

建信中小盘先锋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：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券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	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 基金投资顾问	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 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	8
3.3 其他指标	11
3.4 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
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	20
§ 5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26

§ 8 投资组合报告	55
8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
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	67
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	67
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	68
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	68
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例	68
8.13 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	70
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	70
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	71
11.1 基金份额持有人大会决议	71
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	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
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	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	73
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§ 13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	74
13.3 查阅方式	74

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中小盘先锋股票型证券投资基金	
基金简称	建信中小盘先锋股票	
基金主代码	000729	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 月 20 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	708,518,982.98 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C
下属分级基金的交易代码	000729	013919
报告期末下属分级基金的份额总额	529,840,927.11 份	178,678,055.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有竞争优势和较高成长性的中小盘股票，在严格控制风险的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。 在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市的估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。 此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	$85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中债综合全价(总值)指数收益率}$
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金，混合型基金，属于证券投资基金中较高风险、较高预期收益的品种。

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		建信基金管理有限责任公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明	韩鑫普
	联系电话	010-66228888	0755-82943666
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95565
传真		010-66228001	0755-82960794
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	100033	518000
法定代表人	孙志晨	霍达

2.4 基金投资顾问

无。

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 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 17 层 01-12 室
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 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	2021 年 10 月 27 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	2020 年	2019 年
	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 A
			建信中小盘先锋股票	建信中小盘先锋股票

				C		C
本期已实现收益	117,749,342.73	5,625,072.09	96,803,957.74	-	26,681,391.38	-
本期利润	296,594,036.11	9,136,977.74	112,245,646.81	-	46,789,253.92	-
加权平均基金份额本期利润	1.6788	0.1145	1.1555	-	0.3245	-
本期加权平均净值利润率	47.37%	2.76%	62.55%	-	25.31%	-
本期基金份额净值增长率	67.26%	6.99%	81.21%	-	29.19%	-
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	957,559,858.22	322,317,029.82	105,201,494.01	-	454,265.44	-
期末可供分配基金份额利润	1.8073	1.8039	1.0298	-	0.0034	-
期末基金资产净值	2,238,819,376.97	754,329,531.00	258,034,746.88	-	183,533,026.27	-

期末 基金 份额 净值	4.225	4.222	2.526	-	1.394	-
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	322.50%	6.99%	152.60%	-	39.40%	-

注：1、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。

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

4、本基金于 2021 年 10 月 27 日起新增 C 类份额，原有份额转换为 A 类份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

建信中小盘先锋股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.00%	1.61%	3.17%	0.64%	9.83%	0.97%
过去六个月	37.94%	1.87%	7.15%	0.82%	30.79%	1.05%

过去一年	67.26%	1.76%	13.62%	0.83%	53.64%	0.93%
过去三年	291.57%	1.68%	64.45%	1.17%	227.12%	0.51%
过去五年	201.70%	1.51%	17.14%	1.13%	184.56%	0.38%
自基金合同生效起至今	322.50%	1.71%	59.50%	1.44%	263.00%	0.27%

建信中小盘先锋股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	6.99%	1.38%	3.89%	0.64%	3.10%	0.74%

注：本基金为股票型证券投资基金，投资范围主要包括 A 股、债券类资产、货币市场投资品种以及现金等金融工具。其中投资于股票的基金资产占基金资产比例为 80%-95%，在实际投资运作中，本基金股票投资比例均值约为 85%，故本基金采取 85% 作为复合业绩比较基准中衡量股票投资部分业绩表现的权重，相应将 15% 作为衡量债券投资部分业绩表现的权重。

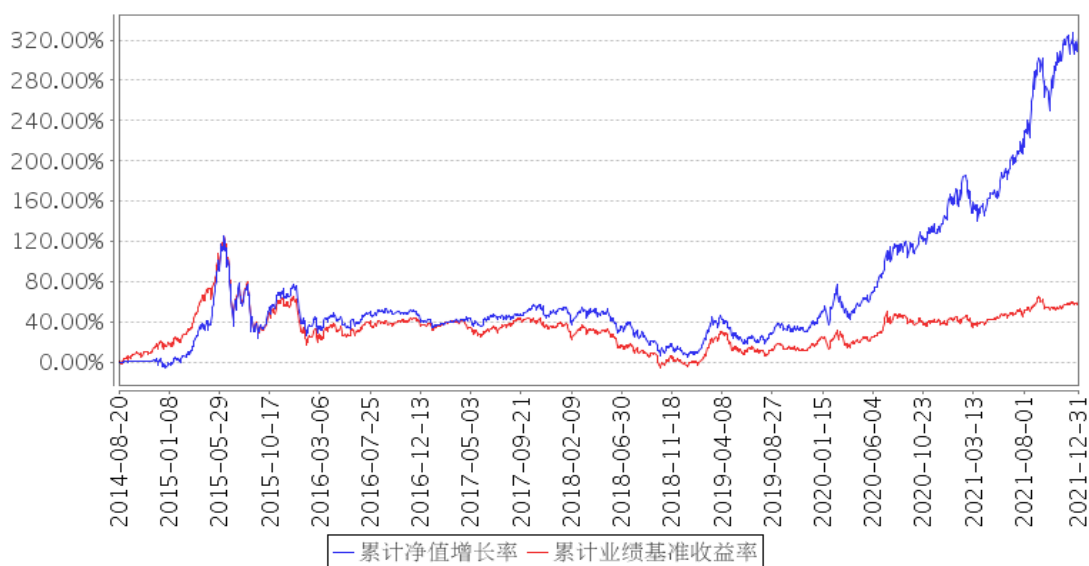
中证 500 指数由中证指数有限公司编制并发布。该指数样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了 500 只沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体情况。因此，基金管理人选择中证 500 指数作为本基金股票部分的比较基准。

中债综合全价（总值）指数由中央国债登记结算公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场，成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券，具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金债券部分的业绩比较基准。

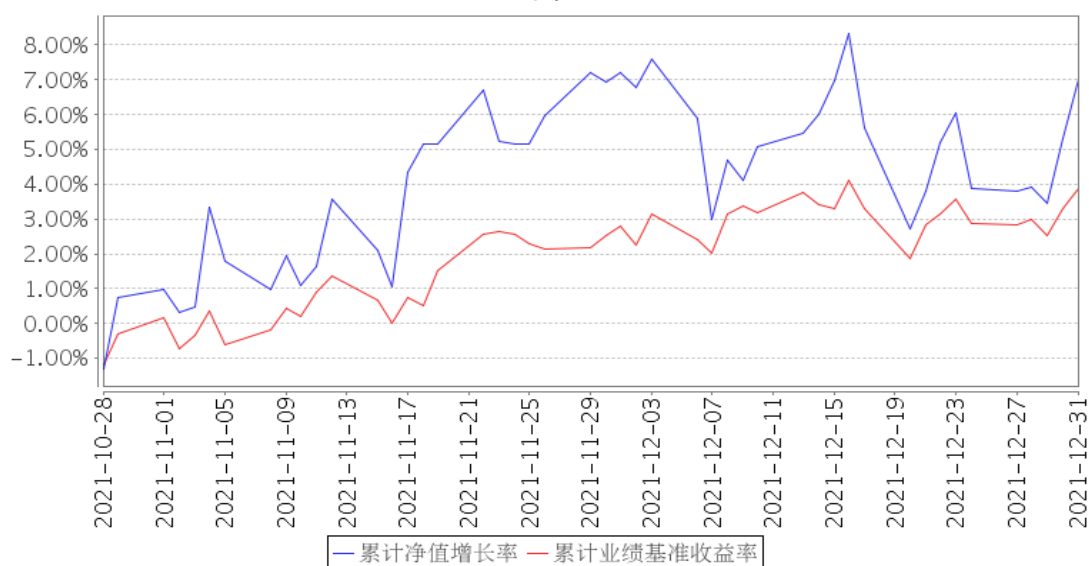
由此可见，上述两个指数的发布主体在证券市场上具有较高的市场代表性、权威性和中立性，适合作为本基金的业绩比较基准。

