

**申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)**  
**2021年年度报告**  
**2021年12月31日**

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年三月三十一日

## §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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	11
<b>§4 管理人报告</b> .....	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遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	18
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.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	19
6.1 审计意见.....	19
6.2 形成审计意见的基础.....	19
6.3 其他信息.....	20
6.4 管理层对财务报表的责任.....	20
6.5 注册会计师的责任.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	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
<b>§8 投资组合报告</b> .....	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.....	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	73

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 .....	73
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 .....	73
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 .....	73
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 .....	73
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	73
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
8.12	投资组合报告附注 .....	74
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>75</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	76
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
9.4	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 .....	76
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>77</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>77</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	77
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 .....	77
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
11.4	基金投资策略的改变 .....	78
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	78
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	78
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
11.9	其他重大事件 .....	80
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>80</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>81</b>
13.1	备查文件目录 .....	81
13.2	存放地点 .....	81
13.3	查阅方式 .....	81

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)	
基金简称	申万菱信量化小盘股票(LOF)	
场内简称	申万量化 LOF	
基金主代码	163110	
交易代码	163110	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011 年 6 月 16 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	267,495,821.32 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011 年 8 月 1 日	
下属分级基金的基金简称	申万菱信量化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量化小盘股票 (LOF)C
下属分级基金的交易代码	163110	013918
报告期末下属分级基金的份额总额	267,482,061.32 份	13,760.00 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用数量化的投资方法精选个股，严格按照纪律执行，力争获取长期稳定的超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金坚持数量化的投资策略，专注于小盘股的投资。基金管理人基于对国内股票市场的大量实证研究，专门开发了适合小盘股投资的数量化投资模型（简称“量化小盘投资模型”），作为本基金投资的核心。本基金的股票选择行为，都是基于该投资模型而定。这种完全基于模型的数量化投资方法能够更加客观、公正而理性的去分析和筛选股票，并且不受

	外部分析师的影响，极大的减少了投资者情绪的影响，从而能够保持投资策略的一致性与有效性。
业绩比较基准	90%×中证500指数收益率+10%×银行同业存款收益率（税后）
风险收益特征	本基金是一只量化股票型基金，属于较高预期风险和较高预期收益的证券投资品种，其风险收益特征从长期平均来看高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		陈晓升	陈四清

### 2.4 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	www.swsmu.com
基金年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海静安区南京西路1266号恒隆广场二期16楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §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	
	申万菱信量 化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量 化小盘股票 (LOF)C	申万菱信量 化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量 化小盘股票 (LOF)C	申万菱信量 化小盘股票 (LOF)A	申万菱信量 化小盘股票 (LOF)C
本期已 实现收 益	47,059,684. 75	-630.63	201,693,164. 33	-	208,634,349. 64	-
本期利 润	65,027,979. 30	303.31	145,544,641. 45	-	502,631,470. 14	-
加权平 均基金 份额本 期利润	0.3135	0.0431	0.4584	-	0.6000	-
本期加 权平均 净值利 润率	13.41%	1.78%	24.61%	-	37.67%	-
本期基 金份额 净值增	13.95%	0.98%	30.84%	-	37.49%	-

长率						
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2021 年末</b>		<b>2020 年末</b>		<b>2019 年末</b>	
	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C
期末可供分配利润	338,224,431.93	19,064.15	212,618,180.77	-	205,374,044.86	-
期末可供分配基金份额利润	1.2645	1.3855	1.0388	-	0.4111	-
期末基金资产净值	653,491,461.76	33,590.60	438,836,210.57	-	818,670,113.23	-
期末基金份额净值	2.4431	2.4412	2.1440	-	1.6386	-
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2021 年末</b>		<b>2020 年末</b>		<b>2019 年末</b>	
	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C
基金份额累计净值增长率	314.37%	0.98%	263.64%	-	177.93%	-

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、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认/申购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认/申购或交易基金的各项费用后，实



际收益水平要低于所列数字。

3、本基金自 2021 年 10 月 25 日起实施基金份额分级。

### 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

##### 1. 申万菱信量化小盘股票(LOF)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	-1.02%	0.78%	3.27%	0.68%	-4.29%	0.10%
过去六个月	4.41%	0.96%	7.35%	0.86%	-2.94%	0.10%
过去一年	13.95%	1.06%	14.12%	0.88%	-0.17%	0.18%
过去三年	104.99%	1.24%	68.22%	1.24%	36.77%	0.00%
过去五年	54.84%	1.18%	17.18%	1.20%	37.66%	-0.02%
自基金合同生效起至今	314.37%	1.46%	61.83%	1.46%	252.54%	0.00%

##### 2. 申万菱信量化小盘股票(LOF)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	0.98%	0.77%	3.99%	0.68%	-3.01%	0.09%

本基金的业绩基准指数=90%×中证 500 指数收益率+10%×银行同业存款收益率(税后)。其中：中证 500 指数作为衡量股票投资部分的业绩基准，银行同业存款收益率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算，计算方式如下：

$$\text{benchmark}(0) = 1000;$$

$$\% \text{benchmark}(t) = 90\% * (\text{中证 500 指数}(t) / \text{中证 500 成分指数}(t-1) - 1) + 10\% * \text{银行同业存款利率} (\text{税后}) / 365;$$

$$\text{benchmark}(t) = (1 + \% \text{benchmark}(t)) * \text{benchmark}(t-1);$$

其中 t=1,2,3,...。

#### 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

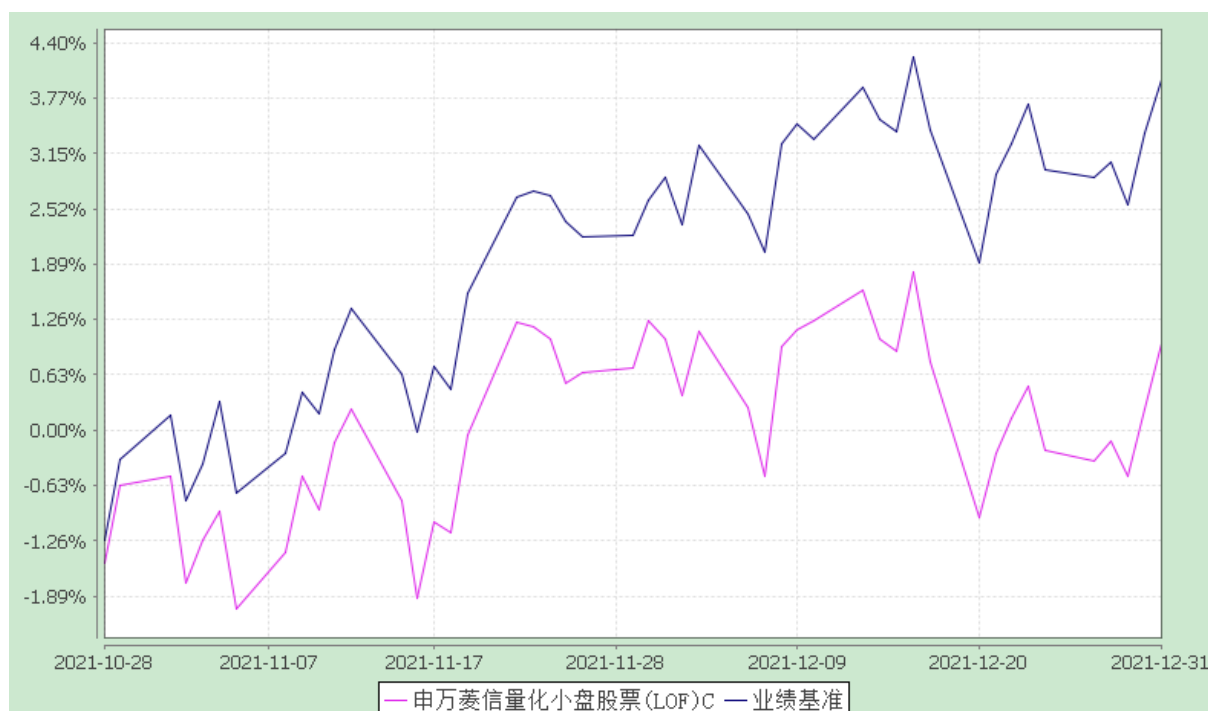
## 申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

