31,253.82	0.00
633	603486	科沃斯	206	31,095.70	0.00
634	002511	中顺洁柔	1,860	31,080.60	0.00
635	000066	中国长城	2,173	30,769.68	0.00
636	002156	通富微电	1,582	30,738.26	0.00

637	002119	康强电子	2,095	30,209.90	0.00
638	600968	海油发展	10,237	29,994.41	0.00
639	000725	京东方 A	5,878	29,683.90	0.00
640	600584	长电科技	954	29,593.08	0.00
641	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
642	688981	中芯国际	556	29,462.44	0.00
643	002987	京北方	901	28,309.42	0.00
644	603949	雪龙集团	1,225	28,052.50	0.00
645	300793	佳禾智能	1,317	27,907.23	0.00
646	603610	麒盛科技	1,075	27,799.50	0.00
647	300797	钢研纳克	1,582	27,748.28	0.00
648	688012	中微公司	213	26,965.80	0.00
649	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
650	300828	锐新科技	977	25,665.79	0.00
651	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
652	002685	华东重机	6,578	25,062.18	0.00
653	605336	帅丰电器	701	23,904.10	0.00
654	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
655	601686	友发集团	2,374	23,265.20	0.00
656	300787	海能实业	757	20,439.00	0.00
657	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
658	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
659	603216	梦天家居	772	19,523.88	0.00
660	002983	芯瑞达	858	19,442.28	0.00
661	603390	通达电气	2,119	19,431.23	0.00
662	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
663	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
664	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
665	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
666	603687	大胜达	1,462	15,789.60	0.00
667	300798	锦鸡股份	1,586	15,701.40	0.00
668	603983	丸美股份	464	14,787.68	0.00
669	301009	可靠股份	801	14,778.45	0.00
670	300780	德恩精工	935	14,707.55	0.00
671	300805	电声股份	1,028	14,350.88	0.00
672	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
673	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
674	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
675	300817	双飞股份	607	13,105.13	0.00
676	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
677	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
678	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00

679	301013	利和兴	471	12,104.70	0.00
680	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
681	605228	神通科技	1,217	11,281.59	0.00
682	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
683	002981	朝阳科技	490	10,745.70	0.00
684	300823	建科机械	453	10,341.99	0.00
685	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
686	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
687	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
688	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
689	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
690	301012	扬电科技	170	8,608.80	0.00
691	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
692	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
693	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
694	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
695	300998	宁波方正	201	6,699.33	0.00
696	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
697	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
698	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
699	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
700	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
701	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
702	301007	德迈仕	303	6,035.76	0.00
703	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
704	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
705	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
706	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
707	301010	晶雪节能	218	5,227.64	0.00
708	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
709	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
710	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
711	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
712	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
713	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
714	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
715	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
716	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	169,788,863.02	11.14
2	002594	比亚迪	145,763,741.84	9.57
3	603993	洛阳钼业	144,929,238.57	9.51
4	300750	宁德时代	118,981,139.21	7.81
5	000063	中兴通讯	112,011,010.16	7.35
6	002460	赣锋锂业	105,937,895.57	6.95
7	600516	方大炭素	100,958,833.07	6.63
8	002156	通富微电	95,054,170.69	6.24
9	300207	欣旺达	93,320,726.14	6.12
10	300457	赢合科技	87,699,846.01	5.76
11	603659	璞泰来	84,541,941.26	5.55
12	000858	五粮液	80,725,821.50	5.30
13	002185	华天科技	78,207,593.09	5.13
14	600745	闻泰科技	74,424,821.70	4.88
15	002371	北方华创	69,162,839.00	4.54
16	600519	贵州茅台	68,462,572.90	4.49
17	600584	长电科技	67,171,092.23	4.41
18	002475	立讯精密	67,132,499.07	4.41
19	601669	中国电建	65,200,528.00	4.28
20	600905	三峡能源	62,302,724.00	4.09
21	603799	华友钴业	56,938,799.52	3.74
22	601012	隆基股份	55,601,587.17	3.65
23	000568	泸州老窖	55,177,629.40	3.62
24	002407	多氟多	54,912,941.59	3.60
25	000630	铜陵有色	54,599,363.42	3.58
26	002497	雅化集团	50,533,998.93	3.32
27	300115	长盈精密	49,586,248.73	3.25
28	688390	固德威	49,274,306.36	3.23
29	600673	东阳光	48,498,450.93	3.18
30	601618	中国中冶	48,463,485.81	3.18
31	601985	中国核电	48,284,939.33	3.17
32	600536	中国软件	47,967,689.78	3.15
33	600741	华域汽车	47,041,350.06	3.09
34	600210	紫江企业	46,282,074.35	3.04