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

建信中小盘先锋股票A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



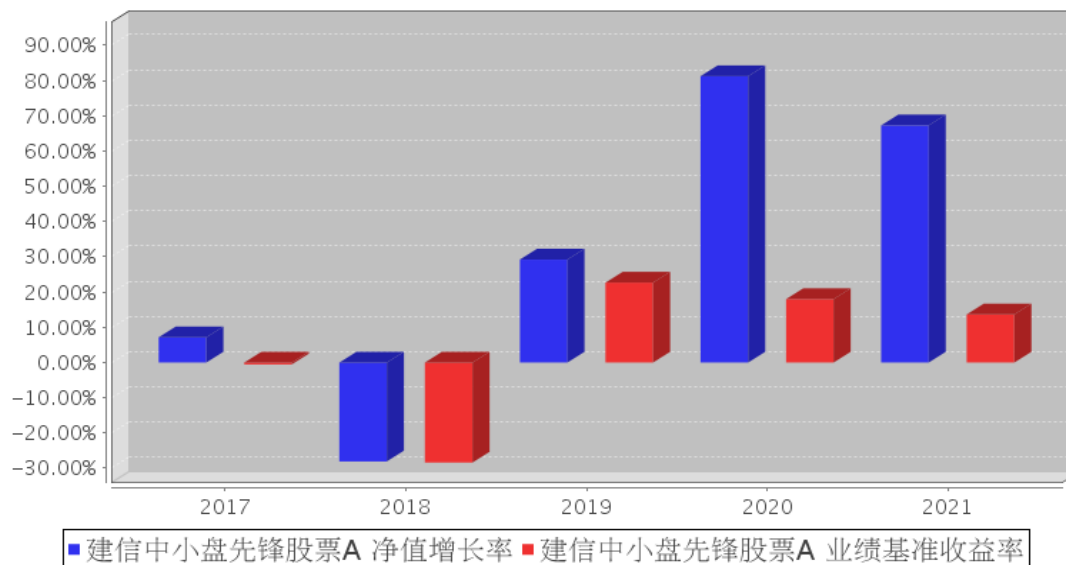
建信中小盘先锋股票C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



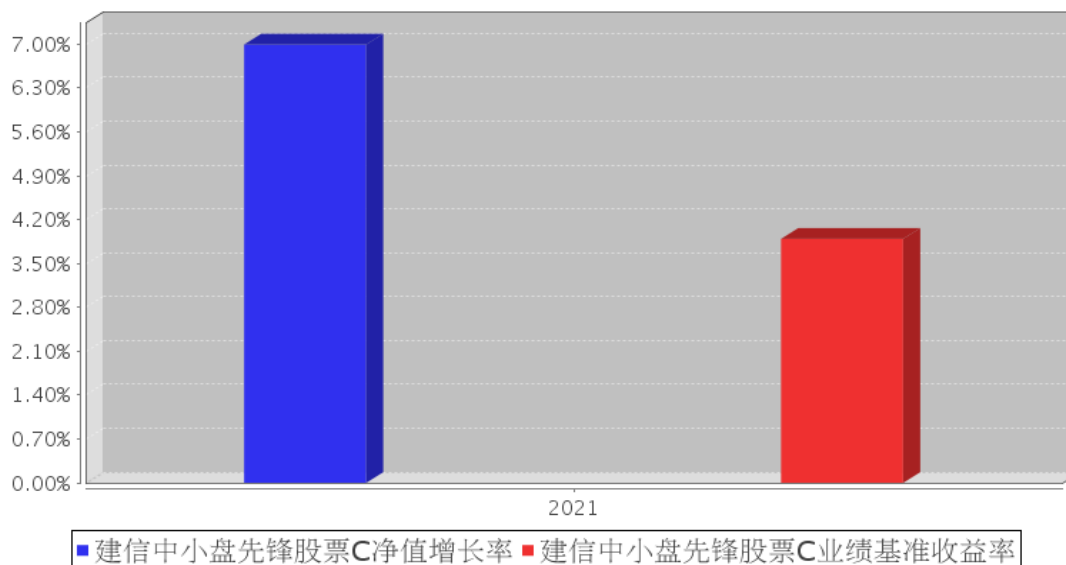
注：本报告期，本基金投资组合比例符合基金合同要求。

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

建信中小盘先锋股票A 基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信中小盘先锋股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未实施利润分配。

§ 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

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本 10%。

公司下设综合管理部、权益投资部、固定收益投资部、金融工程及指数投资部、专户投资部、国际投资与业务发展部、资产配置与量化投资部、基础设施投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、机构业务部、证券公司客户部、网络金融部、投资顾问与客户服务部、人力资源部、财务管理部、注册登记部、基金会计部、金融科技部、投资风险管理部、内控合规部和审计部，以及北京、上海、广州、深圳、成都五个分公司和华东、西北、东北、武汉、南京、石家庄六个营销中心，并在上海设立了子公司——建信资本管理有限责任公司以及在香港设立建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家 资产管理行业的领跑者”。

截至 2021 年 12 月 31 日，公司旗下有建信货币市场基金、建信优选成长混合型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选混合型证券投资基金、建信利率债债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金（LOF）、上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金、建信上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信内生动力混合型证券投资基金、建信积极配置混合型证券投资基金、建信安心回报定期开放债券型证券投资基金、建信恒久价值混合型证券投资基金、建信双息红利债券型证券投资基金、建信创新中国混合型证券投资基金、建信中证 500 指数增强型证券投资基金、建信双债增强债券型证券投资基金、建信嘉薪宝货币市场基金、建信环保产业股票型证券投资基金、建信精工制造指数增强型证券投资基金、建信鑫利灵活配置混合型证券投资基金、建信兴利灵活配置混合型证券投资基金、建信福泽安泰混合型基金中基金（FOF）、建信睿丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信福泽裕泰混合型基金中基金（FOF）、建信睿信三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金、建信深证基本面 60 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、建信短债债券型证券投资基金、建信转债增强债券型证券投资基金、

建信消费升级混合型证券投资基金、建信灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定得利债券型证券投资基金、建信鑫安回报灵活配置混合型证券投资基金、建信新经济灵活配置混合型证券投资基金、建信多因子量化股票型证券投资基金、建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金、建信中证红利潜力指数证券投资基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、建信弘利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒瑞一年定期开放债券型证券投资基金、建信中国制造 2025 股票型证券投资基金、建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金、建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金、建信睿阳一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信深证 100 指数增强型证券投资基金、建信央视财经 50 指数证券投资基金 (LOF)、建信优势动力混合型证券投资基金 (LOF)、建信周盈安心理财债券型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金、建信现金添利货币市场基金、建信裕利灵活配置混合型证券投资基金、建信睿怡纯债债券型证券投资基金、建信现金增利货币市场基金、建信睿享纯债债券型证券投资基金、建信恒远一年定期开放债券型证券投资基金、建信稳定鑫利债券型证券投资基金、建信战略精选灵活配置混合型证券投资基金、建信润利增强债券型证券投资基金、建信高股息主题股票型证券投资基金、建信科技创新混合型证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金、建信上海金交易型开放式证券投资基金联接基金、建信智汇优选一年持有期混合型管理人中管理人 (MOM) 证券投资基金、建信智能生活混合型证券投资基金、建信沪深 300 指数增强型证券投资基金 (LOF)、建信安心回报 6 个月定期开放债券型证券投资基金、建信荣元一年定期开放债券型发起式证券投资基金、建信智能汽车股票型证券投资基金、建信中证沪港深粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信社会责任混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、建信鑫稳回报灵活配置混合型证券投资基金、建信龙头企业股票型证券投资基金、建信优享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、建信中短债纯债债券型证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金、建信科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、建信中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、建信易盛郑商所能源化工期货交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信臻选混合型证券投资基金、建信互联网+产业升级股票型证券投资基金、建信现代服务业股票型证券投资基金、建信汇利灵活配置混合型证券投资基金、建信恒安一年定期开放债券型证券投资基金、建信睿富纯债债券型证券投资基金、建信高端医疗股票型证券投资基金、建信睿和纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、建信港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、建信睿兴纯债债券型证券投资基金、建信中债湖北省地方政府债指数发起式证券投资基金、