自基金合同生效以来份额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  
(2011年6月16日至2021年12月31日)

## 1、申万菱信量化小盘股票(LOF)A



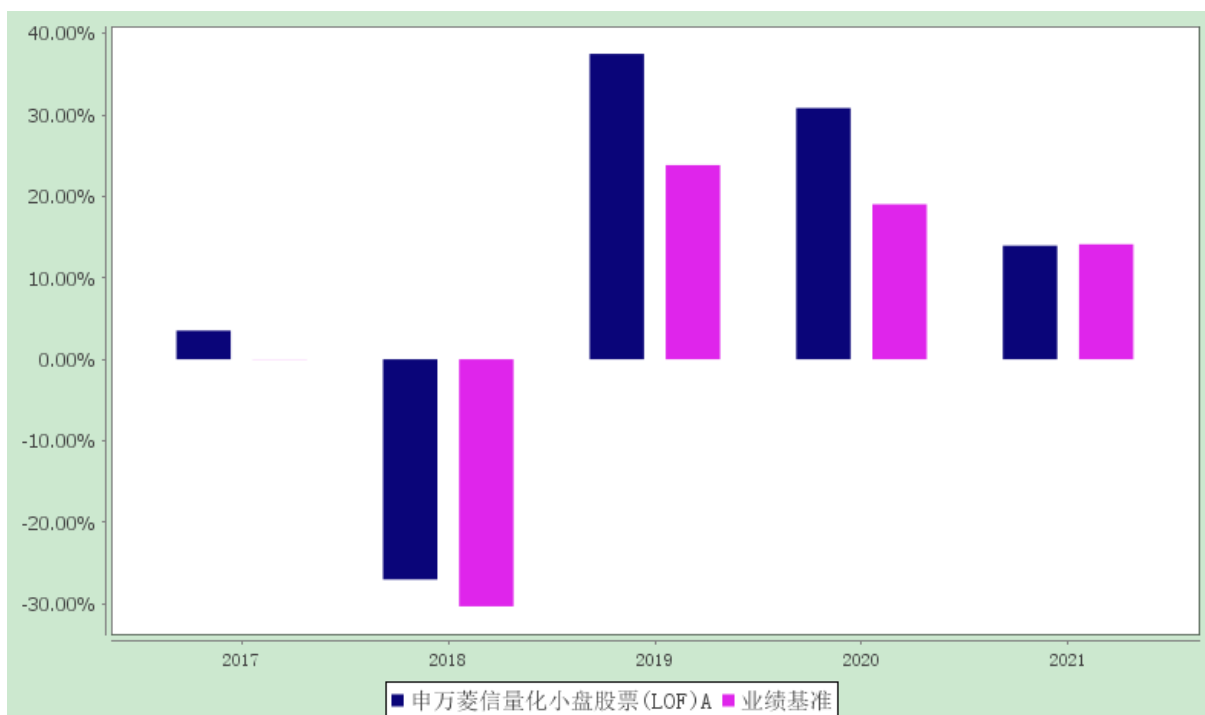
## 2、申万菱信量化小盘股票(LOF)C



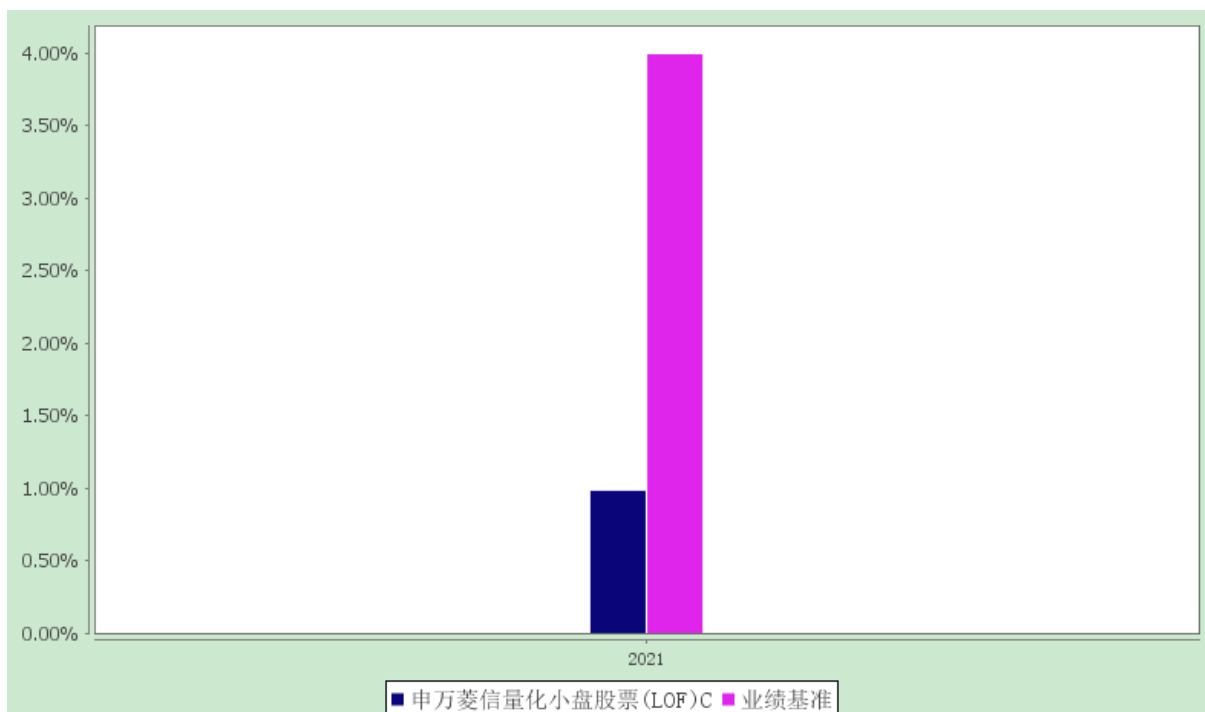
## 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)  
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、申万菱信量化小盘股票(LOF)A



2、申万菱信量化小盘股票(LOF)C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、申万菱信量化小盘股票(LOF)A:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	-
2020	-	-	-	-	-
2019	2.512	97,856,104.61	105,604,988.66	203,461,093.27	-
合计	2.512	97,856,104.61	105,604,988.66	203,461,093.27	-

## 2、申万菱信量化小盘股票(LOF)C:

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## §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

申万菱信基金管理有限公司(SWS MU Fund Management Co.,Ltd)成立于 2004 年 1 月 15 日,公司总部设在上海,注册资本 1.5 亿元,净资产超过 11 亿元。

申万菱信基金自成立以来,始终将持有人的利益放在首位,秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命,遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来,申万菱信基金围绕市场和客户需求,逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划;通过努力打造“美好生活”系列权益产品,不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类,致力于为持有人提供“温暖陪伴”的产品服务,以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有公募基金 62 只,资产管理总规模超过 1234 亿元,公募产品累计分红 158.66 亿元(数据截至 2021 年 12 月 31 日)。

近年来,申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform),推动“研究数字化”;通过基金经理的风格开发、稳定和优化,推动“投资风格化”;通过风险管理工作的关口前移,加强市场风险管理支持,推动“风控全流程”,从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”,以提升投资业绩。此外,申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系(Excellent Strategy & Product)、卓越品牌与客户服务体系(Excellent Branding & Service),提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚,中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67%的股份,日本三

菱 UFJ 信托银行持有公司 33% 的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人(QDLP)等业务资格，并全资设立申万菱信(上海)资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王剑	本基金基金经理	2021-03-22	-	6年	王剑先生，博士研究生。2015年起从事金融相关工作，曾任职于东证期货、浙商基金等。2020年12月加入申万菱信基金，现任申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理。
俞诚	本基金基金经理	2020-04-15	-	12年	俞诚先生，经济学学士、2009年起从事金融相关工作，2009年08月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任产品与金融工程总部金融工程师、数量研究员，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信沪深300价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金(LOF)基金经理，现任申万菱信中证500指数增强

					型证券投资基金、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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。

3.本报告期内，公司聘任王剑担任本基金基金经理，具体见本基金管理人的相关公告。

#### 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《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

#### 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投

资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于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，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后按两两组合归类计算平均价差率。首先，假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为0，我们进行了95%的置信度、假设平均价差率为0的T检验，若通过该假设检验，则认为该两两组合的交易得到了公平的执行；对于未通过假设检验的情况，我们还计算了两两组合价差占优比差、模拟输送比例等指标；若综合以上各项指标，认为仍存在一定的嫌疑，则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。经分析本期未发生异常情况。