35	601919	中远海控	45,052,133.17	2.96
36	002091	江苏国泰	44,825,032.02	2.94
37	600460	士 兰 微	43,870,648.61	2.88
38	601877	正泰电器	43,004,657.00	2.82
39	002916	深南电路	42,959,542.61	2.82
40	002179	中航光电	42,171,560.28	2.77
41	300037	新 宙 邦	42,027,775.05	2.76
42	600711	盛屯矿业	39,460,182.83	2.59
43	000333	美的集团	38,411,634.79	2.52
44	002741	光华科技	37,101,811.49	2.44
45	600110	诺德股份	36,959,111.08	2.43
46	300568	星源材质	36,869,879.98	2.42
47	688772	珠海冠宇	36,484,461.23	2.39
48	002273	水晶光电	35,683,737.20	2.34
49	688012	中微公司	34,952,112.11	2.29
50	601868	中国能建	34,623,604.48	2.27
51	000636	风华高科	34,528,531.60	2.27
52	000725	京东方 A	34,369,346.00	2.26
53	600795	国电电力	34,361,394.78	2.26
54	600703	三安光电	33,442,038.06	2.19
55	002429	兆驰股份	33,119,620.50	2.17
56	601179	中国西电	31,785,452.57	2.09
57	002060	粤 水 电	31,558,633.94	2.07
58	601899	紫金矿业	31,547,821.90	2.07
59	002436	兴森科技	31,321,465.76	2.06
60	601016	节能风电	31,261,730.68	2.05
61	002876	三 利 谱	30,753,923.80	2.02
62	002664	长鹰信质	30,678,679.09	2.01

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	165,183,275.84	10.84
2	002594	比 亚 迪	153,614,222.73	10.08
3	002466	天齐锂业	153,499,542.34	10.07
4	300750	宁德时代	102,875,523.07	6.75

5	002371	北方华创	94,809,165.54	6.22
6	600516	方大炭素	89,368,717.66	5.87
7	000725	京东方 A	88,340,424.32	5.80
8	603026	石大胜华	86,158,604.42	5.65
9	002156	通富微电	83,789,861.20	5.50
10	300207	欣旺达	77,899,915.13	5.11
11	601669	中国电建	72,227,969.51	4.74
12	002185	华天科技	69,869,545.78	4.59
13	002475	立讯精密	67,284,210.79	4.42
14	002497	雅化集团	64,825,101.32	4.25
15	600460	士兰微	64,599,740.04	4.24
16	002460	赣锋锂业	63,558,816.51	4.17
17	300671	富满微	62,828,790.44	4.12
18	603799	华友钴业	61,050,427.71	4.01
19	600584	长电科技	59,671,467.58	3.92
20	300457	赢合科技	59,225,944.22	3.89
21	600745	闻泰科技	58,650,280.14	3.85
22	000858	五粮液	56,650,601.73	3.72
23	000630	铜陵有色	55,520,732.04	3.64
24	002241	歌尔股份	50,935,243.72	3.34
25	002407	多氟多	49,985,282.43	3.28
26	000049	德赛电池	49,403,585.73	3.24
27	601618	中国中冶	49,204,657.05	3.23
28	600519	贵州茅台	48,616,115.67	3.19
29	002429	兆驰股份	46,616,842.17	3.06
30	600905	三峡能源	46,007,508.64	3.02
31	002138	顺络电子	45,438,794.32	2.98
32	688037	芯源微	44,340,764.45	2.91
33	688012	中微公司	44,073,062.45	2.89
34	600536	中国软件	43,966,411.68	2.89
35	601985	中国核电	43,417,288.68	2.85
36	300115	长盈精密	43,164,941.14	2.83
37	688390	固德威	42,610,325.39	2.80
38	601012	隆基股份	42,243,996.00	2.77
39	300037	新宙邦	41,540,116.15	2.73
40	000568	泸州老窖	41,507,160.64	2.72
41	601919	中远海控	40,229,810.67	2.64
42	300604	长川科技	39,736,959.46	2.61
43	603501	韦尔股份	38,784,368.81	2.55
44	601899	紫金矿业	38,736,741.56	2.54
45	300014	亿纬锂能	38,713,133.09	2.54
46	600711	盛屯矿业	38,410,410.37	2.52

47	300593	新雷能	37,037,951.69	2.43
48	000063	中兴通讯	35,960,757.95	2.36
49	601168	西部矿业	35,525,743.45	2.33
50	300769	德方纳米	34,788,235.42	2.28
51	600795	国电电力	34,670,829.90	2.28
52	002091	江苏国泰	34,105,923.97	2.24
53	300568	星源材质	33,847,856.66	2.22
54	688126	沪硅产业	33,368,516.14	2.19
55	600141	兴发集团	33,169,056.88	2.18
56	600110	诺德股份	32,843,638.51	2.16
57	000333	美的集团	32,802,209.32	2.15
58	000636	风华高科	32,734,454.10	2.15
59	688388	嘉元科技	32,531,897.84	2.14
60	300319	麦捷科技	31,962,044.91	2.10
61	601179	中国西电	31,297,200.00	2.05