建信裕丰利率债三个月定期开放债券型证券投资基金、建信普泽养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、建信丰裕多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、建信创新驱动混合型证券投资基金、建信鑫瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、建信天添益货币市场基金、建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金、建信上证 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金、建信创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信大安全战略精选股票型证券投资基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、建信兴润一年持有期混合型证券投资基金、建信中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、建信中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信沪深 300 红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信现金添益交易型货币市场基金、建信量化事件驱动股票型证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、建信中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、建信鑫泽回报灵活配置混合型证券投资基金、建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、建信荣禧一年定期开放债券型证券投资基金、建信中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、建信利率债策略纯债债券型证券投资基金、建信泓利一年持有期债券型证券投资基金、建信中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、建信鑫悦 90 天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金、建信食品饮料行业股票型证券投资基金、建信港股通精选混合型证券投资基金、建信中债 5-10 年国开行债券指数证券投资基金、建信新能源行业股票型证券投资基金、建信中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、建信中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、建信中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、建信高端装备股票型证券投资基金、建信纳斯达克 100 指数型证券投资基金 (QDII)、建信新兴市场优选混合型证券投资基金、建信富时 100 指数型证券投资基金 (QDII)、建信汇益一年持有期混合型证券投资基金、建信彭博巴克莱政策性银行债券 1-5 年指数证券投资基金、建信中证饮料主题交易型开放式指数证券投资基金、建信龙祥稳进 6 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、建信中关村产业园封闭式基础设施证券投资基金 (REITs)、建信医疗健康行业股票型证券投资基金共计 149 只证券投资基金, 管理的基金净资产规模共计为 6765.99 亿元。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限	证券从业年限	说明
----	----	-------------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
周智硕	本基金的基金经理	2020 年 9 月 18 日	-	11 年	周智硕先生，硕士。2009 年 7 月至 2012 年 8 月在南方基金管理有限公司担任研究员；2012 年 8 月至 2013 年 7 月在中国国际金融有限公司担任研究员；2013 年 8 月至 2016 年 2 月在北京鸿道投资管理有限责任公司担任研究员、投资经理；2016 年 2 月至 2016 年 11 月在注册登记私募担任研究员和投资经理；2016 年 11 月至 2017 年 11 月在上海七曜投资管理合伙企业担任投资经理；2017 年 11 月至 2020 年 6 月在工银瑞信基金管理有限公司担任投资经理。2020 年 6 月加入建信基金权益投资部拟任基金经理。2020 年 9 月 18 日起任建信中小盘先锋股票型证券投资基金、建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日起任建信优化配置混合型证券投资基金的基金经理。
邵卓	权益投资部副总经理，本基金的基金经理	2020 年 7 月 17 日	2021 年 10 月 9 日	11 年	邵卓先生，权益投资部副总经理，硕士。2006 年 4 月至 2010 年 7 月先后就职于明基（西门子）移动通信研发中心、IBM 中国软件实验室；2010 年 7 月加入广发证券发展研究中心。邵卓于 2011 年 9 月加入我公司，历任研究部研究员、研究主管，权益投资部基金经理、权益投资部联席投资官兼研究部首席研究官、权益投资部副总经理。2015 年 3 月 24 日起任建信信息产业股票型证券投资基金的基金经理；2015 年 5 月 22 日起任建信创新中国混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 19 日起任建信安心保本三号混合型证券投资基金的基金经理，该基金于 2018 年 1 月 11 日起转型为建信裕利灵活配置混合型证券投资基金，邵卓自 2018 年 1 月 11 日至 2021 年 9 月 29 日继续担任该基金的基金经理；2020 年 4 月 14 日起任建信科技创新混合型证券投资基金的基金经理；2020 年 7 月 17 日至 2021 年 9 月 29 日任建信潜力新蓝筹股票型证券投资基金的基金经理；2020 年 7 月 17 日至 2021 年 10 月 9 日任建信中小盘先锋股票型证券投资基金的基金经理；2021 年 8 月 10 日起任建信创新驱动混合型证券投资基金的基金经理。

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

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

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现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超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年市场出现了极大的结构性分化。从指数角度来看，上证指数上涨 4.8%，深成指上涨 2.67%，创业板指上涨 12.02%，上证 50 下跌 10.06%，中证 500 上涨 15.58%。分行业来看，按照中信行业分类，涨幅排名前三的行业分别是电力设备及新能源、基础化工和有色金属，涨幅分别是 50.41%，48.05%和 46.39%。跌幅排名前三的行业分别是消费者服务、非银行金融和家电，跌幅分别是 24.45%，20.41%和 18.57%。这种巨大分化的背后，反应了疫情复苏期中小公司 21 年业绩高速增长的戴维斯双击，也和国内自上而下共同富裕、碳中和的政策思路，以及疫情影响下上游资源品供需失衡、消费复苏偏弱有密切关系。

报告期内，本基金继续认为我国经济正在由高速增长阶段转向高质量发展阶段，经济的增长动能正从要素驱动转向创新驱动，从中国制造转向中国创造，从人口红利转向工程师红利。因此，本基金继续围绕行业中竞争力突出、业绩确定性增长的公司这条主线进行投资，重点投资了机械、军工、采掘、电子、通信等行业，投资了一些有独特盈利模式，且未来有持续增长能力的公司。希冀通过此类投资，提高投资回报。从全年的业绩情况来看，基金业绩出现上涨，全年取得 67.26% 的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率 67.26%，波动率 1.76%，业绩比较基准收益率 13.62%，波动率 0.83%；本报告期本基金 C 净值增长率 6.99%，波动率 1.38%，业绩比较基准收益率 3.89%，波动率 0.64%。

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，现阶段经济下行压力最大的阶段还未到来，当前经济短期压力兑现在房地产投资增速下台阶，但出口仍在较高增速区间运行，消费和基建投资增速也出现边际改善，短期对经济形成一定支撑，随着房地产投资和出口增速回落，预计二季度前后经济下行压力达到最大阶段。不过，随着稳增长政策逐渐发力并节奏前置，市场对经济的悲观预期已经有所修复。经济将以基建和保障房建设弥补房地产投资增速的缺口、以消费内需的挖掘弥补出口增速中枢下台阶对经济的可能拖累。因此，对全年的经济增长，以及资本市场全年的表现，我们并不悲观。

盈利方面，全年经济增长进一步下台阶，A 股进入盈利下行周期。叠加中美货币政策可能出现错位，会导致流动性也处于松紧适度，而非大水漫灌的情况。综上，市场会十分青睐未来一段时间持续稳定增长或者持续高速增长的公司。我们认为市场投资逻辑从总量转向结构性亮点，经营优秀的企业能在中长期仍能获得较好的回报。本基金将继续发掘优质的中小公司，希冀随着公

司长大，通过研究发掘新经济下主导产业中的龙头企业，跟随企业成长，将成为我们获取投资回报的重要手段。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司内控合规部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强

了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2017]13 号文《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、内控合规部、投资风险管理部和基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，与中债金融估值中心有限公司签署《中债信息产品服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用非货币基金）或影子定价（适用货币基金和理财类基金）；对公司旗下基金持有的在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），本公司采用中证指数有限公司独立提供的债券估值价格进行估值。

本公司与中证指数有限公司签署《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，并依据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》和中证指数有限公司独立提供的流通受限股票流动性

折扣，对公司旗下基金持有的流通受限股票进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

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，招商证券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。

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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第 61490173_A14 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信中小盘先锋股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了建信中小盘先锋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，后附的建信中小盘先锋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，公允反映了建信中小盘先锋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。
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，我们独立于建信中小盘先锋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。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	建信中小盘先锋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。
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，管理层负责评估建信中小盘先锋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。 治理层负责监督建信中小盘先锋股票型证券投资基金的财务报告过程。
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，就可能导致对建信中小盘先锋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建信中小盘先锋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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	高 鹤	贺 耀
会计师事务所的地址	中国 北京	
审计报告日期	2022 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信中小盘先锋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	311,559,992.25	35,504,986.94
结算备付金		7,570,068.32	1,235,213.28
存出保证金		1,023,402.99	287,155.02
交易性金融资产	7.4.7.2	2,793,535,151.59	230,321,109.63
其中：股票投资		2,785,734,025.69	230,321,109.63
基金投资		-	-
债券投资		7,801,125.90	-
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		-	335,079.16
应收利息	7.4.7.5	159,828.34	10,996.10
应收股利		-	-
应收申购款		9,993,260.58	36,098.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,123,841,704.07	267,730,638.32
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		116,639,991.90	6,891,948.03
应付赎回款		6,227,105.50	1,074,830.07
应付管理人报酬		3,122,620.56	264,776.38
应付托管费		520,436.75	44,129.40
应付销售服务费		206,108.89	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,795,159.76	1,235,084.03
应交税费		21.58	16.37
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	181,351.16	185,107.16
负债合计		130,692,796.10	9,695,891.44
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	708,518,982.98	102,153,478.42
未分配利润	7.4.7.10	2,284,629,924.99	155,881,268.46
所有者权益合计		2,993,148,907.97	258,034,746.88
负债和所有者权益总计		3,123,841,704.07	267,730,638.32