对于场外同向交易，我们分析了本报告期内不同时间窗口内（日内、3日内和5日内）两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手，未发现利益输送的情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

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超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 18 次。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 年整体波动较大，一季度高景气的成长股随着美债收益率的上涨，出现了较大的回撤，随着行业景气度的持续以及政策的刺激，二三季度出现了成长股的大幅反弹，比如新能源指数，半导体指数等，都呈现了较大的涨幅；而同时疫情出现了较大反复，消费股表现持续低迷。四季度成长股回落而价值股表现优异。以量化观点来看，由于一季度成长因子，动量因子大幅回撤，二三季度出现了较大的修复，多空净值创出了新高；按季节效应，价值因子在四季度表现较为突出。

操作层面，维持了均衡配置，风格整体中性；行业层面依据行业景气度模型进行了超低配。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为 13.95%，同期业绩基准表现为 14.12%。

本基金 C 类产品报告期内净值表现为 0.98%，同期业绩基准表现为 3.99%。

#### 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，市场预计将继续呈现分化走势，预期成长、价值、盈利等因子都会有阶段性机会，因子方面维持均衡配置，行业维度按照景气度模型进行偏离。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作继续坚持以维护基金份额持有人利益为出发点，紧密围绕优化和完善公司内控体系，重点从优化制度流程、深化合规管理工作、强化员工行为规范、推进内审稽核、



信息披露以及反洗钱等方面有序开展各项工作，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作重点包括：

1、全面检视和梳理内部制度和业务流程，内部控制机制得到进一步完善。

本报告期内，公司根据最新法规政策的要求，结合业务运作情况，秉持规范内控流程、优化管理机制的原则对相关制度进行制定、梳理与修订，以加强对公司各项业务活动的管理，促进公司经营规范化和决策科学化，同时在公司上下进一步传导了制度建设文化，可操作性和合规效能得到不断提升。

2、深入开展合规宣导与培训，强化员工行为管控。始终坚持实时跟踪法律、法规、准则变化和监管动态，通过各种形式加强合规传导，深入推进合规文化建设。持续强化员工行为管控，将廉洁教育与合规培训相结合，促进员工依法依规履行职责，员工职业操守和行为规范的合规意识得到不断强化。

3、扎实做好合规管理工作，以合规促进业务发展。积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。不断完善一线合规工作，充分发挥专/兼职合规人员作用，切实强化一线人员的合规意识。

4、深化各类稽核检查，不断优化完善内控措施。按年度计划开展了对多条线多业务的常规稽核工作，多方着手加强后续监督执行；稳步开展定期合规检查，及时优化内控流程，强化公司制度执行和落实，进一步提升了公司内控管理水平。

5、遵守《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，完成旗下基金的基金合同、托管协议及招募说明书修订，梳理完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、准确、完整、及时、规范。2021年公司信息披露工作严格按照最新法规制度有关要求执行，使基金持有人能够及时了解基金和公司经营运作的相关信息，有效维护基金持有人知情权。

6、严格按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及其配套规则的要求，规范与销售机构的销售费用约定，强化销售过程的合法合规，加强基金宣传推介材料的流程管理，避免误导投资者行为的发生，保护基金持有人的合法权益。

7、完善反洗钱内控体系建设，进一步加强洗钱风险管控。完成年度反洗钱分类评级工作，全面加强客户身份识别管控，推进完善客户风险评级，优化反洗钱信息技术系统，进一步提升可疑交易监测有效性，有计划地开展了反洗钱宣传和培训工作。

本报告期内，在监察稽核工作的开展过程中本基金管理人未发现本基金在投资运作等方面存在

与法律法规或基金合同约定相违背的情况。今后本基金管理人将继续坚持确保基金份额持有人的利益不受损害的原则，以科学的风险管理为基础，积极有效地开展监察稽核工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，将导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立资产估值委员会，负责根据法规要求，尽可能科学、合理地制定估值政策，审议批准估值程序，并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认，以保护基金份额持有人的利益。

资产估值委员会由本基金管理人分管基金运营的副总经理，督察长，分管基金投资的副总经理，基金运营部门、法律合规与审计部门、风险管理部门负责人组成。其中，分管基金运营的副总经理张丽红女士，拥有 17 年的基金行业运营、财务管理相关经验；督察长、法律合规与审计部负责人（代）王菲萍女士，拥有 17 年的基金行业合规管理经验；分管基金投资的副总经理周小波先生，拥有 15 年的证券投资基金投资研究管理相关经验；基金运营部负责人李濮君女士，拥有 20 年的基金会计经验；风险管理部门负责人葛诚亮先生，拥有 10 年的基金行业风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值；采用中证指数有限公司提供的估值数据对交易所债进行估值。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法

律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

毕马威华振审字第 2201114 号

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）（以下简称“申万菱信量化小盘”）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。

### 6.1 审计意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了申万菱信量化小盘 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。

### 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（以下简称“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，我们独立于申万菱信量化小盘，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

申万菱信量化小盘管理人申万菱信基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括申万菱信量化小盘 2021 年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 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的、中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作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，基金管理人管理层负责评估申万菱信量化小盘的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非申万菱信量化小盘计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督申万菱信量化小盘的财务报告过程。

### 6.5 注册会计师的责任

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) 评价基金管理人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) 对基金管理人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，就可能导致对申万菱信量化小盘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申万菱信量化小盘不能持续经营。

(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。

我们与基金管理人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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

王国蓓 侯雯

上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼

2022 年 3 月 30 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

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	34,697,484.69	32,778,929.04
结算备付金		11,046,231.58	5,410,153.83
存出保证金		1,708,536.73	231,605.60
交易性金融资产	7.4.7.2	604,248,431.31	407,916,559.79
其中：股票投资		604,248,431.31	407,803,734.19
基金投资		-	-
债券投资		-	112,825.60
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		5,220,944.09	1,342,215.07
应收利息	7.4.7.5	10,003.57	5,811.69
应收股利		-	-
应收申购款		89,876.57	93,580.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>657,021,508.54</b>	<b>447,778,855.33</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2021年12月31日	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		-	-
应付赎回款		794,733.89	6,566,374.91
应付管理人报酬		832,882.19	651,885.73
应付托管费		138,813.70	108,647.63
应付销售服务费		7.81	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,517,477.02	1,390,701.86
应交税费		7,309.25	2.87
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	205,232.32	225,031.76
<b>负债合计</b>		<b>3,496,456.18</b>	<b>8,942,644.76</b>
<b>所有者权益:</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	267,495,821.32	204,681,789.29
未分配利润	7.4.7.10	386,029,231.04	234,154,421.28
<b>所有者权益合计</b>		<b>653,525,052.36</b>	<b>438,836,210.57</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>657,021,508.54</b>	<b>447,778,855.33</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 2.4431 元，C 类基金份额净值 2.4412 元；基金份额总额 267,495,821.32 份，其中 A 类基金份额 267,482,061.32 份，C 类基金份额 13,760.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>81,422,218.16</b>	<b>167,530,519.90</b>
1.利息收入		455,326.21	355,120.29
其中：存款利息收入	7.4.7.11	299,728.12	352,470.76
债券利息收入		155,598.09	2,649.53
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）		62,862,970.56	222,700,474.28
其中：股票投资收益	7.4.7.12	53,536,526.60	215,651,664.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	109,283.97	-232,893.32
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	3,110,248.54	1,483,294.51
股利收益	7.4.7.15	6,106,911.45	5,798,408.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	17,969,228.49	-56,148,522.88
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	134,692.90	623,448.21
<b>减：二、费用</b>		<b>16,393,935.55</b>	<b>21,985,878.45</b>
1. 管理人报酬		7,250,461.15	8,909,010.20
2. 托管费		1,208,410.15	1,484,834.98
3. 销售服务费		12.20	-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,625,742.17	11,296,595.90



5. 利息支出		8,080.87	-
其中：卖出回购金融资产支出		8,080.87	-
6. 税金及附加		11,197.01	5,349.37
7. 其他费用	7.4.7.19	290,032.00	290,088.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>65,028,282.61</b>	<b>145,544,641.45</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>65,028,282.61</b>	<b>145,544,641.45</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)