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	8,016,822,130.37
卖出股票的收入（成交）总额	6,738,694,871.21

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)	1,432,325.01	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,432,325.01	0.04

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	4,750	801,942.50	0.02
2	127038	国微转债	1,955	383,981.55	0.01
3	128136	立讯转债	1,952	246,400.96	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	525,763.71
2	应收证券清算款	1,871,152.60
3	应收股利	-
4	应收利息	26,947.40
5	应收申购款	3,506,813.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,930,677.35

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	801,942.50	0.02
2	127038	国微转债	383,981.55	0.01
3	128136	立讯转债	246,400.96	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

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
123,889	8,752.26	681,350,658.79	62.84%	402,958,126.72	37.16%

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	686,176.89	0.06%

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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年1月17日)基金份额总额	306,827,147.76
本报告期期初基金份额总额	673,459,687.85
本报告期基金总申购份额	1,372,227,471.21
减：本报告期基金总赎回份额	961,378,373.55

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,084,308,785.51

§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 9 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	249,244,001.18	1.70%	232,121.39	1.80%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	188,235,097.08	1.28%	137,656.20	1.07%	-
东方财富	2	284,096,910.75	1.93%	207,760.75	1.62%	-
东方证券	1	310,724,770.14	2.12%	289,373.40	2.25%	-
东吴证券	1	1,083,897,496.17	7.38%	1,009,437.66	7.85%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	224,200,922.84	1.53%	208,797.86	1.62%	-
光大证券	2	216,911,120.58	1.48%	202,010.31	1.57%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	314,238,991.82	2.14%	292,650.01	2.27%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	29,015,012.97	0.20%	27,021.72	0.21%	退租 1 个
国信证券	2	112,885,791.50	0.77%	105,129.71	0.82%	-
海通证券	2	703,563,814.06	4.79%	655,231.76	5.09%	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	3	457,638,792.62	3.12%	334,671.61	2.60%	-
华创证券	1	133,601,260.56	0.91%	124,422.96	0.97%	-

华金证券	2	392,066,965.99	2.67%	286,720.12	2.23%	-
华泰证券	3	130,076,287.98	0.89%	99,980.57	0.78%	-
华西证券	2	91,934,498.77	0.63%	67,231.76	0.52%	-
汇丰前海	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	69,911,272.44	0.48%	51,126.36	0.40%	-
开源证券	1	235,426,760.34	1.60%	172,168.31	1.34%	-
民生证券	1	130,237,628.98	0.89%	121,288.59	0.94%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	269,621,635.90	1.84%	197,173.86	1.53%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	95,087,800.31	0.65%	88,555.16	0.69%	-
首创证券	1	249,622,718.42	1.70%	182,549.92	1.42%	-
太平洋证 券	1	94,344,779.32	0.64%	87,863.52	0.68%	-
天风证券	2	84,829,279.59	0.58%	79,001.18	0.61%	-
五矿证券	2	197,850,585.61	1.35%	144,688.82	1.12%	-
西部证券	1	20,067,397.78	0.14%	14,675.25	0.11%	-
西南证券	2	375,874,596.84	2.56%	315,032.68	2.45%	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	5	1,050,181,928.43	7.15%	978,038.31	7.60%	-
兴业证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
野村东方	1	216,963,536.58	1.48%	158,666.01	1.23%	-
银河证券	1	310,148,359.33	2.11%	288,843.40	2.25%	-
粤开证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
长城证券	1	591,040,418.89	4.02%	550,441.58	4.28%	-
长江证券	2	2,225,544,028.06	15.15%	2,072,655.16	16.11%	-
招商证券	2	390,998,938.72	2.66%	364,136.99	2.83%	-
浙商证券	1	324,165,464.65	2.21%	301,896.58	2.35%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	17,849,365.24	0.12%	16,623.36	0.13%	-
中泰证券	1	593,257,047.07	4.04%	552,502.57	4.29%	-
中信建投	2	475,463,453.92	3.24%	442,800.66	3.44%	-
中信证券	4	1,749,707,562.58	11.91%	1,403,396.45	10.91%	-
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。

11.8 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	信达澳银先进智造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	2021-02-22

		露网站、公司网站	
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	信达澳银先进智造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	2021-04-16

		露网站、公司网站	
17	信达澳银先进智造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	信达澳银先进智造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
22	信达澳银先进智造股票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	2021-05-26
23	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	2021-06-01
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	信达澳银先进智造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	证监会指定信	2021-08-02

	购费率优惠活动的公告	信息披露报纸、 证监会信息披露网站、公司网站	
28	信达澳银先进智造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	信达澳银先进智造股票型证券投资基金 2021 年第	证监会信息披	2021-10-26

	三季度报告	露网站、公司网站	
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

§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
	1	2021 年 06 月 24 日 - 2021 年 07 月 19 日	22,842,066.79	153,374,498.58	-	176,216,565.37	16.25 %
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、《信达澳银先进智造股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《信达澳银先进智造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