注： 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 708,518,982.98 份，其中建信中小盘先锋股票 A 基金份额总额 529,840,927.11 份，基金份额净值为人民币 4.225 元；建信中小盘先锋股票 C 基金份额总额 178,678,055.87 份，基金份额净值为人民币 4.222 元。

7.2 利润表

会计主体：建信中小盘先锋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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年
-----	-----	------------------------------	-----------------------------------

		12 月 31 日	12 月 31 日
一、收入		328,630,222.78	119,835,189.54
1. 利息收入		1,209,615.50	331,338.73
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,193,480.85	327,665.00
债券利息收入		4,480.47	3,673.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		11,654.18	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		143,280,097.06	103,950,756.79
其中：股票投资收益	7.4.7.12	140,104,335.57	99,751,944.57
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,712,337.93	2,482,231.23
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,888,099.42	1,716,580.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	182,356,599.03	15,441,689.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	1,783,911.19	111,404.95
减：二、费用		22,899,208.93	7,589,542.73
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	10,109,427.51	2,687,005.09
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,684,904.64	447,834.22
3. 销售服务费	-	234,043.97	-
4. 交易费用	7.4.7.19	10,682,816.65	4,266,690.20
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		16.16	13.22
7. 其他费用	7.4.7.20	188,000.00	188,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		305,731,013.85	112,245,646.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		305,731,013.85	112,245,646.81

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信中小盘先锋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）	102,153,478.42	155,881,268.46	258,034,746.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	305,731,013.85	305,731,013.85
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）	606,365,504.56	1,823,017,642.68	2,429,383,147.24
其中：1. 基金申购款	732,004,238.13	2,154,561,237.57	2,886,565,475.70
2. 基金赎回款	-125,638,733.57	-331,543,594.89	-457,182,328.46
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）	708,518,982.98	2,284,629,924.99	2,993,148,907.97
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）	131,692,309.43	51,840,716.84	183,533,026.27
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	112,245,646.81	112,245,646.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-29,538,831.01	-8,205,095.19	-37,743,926.20

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	56,336,588.16	67,999,090.15	124,335,678.31
2. 基金赎回款	-85,875,419.17	-76,204,185.34	-162,079,604.51
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）	102,153,478.42	155,881,268.46	258,034,746.88

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

吴灵玲

丁颖

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

建信中小盘先锋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[2014]495 号《关于核准建信中小盘先锋股票型证券投资基金募集的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 759,552,595.20 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2014）第 464 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》于 2014 年 8 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 759,776,341.92 份基金份额，其中认购资金利息折合 223,746.72 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《建信中小盘先锋股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告》并报证监会备案，本基金于 2021 年 10 月 27 日起根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同，将本基金基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本

类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。投资者可自行选择申购的基金份额类别。2021 年 10 月 27 日前原有的基金份额全部转换为建信中小盘先锋股票 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》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 A 股股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、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，但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%，债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的 0-20%，权证投资合计市值占基金资产净值的 0-3%，现金或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。本基金将不低于 80% 的非现金基金资产投资于具有较高成长性的中小盘股票。本基金的业绩比较基准为 $85\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 15\% \times \text{中债综合全价（总值）指数收益率}$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2022 年 3 月 28 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。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；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；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。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金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；或者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定相关投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	311,559,992.25	35,504,986.94
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	311,559,992.25	35,504,986.94

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	2,580,573,465.88	2,785,734,025.69	205,160,559.81
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	7,801,125.90	2,218,162.61
	银行间市场	-	-
	合计	7,801,125.90	2,218,162.61
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,586,156,429.17	2,793,535,151.59	207,378,722.42
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	205,298,986.24	230,321,109.63	25,022,123.39
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	205,298,986.24	230,321,109.63	25,022,123.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

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	154,877.04	10,242.49
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	3,747.15	611.49
应收债券利息	697.49	-
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	506.66	142.12
合计	159,828.34	10,996.10

7.4.7.6 其他资产

无。

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	3,795,159.76	1,235,084.03
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,795,159.76	1,235,084.03

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	6,851.16	415.64
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	174,500.00	184,691.52
合计	181,351.16	185,107.16

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

建信中小盘先锋股票 A

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	102,153,478.42	102,153,478.42
本期申购	549,623,990.45	549,623,990.45
本期赎回（以“-”号填列）	-121,936,541.76	-121,936,541.76
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	529,840,927.11	529,840,927.11

建信中小盘先锋股票 C

项目	本期 2021 年 10 月 27 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	182,380,247.68	182,380,247.68
本期赎回（以“-”号填列）	-3,702,191.81	-3,702,191.81
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	178,678,055.87	178,678,055.87

注：1、如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

2、本基金于 2021 年 10 月 27 日起新增 C 类份额，原有份额转换为 A 类份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

建信中小盘先锋股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	105,201,494.01	50,679,774.45	155,881,268.46
本期利润	117,749,342.73	178,844,693.38	296,594,036.11
本期基金份额交易产生的变动数	734,609,021.48	521,894,123.81	1,256,503,145.29

其中：基金申购款	929,434,110.80	646,923,106.71	1,576,357,217.51
基金赎回款	-194,825,089.32	-125,028,982.90	-319,854,072.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	957,559,858.22	751,418,591.64	1,708,978,449.86

建信中小盘先锋股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	5,625,072.09	3,511,905.65	9,136,977.74
本期基金份额交易产生的变动数	316,691,957.73	249,822,539.66	566,514,497.39
其中：基金申购款	323,304,685.92	254,899,334.14	578,204,020.06
基金赎回款	-6,612,728.19	-5,076,794.48	-11,689,522.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	322,317,029.82	253,334,445.31	575,651,475.13

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	1,130,638.72	304,609.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	42,551.29	16,469.15
其他	20,290.84	6,585.89
合计	1,193,480.85	327,665.00

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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
股票投资收益——买卖股票差价收入	140,104,335.57	99,751,944.57
股票投资收益——赎回	-	-

差价收入		
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	140,104,335.57	99,751,944.57

7.4.7.12.2 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	2,815,876,235.96	1,418,534,394.69
减：卖出股票成本总 额	2,675,771,900.39	1,318,782,450.12
买卖股票差价收入	140,104,335.57	99,751,944.57

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖 债券（、债转股及债券 到期兑付）差价收入	-1,712,337.93	2,482,231.23
债券投资收益——赎回 差价收入	-	-
债券投资收益——申购 差价收入	-	-
合计	-1,712,337.93	2,482,231.23

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	82,083,738.27	32,365,737.57
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	83,722,335.29	29,852,570.86
减：应收利息总额	73,740.91	30,935.48
买卖债券差价收入	-1,712,337.93	2,482,231.23

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.16 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	4,888,099.42	1,716,580.99
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,888,099.42	1,716,580.99

7.4.7.17 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	182,356,599.03	15,441,689.07
股票投资	180,138,436.42	15,441,689.07
债券投资	2,218,162.61	-
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	182,356,599.03	15,441,689.07

7.4.7.18 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	1,657,457.10	101,164.44
基金转换费收入	126,454.09	10,204.34
其他	-	36.17
合计	1,783,911.19	111,404.95

7.4.7.19 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	10,682,816.65	4,266,690.20
银行间市场交易费用	-	-
合计	10,682,816.65	4,266,690.20

7.4.7.20 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	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	188,000.00	188,000.00

7.4.7.21 分部报告

无。

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东

建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：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

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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	10,109,427.51	2,687,005.09
其中：支付销售机构的客户维护费	2,259,530.53	1,053,725.80

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。

7.4.10.2.1.1 基金投资顾问费

无。

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	1,684,904.64	447,834.22

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C	合计
建信基金	-	119,821.79	119,821.79
合计	-	119,821.79	119,821.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C	合计
合计	-	-	-

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

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)	期末成本总额	期末估值总额	备注

							位：股)			
300814	中富电路	2021 年 8 月 4 日	2022 年 2 月 14 日	新发未 上市	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300854	中兰环保	2021 年 9 月 8 日	2022 年 3 月 16 日	新发未 上市	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
300994	久祺股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新发未 上市	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301017	漱玉平民	2021 年 6 月 23 日	2022 年 1 月 5 日	新发未 上市	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新发未 上市	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301029	怡合达	2021 年 7 月 14 日	2022 年 1 月 24 日	新发未 上市	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301030	仕净科技	2021 年 7 月 15 日	2022 年 1 月 24 日	新发未 上市	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301035	润丰股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 28 日	新发未 上市	22.04	56.28	442	9,741.68	24,875.76	-
301036	双乐股份	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 16 日	新发未 上市	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 2 月 7 日	新发未 上市	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301038	深水规院	2021 年 7 月 22 日	2022 年 2 月 7 日	新发未 上市	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301040	中环海陆	2021 年 7 月 26 日	2022 年 2 月 7 日	新发未 上市	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 11 日	新发未 上市	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301046	能辉科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新发未 上市	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰	2021 年	2022 年	新发未	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-