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）	204,681,789.29	234,154,421.28	438,836,210.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	65,028,282.61	65,028,282.61
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）	62,814,032.03	86,846,527.15	149,660,559.18
其中：1.基金申购款	159,753,168.92	211,457,976.16	371,211,145.08
2.基金赎回款	-96,939,136.89	-124,611,449.01	-221,550,585.90
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)	267,495,821.32	386,029,231.04	653,525,052.36
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)	499,602,868.22	319,067,245.01	818,670,113.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	145,544,641.45	145,544,641.45
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)	-294,921,078.93	-230,457,465.18	-525,378,544.11
其中：1.基金申购款	161,655,306.23	150,349,554.48	312,004,860.71
2.基金赎回款	-456,576,385.16	-380,807,019.66	-837,383,404.82
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)	204,681,789.29	234,154,421.28	438,836,210.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:汪涛,主管会计工作负责人:张丽红,会计机构负责人:李濮君

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）（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”）证监基金字[2011]525号《关于核准申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）募集的批复》核准，由申万菱信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《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）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 512,877,725.48 元。经向中国证监会备案，《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同》于 2011 年 6 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 512,987,683.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 109,957.57 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所深证上[2011]225 号文审核同意，本基金 63,363,855 份基金份额于 2011 年 8 月 1 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。根据《关于申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）增加 C 类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2021 年 10 月 25 日起增加 C 类基金份额。增加 C 类份额后，本基金将分设 A 类和 C 类两类基金份额，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的持有本基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金份额余额为 A 类基金份额。本基金新增的 C 类基金份额不开放场内申购与赎回，不上市交易。C 类基金份额投资者仅可通过场外方式对基金份额进行申购与赎回。本基金自 2021 年 10 月 25 日起开始办理 C 类基金份额的申购、赎回、转换与定期定额投资业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金合同》和最新公布的《申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）更新招募说明书》的有关规定，本基金投资于流动性良好的金融工具，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及存托凭证）、债券、权证、资产支持证券、股指期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金可以参与融资业务。本基金各类资产投资比例为：本基金投资于股票及存托凭证的资产不低于基金资产的 80%，投资于本基金界定的小盘股及存托凭证占非现金基金资产的比例不低于 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，应当保持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、存出保证金及应收申购款等。本基金投资股指期货、权证、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定

执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×90%+银行同业存款收益率（税后）×10%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况、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

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 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，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

本基金在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本基金现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本基金现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。

本基金持有的股票投资和债券投资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。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。

##### 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

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值计量，公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

- 应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

- 除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 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；

- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值

- 因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本基金终止确认该金融负债或其一部分。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除企业会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

#### 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日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。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差

额确认。

股利收益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确认。

债券利息收入按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,逐日计提利息收入。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息收入。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

#### 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。

本基金的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本基金的其他费用如无需在受益期内预提或分摊,则于发生时直接计入基金损益;如需采用预提或待摊的方法,预提或待摊时计入基金损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,而 C 类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同,本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为分红与红利再投资。登记在场外的基金份额,投资者可选择现金红利或将现金红利自

动转为相应类别的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；登记在场内的基金份额，投资者只能选择现金分红这一收益分配方式，具体收益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，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》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、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，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发 [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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### 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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。



#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》、财税[2017]2号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 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（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资

管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税

[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

#### 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	34,697,484.69	32,778,929.04
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	34,697,484.69	32,778,929.04

##### 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	584,722,323.28	604,248,431.31	19,526,108.03
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		584,722,323.28	604,248,431.31	19,526,108.03
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		405,574,710.25	407,803,734.19	2,229,023.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	64,000.00	112,825.60	48,825.60
	银行间市场	-	-	-
	合计	64,000.00	112,825.60	48,825.60
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		405,638,710.25	407,916,559.79	2,277,849.54

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末			
	2021年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,778,710.00	-	-	IC2203、 IC2206
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,778,710.00	-	-	IC2203、 IC2206
项目	上年度末			
	2020年12月31日			

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 2 手中证 500 股指期货 IC2203，合约市值为 2,922,320.00 元，持有 6 手中证 500 股指期货 IC2206，合约市值为 8,577,360.00 元。

#### 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

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 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	3,936.24	5,154.09
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	6,018.49	478.06
应收债券利息	-	64.81

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	48.84	114.73
合计	10,003.57	5,811.69

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,517,477.02	1,390,701.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,517,477.02	1,390,701.86

#### 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	477.81	20,277.25
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	192,000.00	192,000.00
其他应付款	12,754.51	12,754.51
合计	205,232.32	225,031.76

#### 7.4.7.9 实收基金

申万菱信量化小盘股票(LOF)A

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	账面金额
上年度末	204,681,789.29	204,681,789.29
本期申购	159,722,450.24	159,722,450.24
本期赎回（以“-”号填列）	-96,922,178.21	-96,922,178.21
本期末	267,482,061.32	267,482,061.32

申万菱信量化小盘股票(LOF)C

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	账面金额
本期申购	30,718.68	30,718.68
本期赎回（以“-”号填列）	-16,958.68	-16,958.68
本期末	13,760.00	13,760.00

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、截至 2021 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 4,927,451.00 份（2020 年 12 月 31 日:6,718,816.00 份），托管在场外未上市交易的基金份额为 262,568,370.32 份（2020 年 12 月 31 日:197,962,973.29 份）。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

3、本基金自 2021 年 10 月 25 日起实施基金份额分级。

#### 7.4.7.10 未分配利润

申万菱信量化小盘股票(LOF)A

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	212,618,180.77	21,536,240.51	234,154,421.28
本期利润	47,059,684.75	17,968,294.55	65,027,979.30
本期基金份额交易产生的变动数	78,546,566.41	8,280,433.45	86,826,999.86

其中：基金申购款	184,926,192.19	26,488,398.54	211,414,590.73
基金赎回款	-106,379,625.78	-18,207,965.09	-124,587,590.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	338,224,431.93	47,784,968.51	386,009,400.44

## 申万菱信量化小盘股票(LOF)C

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
本期利润	-630.63	933.94	303.31
本期基金份额交易产生的变动数	19,694.78	-167.49	19,527.29
其中：基金申购款	42,702.17	683.26	43,385.43
基金赎回款	-23,007.39	-850.75	-23,858.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	19,064.15	766.45	19,830.60

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	115,633.64	304,761.20
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	28,618.14	41,734.36
其他	155,476.34	5,975.20
合计	299,728.12	352,470.76

## 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	2,469,382,239.58	3,873,798,776.80
减：卖出股票成本总额	2,415,845,712.98	3,658,147,112.49
买卖股票差价收入	53,536,526.60	215,651,664.31

## 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	50,890,103.70	29,759,593.98
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,122,934.10	29,965,726.50
减：应收利息总额	657,885.63	26,760.80
买卖债券差价收入	109,283.97	-232,893.32

## 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	3,110,248.54	1,483,294.51

## 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,106,911.45	5,798,408.78
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	6,106,911.45	5,798,408.78

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	17,248,258.49	-55,720,769.54
——股票投资	17,297,084.09	-55,769,595.14
——债券投资	-48,825.60	48,825.60
——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	720,970.00	-427,753.34
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	17,969,228.49	-56,148,522.88

## 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	130,714.56	619,255.31
转换费收入	3,978.34	4,063.95
其他收入	-	128.95
合计	134,692.90	623,448.21

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。

2、本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分组成，其中不低于赎回费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	7,625,742.17	11,296,595.90
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	7,625,742.17	11,296,595.90

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	72,000.00	72,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
上市年费	60,000.00	60,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
债券账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行汇划费	832.00	888.00
合计	290,032.00	290,088.00

#### 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
申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信”）	基金管理人、基金销售机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金销售机构

三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

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
申万宏源	1,727,230,839.27	34.23%	957,468,940.60	13.22%

##### 7.4.10.1.2 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
申万宏源	1,588,348.17	34.20%	428,688.14	28.25%
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
申万宏源	883,799.54	13.29%	695,838.55	50.04%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,250,461.15	8,909,010.20
其中：支付销售机构的客户维护费	2,204,066.31	3,186,968.13