	重工	8月11日	2月28日	上市						
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新发未上市	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301052	果麦文化	2021年8月23日	2022年2月28日	新发未上市	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新发未上市	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新发未上市	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新发未上市	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新发未上市	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新发未上市	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新发未上市	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新发未上市	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新发未上市	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新发未上市	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新发未上市	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新发未上市	93.09	75.34	548	51,013.32	41,286.32	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新发未上市	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-

301089	拓新药业	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 27 日	新发未 上市	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 26 日	新发未 上市	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301091	深城交	2021 年 10 月 20 日	2022 年 4 月 29 日	新发未 上市	36.50	31.31	524	19,126.00	16,406.44	-
301092	争光股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新发未 上市	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301093	华兰股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 5 日	新发未 上市	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301096	百诚医药	2021 年 12 月 13 日	2022 年 6 月 20 日	新发未 上市	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301101	明月镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月 16 日	新发未 上市	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301108	洁雅股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 6 日	新发未 上市	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301111	粤万年青	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新发未 上市	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301118	恒光股份	2021 年 11 月 9 日	2022 年 5 月 18 日	新发未 上市	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301126	达嘉维康	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新发未 上市	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301127	天源环保	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新发未 上市	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301133	金钟股份	2021 年 11 月 19 日	2022 年 5 月 26 日	新发未 上市	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新发未 上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
301138	华研精机	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新发未 上市	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-

		日	日							
301155	海力风电	2021 年 11 月 17 日	2022 年 5 月 24 日	新发未 上市	60.66	96.75	814	49,377.24	78,754.50	-
301166	优宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新发未 上市	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301168	通灵股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新发未 上市	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301177	迪阿股份	2021 年 12 月 8 日	2022 年 6 月 15 日	新发未 上市	116.88	116.08	786	91,867.68	91,238.88	-
301179	泽宇智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新发未 上市	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301182	凯旺科技	2021 年 12 月 16 日	2022 年 6 月 23 日	新发未 上市	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301185	鸥玛软件	2021 年 11 月 11 日	2022 年 5 月 19 日	新发未 上市	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301188	力诺特玻	2021 年 11 月 4 日	2022 年 5 月 11 日	新发未 上市	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301190	善水科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新发未 上市	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301198	喜悦智行	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 2 日	新发未 上市	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301199	迈赫股份	2021 年 11 月 30 日	2022 年 6 月 7 日	新发未 上市	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
688112	鼎阳科技	2021 年 11 月 24 日	2022 年 6 月 1 日	新发未 上市	46.60	80.05	4,901	228,386.60	392,325.05	-
688176	亚虹医药	2021 年 12 月 29 日	2022 年 1 月 7 日	新发未 上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688236	春立医疗	2021 年 12 月 23 日	2022 年 6 月 30 日	新发未 上市	29.81	26.43	4,052	120,790.12	107,094.36	-
688262	国芯	2021 年	2022 年	新发未	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-

	科技	12月28日	1月6日	上市						
688501	青达环保	2021年7月9日	2022年1月17日	新发未上市	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-
688622	禾信仪器	2021年9月3日	2022年3月14日	新发未上市	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-

注：上述可流通日取自截至财务报表批准日的上市公司相关公告。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和控制
上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、内
控合规部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理层和其他业务部门的督

察长和内控合规部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构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。在定期存款和银行间同业市场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产品投资流程，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。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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	7,801,125.90	-
未评级	-	-
合计	7,801,125.90	-

注：以上按短期信用评级及长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债、央行票据、资产支持证券及同业存单等

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人会对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和买入返售金融资产等，其余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利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	311,559,992.25	-	-	-	311,559,992.25
结算备付金	7,570,068.32	-	-	-	7,570,068.32
存出保证金	1,023,402.99	-	-	-	1,023,402.99
交易性金融资产	-	-	7,801,125.90	2,785,734,025.69	2,793,535,151.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	159,828.34	159,828.34
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	9,993,260.58	9,993,260.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	320,153,463.56	-	7,801,125.90	2,795,887,114.61	3,123,841,704.07
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	116,639,991.90	116,639,991.90
应付赎回款	-	-	-	6,227,105.50	6,227,105.50
应付管理人报酬	-	-	-	3,122,620.56	3,122,620.56
应付托管费	-	-	-	520,436.75	520,436.75
应付销售服务费	-	-	-	206,108.89	206,108.89
应付交易费用	-	-	-	3,795,159.76	3,795,159.76
应交税费	-	-	-	21.58	21.58
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	181,351.16	181,351.16
负债总计	-	-	-	130,692,796.10	130,692,796.10
利率敏感度缺口	320,153,463.56	-	7,801,125.90	2,665,194,318.51	2,993,148,907.97
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	35,504,986.94	-	-	-	35,504,986.94
结算备付金	1,235,213.28	-	-	-	1,235,213.28
存出保证金	287,155.02	-	-	-	287,155.02
交易性金融资产	-	-	-	230,321,109.63	230,321,109.63
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	335,079.16	335,079.16
应收利息	-	-	-	10,996.10	10,996.10
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	36,098.19	36,098.19
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	37,027,355.24	-	-	230,703,283.08	267,730,638.32
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	6,891,948.03	6,891,948.03
应付赎回款	-	-	-	1,074,830.07	1,074,830.07
应付管理人报酬	-	-	-	264,776.38	264,776.38
应付托管费	-	-	-	44,129.40	44,129.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,235,084.03	1,235,084.03
应交税费	-	-	-	16.37	16.37
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	185,107.16	185,107.16
负债总计	-	-	-	9,695,891.44	9,695,891.44
利率敏感度缺口	37,027,355.24	-	-	221,007,391.64	258,034,746.88

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 80%-95%，债券等固定收益类资产合计市值占基金资产净值的 0-20%，权证投资合计市值占基金资产净值的 0-3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80%的非现金基金资产投资于具有较高成长性的中小盘股票。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，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	2,785,734,025.69	93.07	230,321,109.63	89.26
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	7,801,125.90	0.26	—	—
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	2,793,535,151.59	93.33	230,321,109.63	89.26

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

	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：人民币元）	
		本期末（2021 年 12 月 31 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	254,141,957.39	15,545,799.86
	业绩比较基准下降 5%	-254,141,957.39	-15,545,799.86

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

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

7.4.14.1.1 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应收款项和其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1 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 2,790,799,096.79 元，属于第二层次的余额为人民币 1,247,735.06 元，属于第三层次的余额为人民币 1,488,319.74 元（于 2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的余额为人民币 226,920,088.82 元，属于第二层次的余额为人民币 84,038.10 元，属于第三层次的余额为人民币 3,316,982.71 元）。

7.4.14.1.2.2 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等证券，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

不将相关证券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关证券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.1.2.3 第三层次公允价值本期变动金额

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工具第三层次公允价值本期未发生变动。

7.4.14.2 承诺事项

无。

7.4.14.3 其他事项

无。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 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	2,785,734,025.69	89.18
	其中：股票	2,785,734,025.69	89.18
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	7,801,125.90	0.25
	其中：债券	7,801,125.90	0.25
	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	319,130,060.57	10.22
8	其他各项资产	11,176,491.91	0.36
9	合计	3,123,841,704.07	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采矿业	298,039,373.00	9.96
C	制造业	2,255,636,019.00	75.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	29,389,964.90	0.98
F	批发和零售业	1,067,247.20	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
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	21,409,698.05	0.72
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	33,119,977.22	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	40,839.39	0.00
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	147,008,137.15	4.91
S	综合	—	—
	合计	2,785,734,025.69	93.07

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600188	兖矿能源	8,842,100	208,054,613.00	6.95
2	000768	中航西飞	5,617,481	205,038,056.50	6.85
3	002897	意华股份	3,552,774	201,122,536.14	6.72
4	002438	江苏神通	9,334,585	191,452,338.35	6.40
5	300751	迈为股份	285,349	183,279,662.70	6.12
6	300413	芒果超媒	2,568,510	146,970,142.20	4.91
7	688707	振华新材	2,395,591	120,689,874.58	4.03
8	600416	湘电股份	4,978,000	108,968,420.00	3.64
9	300421	力星股份	4,483,969	98,288,600.48	3.28
10	603507	振江股份	2,268,600	92,785,740.00	3.10
11	601225	陕西煤业	7,375,800	89,984,760.00	3.01
12	603995	甬金股份	1,505,492	87,107,767.12	2.91

13	603688	石英股份	1,317,900	83,172,669.00	2.78
14	601137	博威合金	3,406,788	80,400,196.80	2.69
15	002206	海利得	8,623,105	76,573,172.40	2.56
16	688020	方邦股份	673,458	61,385,696.70	2.05
17	600587	新华医疗	1,871,724	60,269,512.80	2.01
18	002414	高德红外	2,355,560	57,028,107.60	1.91
19	600458	时代新材	4,033,700	55,866,745.00	1.87
20	601717	郑煤机	4,625,505	53,609,602.95	1.79
21	300395	菲利华	785,300	51,625,622.00	1.72
22	603985	恒润股份	922,800	49,295,976.00	1.65
23	002389	航天彩虹	1,750,200	48,655,560.00	1.63
24	002017	东信和平	2,711,976	41,140,675.92	1.37
25	301058	中粮工科	1,684,833	32,987,172.90	1.10
26	300558	贝达药业	375,691	29,991,412.53	1.00
27	000498	山东路桥	4,754,895	29,385,251.10	0.98
28	688299	长阳科技	853,704	27,916,120.80	0.93
29	300567	精测电子	378,700	27,429,241.00	0.92
30	300390	天华超净	325,424	26,359,344.00	0.88
31	300769	德方纳米	47,100	23,133,636.00	0.77
32	300659	中孚信息	464,900	21,083,215.00	0.70
33	003031	中瓷电子	248,300	20,805,057.00	0.70
34	002782	可立克	1,138,435	20,343,833.45	0.68
35	300573	兴齐眼药	145,548	19,910,966.40	0.67
36	603809	豪能股份	696,740	14,331,941.80	0.48
37	300207	欣旺达	290,300	12,239,048.00	0.41
38	000738	航发控制	293,800	8,896,264.00	0.30
39	600862	中航高科	245,400	8,775,504.00	0.29
40	688268	华特气体	34,820	3,140,764.00	0.10
41	600438	通威股份	57,300	2,576,208.00	0.09
42	301177	迪阿股份	7,854	990,853.92	0.03
43	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.03
44	688112	鼎阳科技	4,901	392,325.05	0.01
45	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
46	688236	春立医疗	4,052	107,094.36	0.00
47	301155	海力风电	814	78,754.50	0.00
48	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
49	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.00
50	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
51	301087	可孚医疗	548	41,286.32	0.00
52	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.00
53	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
54	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00

55	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
56	301035	润丰股份	442	24,875.76	0.00
57	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
58	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
59	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
60	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
61	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
62	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
63	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
64	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
65	301091	深城交	524	16,406.44	0.00
66	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
67	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
68	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
69	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
70	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
71	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
72	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
73	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
74	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
75	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
76	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
77	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
78	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
79	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
80	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
81	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
82	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
83	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
84	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
85	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
86	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
87	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
88	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
89	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
90	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
91	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
92	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
93	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
94	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
95	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
96	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00

97	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
98	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
99	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
100	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
101	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
102	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
103	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
104	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	600188	兖矿能源	207,969,480.87	80.60
2	000768	中航西飞	201,925,165.54	78.26
3	300751	迈为股份	188,005,598.66	72.86
4	002438	江苏神通	170,678,155.36	66.15
5	300413	芒果超媒	157,650,064.39	61.10
6	002897	意华股份	153,590,964.20	59.52
7	002206	海利得	142,614,996.65	55.27
8	688707	振华新材	124,946,780.19	48.42
9	601225	陕西煤业	105,279,604.42	40.80
10	603507	振江股份	89,264,493.00	34.59
11	600416	湘电股份	86,032,202.87	33.34
12	603995	甬金股份	82,219,821.48	31.86
13	300421	力星股份	79,188,716.84	30.69
14	600552	凯盛科技	75,731,119.96	29.35
15	601137	博威合金	71,224,278.05	27.60
16	688020	方邦股份	64,441,563.16	24.97
17	603688	石英股份	64,141,643.54	24.86
18	300390	天华超净	63,555,649.00	24.63
19	601857	中国石油	63,306,871.63	24.53
20	601717	郑煤机	63,202,906.90	24.49
21	300769	德方纳米	61,816,378.00	23.96
22	002414	高德红外	58,911,740.86	22.83
23	002389	航天彩虹	56,343,184.75	21.84
24	600458	时代新材	54,915,461.00	21.28
25	600587	新华医疗	54,247,725.27	21.02
26	300395	菲利华	50,590,392.00	19.61
27	000831	五矿稀土	44,717,953.00	17.33
28	603985	恒润股份	42,979,550.95	16.66
29	002017	东信和平	41,577,752.85	16.11

30	002533	金杯电工	41,292,515.99	16.00
31	002782	可立克	35,451,921.30	13.74
32	688093	世华科技	35,239,802.62	13.66
33	688022	瀚川智能	34,974,528.60	13.55
34	300223	北京君正	34,422,951.00	13.34
35	600383	金地集团	33,562,275.48	13.01
36	000830	鲁西化工	33,326,475.00	12.92
37	601088	中国神华	33,235,452.40	12.88
38	600210	紫江企业	32,625,372.09	12.64
39	300558	贝达药业	31,533,430.46	12.22
40	000498	山东路桥	30,679,599.44	11.89
41	002922	伊戈尔	29,358,606.30	11.38
42	688700	东威科技	29,273,422.90	11.34
43	688187	时代电气	28,390,192.98	11.00
44	603877	太平鸟	28,137,505.16	10.90
45	603393	新天然气	28,016,418.18	10.86
46	688299	长阳科技	27,793,738.93	10.77
47	601058	赛轮轮胎	27,788,719.67	10.77
48	688556	高测股份	27,621,157.76	10.70
49	301058	中粮工科	27,229,185.40	10.55
50	600875	东方电气	26,930,487.00	10.44
51	603306	华懋科技	26,633,764.20	10.32
52	600038	中直股份	26,462,896.03	10.26
53	300567	精测电子	26,393,607.28	10.23
54	601668	中国建筑	23,848,822.00	9.24
55	300659	中孚信息	22,710,662.00	8.80
56	000933	神火股份	22,493,211.39	8.72
57	003031	中瓷电子	22,424,357.20	8.69
58	603667	五洲新春	22,030,211.36	8.54
59	000625	长安汽车	21,784,098.82	8.44
60	600011	华能国际	21,692,535.67	8.41
61	600567	山鹰国际	21,383,059.00	8.29
62	300821	东岳硅材	21,014,065.00	8.14
63	600111	北方稀土	20,932,875.64	8.11
64	688301	奕瑞科技	20,843,016.89	8.08
65	002025	航天电器	20,424,737.00	7.92
66	600366	宁波韵升	20,283,509.60	7.86
67	002487	大金重工	19,818,359.00	7.68
68	000738	航发控制	19,702,563.04	7.64
69	002453	华软科技	19,451,167.00	7.54
70	002135	东南网架	19,220,050.00	7.45
71	688186	广大特材	19,092,857.05	7.40