注：支付基金管理人申万菱信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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数。}$$

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,208,410.15	1,484,834.98

注：支付基金托管人中国工商银行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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数。}$$

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间未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****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**

本报告期和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

#### 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
中国工商银行股份有限公司	34,697,484.69	115,633.64	32,778,929.04	304,761.20

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

##### 7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 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	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

				型						
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股待上市	16.53	16.53	333.00	5,504.49	5,504.49	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	限售期股票	4.57	20.90	444.00	2,029.08	9,279.60	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	限售期股票	8.40	23.80	328.00	2,755.20	7,806.40	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	限售期股票	9.96	27.28	203.00	2,021.88	5,537.84	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	限售期股票	11.90	45.42	420.00	4,998.00	19,076.40	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2022-01-07	限售期股票	8.29	26.02	782.00	6,482.78	20,347.64	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	限售期股票	9.46	41.39	290.00	2,743.40	12,003.10	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	限售期股票	1.55	20.84	403.00	624.65	8,398.52	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	限售期股票	18.03	62.64	203.00	3,660.09	12,715.92	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	限售期股票	11.45	16.61	286.00	3,274.70	4,750.46	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	限售期股票	5.31	13.49	733.00	3,892.23	9,888.17	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	限售期股票	14.14	89.74	462.00	6,532.68	41,459.88	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	限售期股票	6.10	31.45	242.00	1,476.20	7,610.90	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	限售期股票	4.97	12.49	513.00	2,549.61	6,407.37	-

301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	限售期股票	15.14	59.93	108.00	1,635.12	6,472.44	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	限售期股票	23.38	29.80	205.00	4,792.90	6,109.00	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	限售期股票	14.82	24.17	193.00	2,860.26	4,664.81	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	限售期股票	6.68	20.23	266.00	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	限售期股票	6.96	12.44	1,703.00	11,852.88	21,185.32	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	限售期股票	13.57	38.41	241.00	3,270.37	9,256.81	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	限售期股票	7.31	28.18	215.00	1,571.65	6,058.70	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	限售期股票	15.81	28.34	335.00	5,296.35	9,493.90	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	限售期股票	8.34	48.96	290.00	2,418.60	14,198.40	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	限售期股票	4.13	12.95	843.00	3,481.59	10,916.85	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	限售期股票	19.34	32.88	196.00	3,790.64	6,444.48	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	限售期股票	60.64	234.57	233.00	14,129.12	54,654.81	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	限售期股票	8.11	33.66	252.00	2,043.72	8,482.32	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	限售期股票	11.87	28.77	155.00	1,839.85	4,459.35	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	限售期股	6.90	21.69	355.00	2,449.50	7,699.95	-



				票						
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	限售期股票	8.03	19.01	218.00	1,750.54	4,144.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	限售期股票	8.09	19.29	259.00	2,095.31	4,996.11	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	限售期股票	4.17	30.91	587.00	2,447.79	18,144.17	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	限售期股票	3.31	17.01	523.00	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	限售期股票	17.40	36.13	153.00	2,662.20	5,527.89	-
301066	万事利	2021-09-13	2022-03-22	限售期股票	5.24	22.83	344.00	1,802.56	7,853.52	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	限售期股票	13.98	28.36	144.00	2,013.12	4,083.84	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	限售期股票	5.17	44.15	539.00	2,786.63	23,796.85	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	限售期股票	7.46	33.38	181.00	1,350.26	6,041.78	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	限售期股票	12.24	32.06	144.00	1,762.56	4,616.64	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	限售期股票	5.77	15.34	756.00	4,362.12	11,597.04	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	限售期股票	11.92	29.17	140.00	1,668.80	4,083.80	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	限售期股票	12.95	18.33	403.00	5,218.85	7,386.99	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	限售期股票	9.08	15.23	416.00	3,777.28	6,335.68	-
30108	可孚	2021-1	2022-0	限售	93.09	75.43	300.00	27,927	22,629	-

7	医疗	0-15	4-25	期股票				.00	.00	
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	限售期股票	33.16	24.99	548.00	18,171.68	13,694.52	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	限售期股票	19.11	69.92	220.00	4,204.20	15,382.40	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	限售期股票	10.45	12.19	1,859.00	19,426.55	22,661.21	-
301091	深城交	2021-10-20	2022-04-29	限售期股票	36.50	31.42	524.00	19,126.00	16,464.08	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	限售期股票	36.31	35.50	323.00	11,728.13	11,466.50	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	限售期股票	58.08	50.21	270.00	15,681.60	13,556.70	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	限售期股票	79.60	80.15	214.00	17,034.40	17,152.10	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	限售期股票	27.81	34.57	599.00	16,658.19	20,707.43	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	限售期股票	10.48	43.93	379.00	3,971.92	16,649.47	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	限售期股票	12.37	21.35	662.00	8,188.94	14,133.70	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	限售期股票	14.33	34.23	286.00	4,098.38	9,789.78	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	限售期股票	26.17	53.55	285.00	7,458.45	15,261.75	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	限售期股票	10.07	19.07	1,214.00	12,224.98	23,150.98	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	限售期股票	86.06	95.89	253.00	21,773.18	24,260.17	-

301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	限售期股票	39.08	54.86	329.00	12,857.32	18,048.94	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	限售期股票	116.88	122.05	324.00	37,869.12	39,544.20	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	限售期股票	27.12	33.34	294.00	7,973.28	9,801.96	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	限售期股票	13.00	23.25	647.00	8,411.00	15,042.75	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	限售期股票	30.73	30.08	297.00	9,126.81	8,933.76	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	限售期股票	25.80	35.13	967.00	24,948.60	33,970.71	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	限售期股票	69.89	90.93	280.00	19,569.20	25,460.40	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股待上市	41.98	41.98	5,407.00	226,985.86	226,985.86	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新股待上市	22.98	22.98	15,467.00	355,431.66	355,431.66	-
688501	青达环保	2021-07-09	2022-01-17	限售期股票	10.57	21.05	1,759.00	18,592.63	37,026.95	-
688553	汇宇制药	2021-10-14	2022-04-26	限售期股票	38.87	32.12	5,490.00	213,396.30	176,338.80	-
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	限售期股票	15.49	75.26	3,409.00	52,805.41	256,561.34	-
688779	长远锂科	2021-08-03	2022-02-11	限售期股票	5.65	22.85	25,482.00	143,973.30	582,263.70	-
688793	倍轻松	2021-07-07	2022-01-17	限售期股票	27.40	101.41	1,454.00	39,839.60	147,450.14	-

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 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

本基金为量化股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资和权证投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是量化股票型证券投资基金，属于中高风险品种，本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，使得本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“长期平均风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金”。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险和其他价格风险。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过对其投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0%（上期末：0.03%）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影

响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

#### 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在基金运作过程中严格按照《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》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股，不得超过该上市公司可流通股票的30%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。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投资的公允价值。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额(如有)将在1个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，本基金持有及承担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。

##### 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个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	34,697,484.69	-	-	-	-	-	34,697,484.69
结算备付金	11,046,231.58	-	-	-	-	-	11,046,231.58
存出保证金	98,581.53	-	-	-	-	1,609,955.20	1,708,536.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	604,248,431.31	604,248,431.31
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	5,220,944.09	5,220,944.09
应收利息	-	-	-	-	-	10,003.57	10,003.57
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	89,876.57	89,876.57
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

资产总计	45,842,297.80	-	-	-	-	611,179,210.74	657,021,508.54
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	794,733.89	794,733.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	832,882.19	832,882.19
应付托管费	-	-	-	-	-	138,813.70	138,813.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	7.81	7.81
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,517,477.02	1,517,477.02
应交税费	-	-	-	-	-	7,309.25	7,309.25
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	205,232.32	205,232.32
负债总计	-	-	-	-	-	3,496,456.18	3,496,456.18
利率敏感度缺口	45,842,297.80	-	-	-	-	607,682,754.56	653,525,052.36
上年度末 2020年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	32,778,929.04	-	-	-	-	-	32,778,929.04
结算备付金	5,410,153.83	-	-	-	-	-	5,410,153.83
存出保证金	231,605.60	-	-	-	-	-	231,605.60
交易性金融资产	-	-	-	-	112,825.60	407,803,734.19	407,916,559.79



买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,342,215.07	1,342,215.07
应收利息	-	-	-	-	-	5,811.69	5,811.69
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	93,580.31	93,580.31
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	38,420,688.47	-	-	-	112,825.60	409,245,341.26	447,778,855.33
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,566,374.91	6,566,374.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	651,885.73	651,885.73
应付托管费	-	-	-	-	-	108,647.63	108,647.63
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,390,701.86	1,390,701.86
应交税费	-	-	-	-	-	2.87	2.87
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	225,031.76	225,031.76
负债总计	-	-	-	-	-	8,942,644.76	8,942,644.76
利率敏感度缺口	38,420,688.47	-	-	-	112,825.60	400,302,696.50	438,836,210.57

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

于本期末,本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为0%(上期末:0.03%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上期末:同)。

#### 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,因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险,该风险可能与特定投资品种相关,也有可能与整体投资品种相关。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的量化股票型基金,所以存在很高的市场价格风险。

本基金管理人通过采用数量化技术对投资策略进行优化,将特定的投资思想和理念通过具体指标与参数的设定体现在数量模型中,坚持以数量化的方式进行投资。

此外,本基金管理人在构建基金资产配置和资产投资组合的基础上,通过建立事前和事后跟踪误差以及运用多种定量的方法对基金进行风险度量,来测试基金的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制,争取将风险控制在可承受的范围内。

#### 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	604,248,431.31	92.46	407,803,734.19	92.93
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

合计	604,248,431.31	92.46	407,803,734.19	92.93
----	----------------	-------	----------------	-------

注：其他包含股指期货投资，于本期末，持仓数量为 8 手，合约市值为 11499680 元(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的估值期货投资与相关的期货暂收款(结算所得持仓损益)之间按抵消后的金额为 0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.以中证 500 指数为基准衡量其他价格风险		
	2.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：人民币元）	
		本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	基准上升 5%	增加约 29,640,000.00	增加约 20,430,000.00
	基准下降 5%	减少约 29,640,000.00	减少约 20,430,000.00

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

一、本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2021 年 12 月 31 日，属于第一层次的公允价值计量为 601,594,840.62 元；属于第二层次的公允价值为 2,653,590.69 元。

于 2020 年 12 月 31 日，属于第一层次的公允价值计量为 404,291,525.95 元；属于第二层次的公允价值为 3,625,033.84 元。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。（2020 年 12 月 31 日：无）。

## 二、其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## §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	604,248,431.31	91.97
	其中：股票	604,248,431.31	91.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	45,743,716.27	6.96
8	其他各项资产	7,029,360.96	1.07
9	合计	657,021,508.54	100.00

注：本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

### 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	4,462,640.00	0.68
B	采矿业	25,594,001.20	3.92

C	制造业	373,156,574.09	57.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,583,512.80	3.00
E	建筑业	11,451,685.00	1.75
F	批发和零售业	13,153,922.85	2.01
G	交通运输、仓储和邮政业	16,580,548.00	2.54
H	住宿和餐饮业	1,305,536.64	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	42,269,486.46	6.47
J	金融业	44,205,057.23	6.76
K	房地产业	7,774,796.00	1.19
L	租赁和商务服务业	10,865,782.13	1.66
M	科学研究和技术服务业	57,946.22	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	8,885,213.23	1.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,485.00	0.00
Q	卫生和社会工作	3,330,138.95	0.51
R	文化、体育和娱乐业	17,200,698.51	2.63
S	综合	4,366,407.00	0.67
	合计	604,248,431.31	92.46

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金未开通港股通交易机制投资于港股。

### 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	300059	东方财富	235,121.00	8,725,340.31	1.34
2	000988	华工科技	309,240.00	8,615,426.40	1.32
3	600885	宏发股份	113,900.00	8,501,496.00	1.30
4	002030	达安基因	409,751.00	8,219,605.06	1.26
5	600415	小商品城	1,613,743.00	7,826,653.55	1.20
6	688099	晶晨股份	59,737.00	7,777,757.40	1.19
7	000686	东北证券	880,400.00	7,729,912.00	1.18

8	603444	吉比特	18,004.00	7,594,987.40	1.16
9	600884	杉杉股份	222,900.00	7,304,433.00	1.12
10	600256	广汇能源	1,114,330.00	7,287,718.20	1.12
11	000039	中集集团	410,200.00	7,039,032.00	1.08
12	603077	和邦生物	1,979,900.00	6,751,459.00	1.03
13	002180	纳思达	140,000.00	6,686,400.00	1.02
14	000060	中金岭南	1,285,200.00	6,310,332.00	0.97
15	601699	潞安环能	544,700.00	6,160,557.00	0.94
16	002185	华天科技	455,900.00	5,794,489.00	0.89
17	601928	凤凰传媒	708,000.00	5,727,720.00	0.88
18	000598	兴蓉环境	888,900.00	5,617,848.00	0.86
19	000830	鲁西化工	366,300.00	5,589,738.00	0.86
20	600862	中航高科	153,000.00	5,471,280.00	0.84
21	600563	法拉电子	23,500.00	5,461,400.00	0.84
22	300009	安科生物	411,300.00	5,383,917.00	0.82
23	002152	广电运通	425,600.00	5,064,640.00	0.77
24	600642	申能股份	685,800.00	5,054,346.00	0.77
25	000156	华数传媒	569,200.00	4,815,432.00	0.74
26	002396	星网锐捷	200,300.00	4,721,071.00	0.72
27	002065	东华软件	596,600.00	4,653,480.00	0.71
28	300474	景嘉微	30,400.00	4,626,880.00	0.71
29	600298	安琪酵母	75,300.00	4,545,108.00	0.70
30	601615	明阳智能	173,800.00	4,536,180.00	0.69
31	002002	鸿达兴业	739,000.00	4,478,340.00	0.69
32	600598	北大荒	306,500.00	4,462,640.00	0.68
33	000750	国海证券	1,083,200.00	4,451,952.00	0.68
34	300166	东方国信	410,600.00	4,434,480.00	0.68
35	002013	中航机电	243,200.00	4,421,376.00	0.68
36	600623	华谊集团	485,729.00	4,420,133.90	0.68
37	601866	中远海发	1,356,500.00	4,408,625.00	0.67
38	601598	中国外运	976,100.00	4,372,928.00	0.67
39	300357	我武生物	73,100.00	4,188,630.00	0.64
40	000623	吉林敖东	224,500.00	4,146,515.00	0.63
41	600373	中文传媒	334,300.00	4,131,948.00	0.63
42	603868	飞科电器	94,600.00	4,107,532.00	0.63
43	300223	北京君正	30,400.00	4,073,600.00	0.62
44	002815	崇达技术	240,030.00	4,044,505.50	0.62
45	601689	拓普集团	75,200.00	3,985,600.00	0.61
46	002156	通富微电	204,800.00	3,979,264.00	0.61
47	600765	中航重机	77,900.00	3,933,171.00	0.60
48	600549	厦门钨业	173,700.00	3,930,831.00	0.60
49	000883	湖北能源	748,400.00	3,921,616.00	0.60
50	600867	通化东宝	350,900.00	3,845,864.00	0.59
51	600141	兴发集团	101,300.00	3,837,244.00	0.59