72	600546	山煤国际	19,057,253.00	7.39
73	300474	景嘉微	18,871,987.00	7.31
74	603897	长城科技	18,681,064.47	7.24
75	600577	精达股份	18,353,662.00	7.11
76	688199	久日新材	17,863,529.51	6.92
77	300573	兴齐眼药	17,398,129.02	6.74
78	300655	晶瑞电材	17,076,467.44	6.62
79	688269	凯立新材	16,437,993.40	6.37
80	601669	中国电建	16,269,903.82	6.31
81	300620	光库科技	16,039,912.00	6.22
82	688608	恒玄科技	15,927,765.14	6.17
83	688099	晶晨股份	15,776,680.83	6.11
84	300082	奥克股份	15,091,173.76	5.85
85	600519	贵州茅台	14,993,680.00	5.81
86	688558	国盛智科	14,980,782.70	5.81
87	002120	韵达股份	14,966,553.42	5.80
88	600233	圆通速递	14,957,060.42	5.80
89	002984	森麒麟	14,864,802.38	5.76
90	300415	伊之密	14,508,764.40	5.62
91	603217	元利科技	13,903,518.80	5.39
92	600176	中国巨石	13,696,199.38	5.31
93	300696	爱乐达	13,639,468.27	5.29
94	600418	江淮汽车	13,126,512.00	5.09
95	000935	四川双马	12,981,725.59	5.03
96	688082	盛美上海	12,949,779.54	5.02
97	300680	隆盛科技	12,692,290.01	4.92
98	300207	欣旺达	12,564,268.00	4.87
99	605336	帅丰电器	12,232,925.20	4.74
100	002475	立讯精密	12,157,617.19	4.71
101	600399	抚顺特钢	11,917,458.00	4.62
102	000568	泸州老窖	11,819,970.00	4.58
103	002810	山东赫达	11,596,844.12	4.49
104	688768	容知日新	11,574,808.73	4.49
105	002714	牧原股份	11,544,724.11	4.47
106	300806	斯迪克	11,452,369.20	4.44
107	300860	锋尚文化	11,359,355.04	4.40
108	300307	慈星股份	10,902,534.00	4.23
109	601666	平煤股份	10,826,631.00	4.20
110	601919	中远海控	10,118,614.00	3.92
111	603809	豪能股份	9,833,088.92	3.81
112	002136	安纳达	9,827,847.00	3.81
113	300724	捷佳伟创	9,822,869.00	3.81

114	600063	皖维高新	9,782,083.00	3.79
115	002266	浙富控股	9,739,595.81	3.77
116	002028	思源电气	9,733,722.00	3.77
117	601238	广汽集团	9,555,236.72	3.70
118	300661	圣邦股份	9,522,308.86	3.69
119	300331	苏大维格	9,453,516.00	3.66
120	002531	天顺风能	9,317,557.00	3.61
121	000012	南玻A	9,154,601.99	3.55
122	003016	欣贺股份	9,111,070.68	3.53
123	688819	天能股份	9,093,739.51	3.52
124	000422	湖北宜化	8,891,283.03	3.45
125	603396	金辰股份	8,889,159.00	3.44
126	600862	中航高科	8,835,131.00	3.42
127	300142	沃森生物	8,828,985.00	3.42
128	000703	恒逸石化	8,774,949.00	3.40
129	688408	中信博	8,763,314.58	3.40
130	300740	水羊股份	8,558,956.35	3.32
131	605589	圣泉集团	8,064,407.92	3.13
132	002534	杭锅股份	7,928,368.00	3.07
133	000683	远兴能源	7,923,961.57	3.07
134	600879	航天电子	7,853,532.00	3.04
135	688699	明微电子	7,802,605.16	3.02
136	600989	宝丰能源	7,777,361.39	3.01
137	603180	金牌厨柜	7,704,752.94	2.99
138	002466	天齐锂业	7,448,136.38	2.89
139	603100	川仪股份	7,447,707.00	2.89
140	300203	聚光科技	7,441,327.00	2.88
141	002658	雪迪龙	7,432,347.00	2.88
142	000049	德赛电池	7,346,991.31	2.85
143	002425	凯撒文化	7,214,978.00	2.80
144	002092	中泰化学	7,188,800.00	2.79
145	002274	华昌化工	7,182,020.00	2.78
146	600760	中航沈飞	7,177,653.00	2.78
147	601888	中国中免	7,142,560.00	2.77
148	000938	紫光股份	7,124,621.98	2.76
149	600096	云天化	6,849,493.59	2.65
150	300750	宁德时代	6,736,094.00	2.61
151	000001	平安银行	6,688,743.00	2.59
152	601166	兴业银行	6,687,115.00	2.59
153	601838	成都银行	6,676,842.27	2.59
154	002304	洋河股份	6,521,521.00	2.53
155	688625	呈和科技	6,417,974.46	2.49

156	603663	三祥新材	6,240,917.72	2.42
157	300502	新易盛	6,196,231.00	2.40
158	601015	陕西黑猫	6,166,661.00	2.39
159	688665	四方光电	6,093,746.07	2.36
160	000983	山西焦煤	6,074,191.00	2.35
161	300677	英科医疗	5,943,585.00	2.30
162	300829	金丹科技	5,884,904.40	2.28
163	688050	爱博医疗	5,857,562.82	2.27
164	688017	绿的谐波	5,742,159.58	2.23
165	688016	心脉医疗	5,716,744.87	2.22
166	300628	亿联网络	5,658,121.00	2.19
167	601898	中煤能源	5,612,761.80	2.18
168	001215	千味央厨	5,537,047.42	2.15
169	603323	苏农银行	5,221,781.00	2.02
170	300762	上海瀚讯	5,215,772.95	2.02
171	002472	双环传动	5,202,013.42	2.02

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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	600552	凯盛科技	82,866,671.72	32.11
2	002206	海利得	64,333,237.93	24.93
3	601857	中国石油	55,103,737.00	21.36
4	300413	芒果超媒	50,472,855.46	19.56
5	002487	大金重工	48,635,492.50	18.85
6	002922	伊戈尔	48,187,803.30	18.67
7	300390	天华超净	41,252,057.98	15.99
8	300769	德方纳米	40,822,041.00	15.82
9	002533	金杯电工	40,419,004.00	15.66
10	601058	赛轮轮胎	38,542,062.01	14.94
11	000831	五矿稀土	37,200,614.73	14.42
12	688700	东威科技	36,151,853.82	14.01
13	688093	世华科技	35,810,633.68	13.88
14	600210	紫江企业	35,364,520.48	13.71
15	688022	瀚川智能	35,161,497.13	13.63
16	300821	东岳硅材	34,579,380.97	13.40
17	603393	新天然气	33,153,367.95	12.85
18	601088	中国神华	32,870,072.84	12.74
19	688099	晶晨股份	31,739,184.28	12.30

20	600383	金地集团	31,439,765.60	12.18
21	000830	鲁西化工	31,147,538.54	12.07
22	603877	太平鸟	29,247,073.52	11.33
23	300223	北京君正	28,281,871.07	10.96
24	600038	中直股份	27,804,832.50	10.78
25	600875	东方电气	27,729,305.00	10.75
26	688556	高测股份	25,846,187.77	10.02
27	600366	宁波韵升	24,977,088.80	9.68
28	002453	华软科技	24,804,102.00	9.61
29	600011	华能国际	23,993,223.41	9.30
30	688187	时代电气	23,372,194.02	9.06
31	601668	中国建筑	22,889,412.00	8.87
32	002984	森麒麟	22,450,564.86	8.70
33	300860	锋尚文化	22,390,695.77	8.68
34	000933	神火股份	21,986,898.32	8.52
35	600111	北方稀土	21,740,370.09	8.43
36	600567	山鹰国际	21,726,508.83	8.42
37	300751	迈为股份	21,500,191.00	8.33
38	688301	奕瑞科技	21,264,551.12	8.24
39	603667	五洲新春	21,234,693.88	8.23
40	002025	航天电器	21,205,322.00	8.22
41	300474	景嘉微	21,132,015.14	8.19
42	600577	精达股份	20,255,968.00	7.85
43	600188	兖矿能源	20,036,733.47	7.77
44	000625	长安汽车	20,019,995.66	7.76
45	603306	华懋科技	19,927,462.40	7.72
46	600176	中国巨石	19,891,274.80	7.71
47	601669	中国电建	19,745,614.00	7.65
48	603897	长城科技	19,466,814.43	7.54
49	600519	贵州茅台	19,312,433.64	7.48
50	688186	广大特材	19,282,835.76	7.47
51	688017	绿的谐波	19,018,493.82	7.37
52	002135	东南网架	18,762,638.00	7.27
53	300655	晶瑞电材	18,702,206.00	7.25
54	300620	光库科技	17,635,690.00	6.83
55	688608	恒玄科技	17,164,701.66	6.65
56	002714	牧原股份	16,725,008.00	6.48
57	688199	久日新材	16,178,436.15	6.27
58	688269	凯立新材	16,133,948.22	6.25
59	600760	中航沈飞	14,995,264.70	5.81
60	688558	国盛智科	14,945,622.81	5.79
61	600546	山煤国际	14,465,334.98	5.61