52	600566	济川药业	135,400.00	3,837,236.00	0.59
53	600201	生物股份	233,800.00	3,822,630.00	0.58
54	002223	鱼跃医疗	101,100.00	3,821,580.00	0.58
55	000559	万向钱潮	589,500.00	3,755,115.00	0.57
56	002966	苏州银行	529,200.00	3,582,684.00	0.55
57	002500	山西证券	532,700.00	3,515,820.00	0.54
58	002266	浙富控股	487,800.00	3,473,136.00	0.53
59	002340	格林美	332,000.00	3,436,200.00	0.53
60	002372	伟星新材	140,400.00	3,414,528.00	0.52
61	600737	中粮糖业	361,500.00	3,398,100.00	0.52
62	300327	中颖电子	49,697.00	3,374,426.30	0.52
63	603927	中科软	121,860.00	3,334,089.60	0.51
64	002925	盈趣科技	95,500.00	3,249,865.00	0.50
65	000825	太钢不锈	456,003.00	3,210,261.12	0.49
66	002557	洽洽食品	51,700.00	3,172,312.00	0.49
67	601168	西部矿业	232,400.00	3,162,964.00	0.48
68	002233	塔牌集团	293,100.00	3,100,998.00	0.47
69	002028	思源电气	62,300.00	3,065,783.00	0.47
70	603568	伟明环保	83,800.00	3,061,214.00	0.47
71	601000	唐山港	1,106,600.00	3,043,150.00	0.47
72	601128	常熟银行	447,600.00	2,958,636.00	0.45
73	000636	风华高科	98,300.00	2,929,340.00	0.45
74	000807	云铝股份	261,520.00	2,921,178.40	0.45
75	600808	马钢股份	790,500.00	2,916,945.00	0.45
76	000009	中国宝安	200,500.00	2,893,215.00	0.44
77	600372	中航电子	129,100.00	2,890,549.00	0.44
78	000581	威孚高科	133,500.00	2,875,590.00	0.44
79	000031	大悦城	769,600.00	2,870,608.00	0.44
80	600392	盛和资源	146,200.00	2,868,444.00	0.44
81	000932	华菱钢铁	557,600.00	2,849,336.00	0.44
82	300244	迪安诊断	82,654.00	2,774,694.78	0.42
83	000630	铜陵有色	796,900.00	2,773,212.00	0.42
84	002690	美亚光电	73,100.00	2,738,326.00	0.42
85	002985	北摩高科	22,600.00	2,722,396.00	0.42
86	300750	宁德时代	4,600.00	2,704,800.00	0.41
87	000960	锡业股份	137,800.00	2,691,234.00	0.41
88	002191	劲嘉股份	174,133.00	2,634,632.29	0.40
89	300253	卫宁健康	153,100.00	2,565,956.00	0.39
90	603589	口子窖	36,100.00	2,558,407.00	0.39
91	600879	航天电子	304,106.00	2,505,833.44	0.38
92	600970	中材国际	216,500.00	2,474,595.00	0.38
93	000898	鞍钢股份	655,500.00	2,458,125.00	0.38
94	603198	迎驾贡酒	35,200.00	2,444,640.00	0.37
95	600497	驰宏锌锗	486,500.00	2,427,635.00	0.37

96	000959	首钢股份	412,468.00	2,363,441.64	0.36
97	002572	索菲亚	105,700.00	2,346,540.00	0.36
98	601200	上海环境	184,399.00	2,321,583.41	0.36
99	600516	方大炭素	212,100.00	2,294,922.00	0.35
100	600170	上海建工	633,600.00	2,280,960.00	0.35
101	600064	南京高科	243,000.00	2,269,620.00	0.35
102	600875	东方电气	105,800.00	2,266,236.00	0.35
103	000887	中鼎股份	103,880.00	2,265,622.80	0.35
104	002901	大博医疗	44,644.00	2,259,879.28	0.35
105	000997	新大陆	122,600.00	2,221,512.00	0.34
106	300630	普利制药	40,000.00	2,201,600.00	0.34
107	002812	恩捷股份	8,700.00	2,178,480.00	0.33
108	002142	宁波银行	54,694.00	2,093,686.32	0.32
109	000062	深圳华强	117,900.00	2,031,417.00	0.31
110	300418	昆仑万维	87,500.00	2,025,625.00	0.31
111	300073	当升科技	23,200.00	2,015,384.00	0.31
112	300207	欣旺达	47,400.00	1,998,384.00	0.31
113	600733	北汽蓝谷	196,900.00	1,972,938.00	0.30
114	601179	中国西电	353,600.00	1,962,480.00	0.30
115	002375	亚厦股份	261,600.00	1,959,384.00	0.30
116	000090	天健集团	330,900.00	1,942,383.00	0.30
117	300296	利亚德	189,100.00	1,938,275.00	0.30
118	600729	重庆百货	74,300.00	1,933,286.00	0.30
119	002670	国盛金控	200,900.00	1,928,640.00	0.30
120	300014	亿纬锂能	16,200.00	1,914,516.00	0.29
121	002867	周大生	107,500.00	1,911,350.00	0.29
122	002249	大洋电机	216,900.00	1,906,551.00	0.29
123	600517	国网英大	260,300.00	1,897,587.00	0.29
124	600110	诺德股份	117,800.00	1,878,910.00	0.29
125	603712	七一二	42,800.00	1,853,240.00	0.28
126	603517	绝味食品	27,000.00	1,844,910.00	0.28
127	600528	中铁工业	224,600.00	1,843,966.00	0.28
128	300285	国瓷材料	42,400.00	1,804,968.00	0.28
129	000685	中山公用	203,500.00	1,800,975.00	0.28
130	000027	深圳能源	222,300.00	1,800,630.00	0.28
131	002416	爱施德	157,600.00	1,793,488.00	0.27
132	600639	浦东金桥	138,500.00	1,768,645.00	0.27
133	300699	光威复材	20,800.00	1,757,184.00	0.27
134	000987	越秀金控	201,800.00	1,755,660.00	0.27
135	600707	彩虹股份	253,900.00	1,731,598.00	0.26
136	002423	中粮资本	209,600.00	1,697,760.00	0.26
137	600745	闻泰科技	13,000.00	1,680,900.00	0.26
138	000415	渤海租赁	577,600.00	1,680,816.00	0.26
139	000975	银泰黄金	190,800.00	1,675,224.00	0.26



140	300182	捷成股份	258,000.00	1,633,140.00	0.25
141	000519	中兵红箭	60,700.00	1,618,869.00	0.25
142	603939	益丰药房	28,900.00	1,592,679.00	0.24
143	001872	招商港口	92,300.00	1,564,485.00	0.24
144	600704	物产中大	261,500.00	1,548,080.00	0.24
145	600446	金证股份	107,500.00	1,539,400.00	0.24
146	300146	汤臣倍健	56,700.00	1,528,632.00	0.23
147	600195	中牧股份	116,100.00	1,517,427.00	0.23
148	600908	无锡银行	266,500.00	1,511,055.00	0.23
149	000878	云南铜业	112,800.00	1,508,136.00	0.23
150	300769	德方纳米	3,000.00	1,473,480.00	0.23
151	600673	东阳光	165,900.00	1,473,192.00	0.23
152	300618	寒锐钴业	18,200.00	1,459,276.00	0.22
153	002371	北方华创	4,200.00	1,457,484.00	0.22
154	600801	华新水泥	75,200.00	1,451,360.00	0.22
155	601872	招商轮船	353,900.00	1,450,990.00	0.22
156	300274	阳光电源	9,900.00	1,443,420.00	0.22
157	002074	国轩高科	27,700.00	1,419,625.00	0.22
158	603707	健友股份	33,800.00	1,419,600.00	0.22
159	300324	旋极信息	368,500.00	1,415,040.00	0.22
160	002128	电投能源	95,100.00	1,412,235.00	0.22
161	600171	上海贝岭	55,000.00	1,411,300.00	0.22
162	000930	中粮科技	127,400.00	1,384,838.00	0.21
163	000877	天山股份	89,400.00	1,368,714.00	0.21
164	603816	顾家家居	17,600.00	1,358,016.00	0.21
165	002010	传化智联	153,600.00	1,336,320.00	0.20
166	002440	闰土股份	137,900.00	1,322,461.00	0.20
167	600739	辽宁成大	67,700.00	1,321,504.00	0.20
168	601865	福莱特	22,500.00	1,303,650.00	0.20
169	600754	锦江酒店	22,200.00	1,300,920.00	0.20
170	603893	瑞芯微	9,500.00	1,300,550.00	0.20
171	603233	大参林	30,720.00	1,293,619.20	0.20
172	600582	天地科技	292,500.00	1,281,150.00	0.20
173	600500	中化国际	145,500.00	1,245,480.00	0.19
174	002482	广田集团	511,500.00	1,242,945.00	0.19
175	300890	翔丰华	19,800.00	1,224,234.00	0.19
176	002048	宁波华翔	55,524.00	1,200,984.12	0.18
177	002129	中环股份	27,500.00	1,148,125.00	0.18
178	300463	迈克生物	38,100.00	1,112,139.00	0.17
179	603290	斯达半导	2,900.00	1,104,900.00	0.17
180	600580	卧龙电驱	59,100.00	1,080,939.00	0.17
181	002078	太阳纸业	93,100.00	1,069,719.00	0.16
182	002414	高德红外	44,100.00	1,067,661.00	0.16
183	600380	健康元	83,100.00	1,067,004.00	0.16