62	300415	伊之密	14,453,940.00	5.60
63	688768	容知日新	14,434,887.04	5.59
64	300677	英科医疗	14,422,142.00	5.59
65	600399	抚顺特钢	14,395,371.92	5.58
66	300696	爱乐达	13,797,119.68	5.35
67	603396	金辰股份	13,643,921.15	5.29
68	688408	中信博	13,551,949.58	5.25
69	603217	元利科技	13,519,422.37	5.24
70	000935	四川双马	13,352,365.59	5.17
71	000683	远兴能源	13,341,576.00	5.17
72	600233	圆通速递	13,283,527.79	5.15
73	688082	盛美上海	13,177,330.29	5.11
74	002810	山东赫达	12,568,431.70	4.87
75	601666	平煤股份	12,409,490.61	4.81
76	300806	斯迪克	12,311,847.00	4.77
77	002120	韵达股份	12,254,626.00	4.75
78	300082	奥克股份	12,132,667.80	4.70
79	600418	江淮汽车	12,074,209.00	4.68
80	601888	中国中免	11,713,102.00	4.54
81	688665	四方光电	11,683,377.51	4.53
82	002782	可立克	11,629,784.00	4.51
83	605336	帅丰电器	11,489,460.00	4.45
84	600096	云天化	11,459,285.00	4.44
85	002475	立讯精密	11,449,875.87	4.44
86	601919	中远海控	11,403,472.22	4.42
87	688063	派能科技	11,001,109.52	4.26
88	300680	隆盛科技	10,990,506.00	4.26
89	600063	皖维高新	10,935,118.00	4.24
90	300750	宁德时代	10,758,405.00	4.17
91	000049	德赛电池	10,520,536.84	4.08
92	601225	陕西煤业	10,472,614.00	4.06
93	002028	思源电气	10,418,342.00	4.04
94	600989	宝丰能源	10,220,806.40	3.96
95	603180	金牌厨柜	10,143,333.40	3.93
96	601966	玲珑轮胎	9,884,142.00	3.83
97	300307	慈星股份	9,787,392.00	3.79
98	300724	捷佳伟创	9,767,705.00	3.79
99	000738	航发控制	9,681,552.28	3.75
100	002531	天顺风能	9,526,272.00	3.69
101	000012	南玻A	9,473,845.25	3.67
102	601238	广汽集团	9,397,961.48	3.64
103	600893	航发动力	9,382,582.00	3.64

104	300661	圣邦股份	9,357,373.14	3.63
105	002266	浙富控股	9,148,957.40	3.55
106	300331	苏大维格	9,049,292.00	3.51
107	300142	沃森生物	9,029,712.06	3.50
108	000568	泸州老窖	9,021,518.00	3.50
109	002136	安纳达	8,852,298.00	3.43
110	300502	新易盛	8,546,346.29	3.31
111	002304	洋河股份	8,461,063.00	3.28
112	605589	圣泉集团	8,414,794.44	3.26
113	688625	呈和科技	8,325,961.88	3.23
114	300740	水羊股份	8,147,421.37	3.16
115	000422	湖北宜化	8,126,483.00	3.15
116	003016	欣贺股份	8,019,201.56	3.11
117	600879	航天电子	7,855,433.00	3.04
118	002092	中泰化学	7,809,135.00	3.03
119	000547	航天发展	7,731,217.00	3.00
120	601636	旗滨集团	7,652,315.02	2.97
121	603995	甬金股份	7,622,930.00	2.95
122	300203	聚光科技	7,527,020.00	2.92
123	000983	山西焦煤	7,429,042.71	2.88
124	688819	天能股份	7,393,929.38	2.87
125	688699	明微电子	7,350,806.34	2.85
126	000938	紫光股份	7,189,790.00	2.79
127	002389	航天彩虹	7,084,634.00	2.75
128	000703	恒逸石化	7,036,517.00	2.73
129	002425	凯撒文化	7,001,245.15	2.71
130	688016	心脉医疗	6,832,013.72	2.65
131	300395	菲利华	6,796,570.00	2.63
132	002534	杭锅股份	6,788,325.12	2.63
133	601898	中煤能源	6,780,980.00	2.63
134	688050	爱博医疗	6,633,631.87	2.57
135	002658	雪迪龙	6,529,727.00	2.53
136	002274	华昌化工	6,390,691.00	2.48
137	601166	兴业银行	6,197,717.00	2.40
138	001215	千味央厨	6,142,725.47	2.38
139	000001	平安银行	6,127,195.00	2.37
140	603100	川仪股份	6,056,234.00	2.35
141	002466	天齐锂业	5,965,722.20	2.31
142	601838	成都银行	5,846,801.00	2.27
143	603663	三祥新材	5,775,505.02	2.24
144	688626	翔宇医疗	5,723,951.81	2.22
145	603507	振江股份	5,710,876.00	2.21

146	688617	惠泰医疗	5,604,923.99	2.17
147	002049	紫光国微	5,561,905.00	2.16
148	300762	上海瀚讯	5,553,423.00	2.15
149	002585	双星新材	5,508,000.00	2.13
150	300628	亿联网络	5,455,434.00	2.11
151	300829	金丹科技	5,378,199.60	2.08
152	601717	郑煤机	5,360,985.00	2.08

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,051,046,380.03
卖出股票收入（成交）总额	2,815,876,235.96

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

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）	7,801,125.90	0.26
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,801,125.90	0.26

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	113636	甬金转债	55,830	7,801,125.90	0.26

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 本报告期末各资产单元的净值及占基金资产净值的比例

无。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.13.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,023,402.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	159,828.34
5	应收申购款	9,993,260.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,176,491.91

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	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 (%)
建信中小盘先锋股票A	35,706	14,838.99	362,117,010.20	68.34	167,723,916.91	31.66
建信中小盘先锋股票C	2,690	66,423.07	162,264,478.79	90.81	16,413,577.08	9.19
合计	38,396	18,452.94	524,381,488.99	74.01	184,137,493.99	25.99

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	建信中小盘先锋股票 A	3,900,429.48	0.74
	建信中小盘先锋股票 C	17,980.82	0.01
	合计	3,918,410.30	0.55

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	建信中小盘先锋股票 A	>100
	建信中小盘先锋股票 C	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	建信中小盘先锋股票 A	—
	建信中小盘先锋股票 C	—
	合计	—

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中小盘先锋股票 A	建信中小盘先锋股票 C
基金合同生效日 （2014 年 8 月 20 日） 基金份额总额	759,776,341.92	—
本报告期期初基金份额总额	102,153,478.42	—
本报告期基金总申购份额	549,623,990.45	182,380,247.68
减：本报告期基金总	121,936,541.76	3,702,191.81

赎回份额		
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	529,840,927.11	178,678,055.87

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

2021 年 5 月 4 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本年度审计费用为人民币 50000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本公司旗下所有公募基金提供审计服务。

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

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的	佣金	占当期佣金	

			比例		总量的比例	
申万宏源	2	3,817,316,186.49	48.67%	3,555,054.10	50.13%	-
海通证券	2	2,695,347,649.85	34.36%	2,485,764.10	35.05%	-
首创证券	2	622,959,964.54	7.94%	448,751.40	6.33%	-
西南证券	1	443,919,555.44	5.66%	413,424.30	5.83%	-
西部证券	1	264,459,733.98	3.37%	188,108.15	2.65%	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

（2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

（3）具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

（4）佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内增加首创证券 2 个交易单元，无剔除交易单元。本基金与托管在同一托管行的公司其他基金共用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申万宏源	38,540,726.22	22.48%	91,600,000.00	53.98%	-	-
海通证券	87,194,102.84	50.85%	78,100,000.00	46.02%	-	-
首创证券	5,583,000.00	3.26%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	40,141,031.10	23.41%	-	-	-	-

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	关于新增中金财富证券有限公司为建信中小盘先锋股票型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-12-15
2	关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为建信基金多只基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-12-09
3	关于新增华泰证券股份有限公司为建信旗下部分开放式基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-11-29
4	关于建信中小盘先锋股票型证券投资基金 C 类份额新增直销渠道为销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-11-13
5	关于增加申万宏源证券有限公司等为旗下建信中小盘先锋股票型证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-11-01
6	建信中小盘先锋股票型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同等法律文件的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-10-27
7	建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金经理变更公告	指定报刊和/或公司网站	2021-10-12
8	建信基金管理有限责任公司关于增加上海爱建基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-07-27
9	建信基金管理有限责任公司关于新增平安银行为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-07-27
10	建信基金管理有限责任公司关于增加宜信普泽（北京）基金销售有限公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-06-03
11	关于新增华鑫证券为旗下开放式基金销售机构并参加费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-01-20
12	关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为旗下销售机构并参加认购申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2021-01-15

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中小盘先锋股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中小盘先锋股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2022 年 3 月 30 日