184	601068	中铝国际	168,100.00	1,025,410.00	0.16
185	600399	抚顺特钢	39,700.00	983,369.00	0.15
186	603806	福斯特	7,300.00	953,015.00	0.15
187	002236	大华股份	40,400.00	948,592.00	0.15
188	002439	启明星辰	32,900.00	938,637.00	0.14
189	600338	西藏珠峰	24,600.00	926,436.00	0.14
190	600036	招商银行	18,900.00	920,619.00	0.14
191	600060	海信视像	67,500.00	907,875.00	0.14
192	603345	安井食品	5,100.00	870,978.00	0.13
193	000681	视觉中国	35,400.00	846,060.00	0.13
194	603486	科沃斯	5,600.00	845,320.00	0.13
195	600507	方大特钢	105,800.00	825,240.00	0.13
196	600329	中新药业	26,200.00	822,942.00	0.13
197	600460	士兰微	15,000.00	813,000.00	0.12
198	601778	晶科科技	93,300.00	795,849.00	0.12
199	601969	海南矿业	65,700.00	789,057.00	0.12
200	601717	郑煤机	67,300.00	780,007.00	0.12
201	002831	裕同科技	22,900.00	771,501.00	0.12
202	000301	东方盛虹	39,300.00	760,062.00	0.12
203	603225	新凤鸣	49,500.00	735,075.00	0.11
204	603659	璞泰来	4,500.00	722,745.00	0.11
205	002926	华西证券	73,100.00	720,035.00	0.11
206	002049	紫光国微	3,200.00	720,000.00	0.11
207	600348	华阳股份	60,000.00	711,000.00	0.11
208	601298	青岛港	122,700.00	698,163.00	0.11
209	603866	桃李面包	23,700.00	673,080.00	0.10
210	002212	天融信	34,700.00	665,199.00	0.10
211	600153	建发股份	73,000.00	662,110.00	0.10
212	002373	千方科技	43,700.00	653,315.00	0.10
213	600282	南钢股份	172,200.00	637,140.00	0.10
214	601799	星宇股份	3,100.00	633,175.00	0.10
215	000629	攀钢钒钛	160,400.00	623,956.00	0.10
216	600259	广晟有色	12,400.00	610,576.00	0.09
217	000066	中国长城	42,600.00	603,216.00	0.09
218	600640	新国脉	39,500.00	602,375.00	0.09
219	601127	小康股份	10,100.00	601,455.00	0.09
220	002268	卫士通	10,600.00	592,964.00	0.09
221	600008	首创环保	173,680.00	592,248.80	0.09
222	002444	巨星科技	19,100.00	582,741.00	0.09
223	688779	长远锂科	25,482.00	582,263.70	0.09
224	601966	玲珑轮胎	15,900.00	581,145.00	0.09
225	601021	春秋航空	10,100.00	573,680.00	0.09
226	600728	佳都科技	67,400.00	561,442.00	0.09
227	002463	沪电股份	33,200.00	550,456.00	0.08

228	600869	远东股份	79,900.00	549,712.00	0.08
229	300316	晶盛机电	7,800.00	542,100.00	0.08
230	600763	通策医疗	2,700.00	537,300.00	0.08
231	600667	太极实业	65,100.00	526,008.00	0.08
232	603379	三美股份	22,900.00	521,662.00	0.08
233	600529	山东药玻	11,700.00	513,630.00	0.08
234	002294	信立泰	18,800.00	513,616.00	0.08
235	002791	坚朗五金	2,800.00	508,452.00	0.08
236	600316	洪都航空	12,300.00	480,438.00	0.07
237	002709	天赐材料	4,110.00	471,211.50	0.07
238	600787	中储股份	74,800.00	466,752.00	0.07
239	600967	内蒙一机	37,500.00	448,125.00	0.07
240	000718	苏宁环球	95,100.00	447,921.00	0.07
241	600188	兖矿能源	18,300.00	430,599.00	0.07
242	300496	中科创达	3,100.00	429,102.00	0.07
243	002280	联络互动	90,000.00	425,700.00	0.07
244	002244	滨江集团	89,700.00	418,002.00	0.06
245	601456	国联证券	29,800.00	416,306.00	0.06
246	603719	良品铺子	9,600.00	407,712.00	0.06
247	002429	兆驰股份	82,700.00	401,922.00	0.06
248	300595	欧普康视	6,600.00	378,642.00	0.06
249	300308	中际旭创	8,500.00	361,250.00	0.06
250	688176	亚虹医药	15,467.00	355,431.66	0.05
251	300686	智动力	22,400.00	326,144.00	0.05
252	002920	德赛西威	2,300.00	325,473.00	0.05
253	601555	东吴证券	33,210.00	294,240.60	0.05
254	688733	壹石通	3,409.00	256,561.34	0.04
255	000858	五粮液	1,100.00	244,926.00	0.04
256	688262	国芯科技	5,407.00	226,985.86	0.03
257	688700	东威科技	3,049.00	207,636.90	0.03
258	688553	汇宇制药	5,490.00	176,338.80	0.03
259	688793	倍轻松	1,454.00	147,450.14	0.02
260	601877	正泰电器	2,500.00	134,725.00	0.02
261	688686	奥普特	400.00	112,868.00	0.02
262	688611	杭州柯林	1,400.00	99,078.00	0.02
263	301050	雷电微力	233.00	54,654.81	0.01
264	301029	怡合达	462.00	41,459.88	0.01
265	603071	物产环能	1,627.00	41,098.02	0.01
266	688668	鼎通科技	566.00	39,891.68	0.01
267	301177	迪阿股份	324.00	39,544.20	0.01
268	688681	科汇股份	1,899.00	38,245.86	0.01
269	688501	青达环保	1,759.00	37,026.95	0.01
270	301211	亨迪药业	967.00	33,970.71	0.01
271	603230	内蒙新华	1,141.00	29,517.67	0.00

272	301221	光庭信息	280.00	25,460.40	0.00
273	301166	优宁维	253.00	24,260.17	0.00
274	301069	凯盛新材	539.00	23,796.85	0.00
275	301149	隆华新材	1,214.00	23,150.98	0.00
276	301090	华润材料	1,859.00	22,661.21	0.00
277	301087	可孚医疗	300.00	22,629.00	0.00
278	002818	富森美	1,758.00	21,992.58	0.00
279	301039	中集车辆	1,703.00	21,185.32	0.00
280	301100	风光股份	599.00	20,707.43	0.00
281	301018	申菱环境	782.00	20,347.64	0.00
282	300994	久祺股份	420.00	19,076.40	0.00
283	001296	长江材料	310.00	18,376.80	0.00
284	301060	兰卫医学	587.00	18,144.17	0.00
285	301168	通灵股份	329.00	18,048.94	0.00
286	301096	百诚医药	214.00	17,152.10	0.00
287	301111	粤万年青	379.00	16,649.47	0.00
288	301091	深城交	524.00	16,464.08	0.00
289	600219	南山铝业	3,300.00	15,543.00	0.00
290	301089	拓新药业	220.00	15,382.40	0.00
291	301138	华研精机	285.00	15,261.75	0.00
292	301188	力诺特玻	647.00	15,042.75	0.00
293	601233	桐昆股份	700.00	14,826.00	0.00
294	301046	能辉科技	290.00	14,198.40	0.00
295	301126	达嘉维康	662.00	14,133.70	0.00
296	301088	戎美股份	548.00	13,694.52	0.00
297	301093	华兰股份	270.00	13,556.70	0.00
298	600486	扬农化工	100.00	13,120.00	0.00
299	301026	浩通科技	203.00	12,715.92	0.00
300	000733	振华科技	100.00	12,428.00	0.00
301	301021	英诺激光	290.00	12,003.10	0.00
302	002635	安洁科技	700.00	11,921.00	0.00
303	300987	川网传媒	301.00	11,678.80	0.00
304	301078	孩子王	756.00	11,597.04	0.00
305	301092	争光股份	323.00	11,466.50	0.00
306	301048	金鹰重工	843.00	10,916.85	0.00
307	301028	东亚机械	733.00	9,888.17	0.00
308	301182	凯旺科技	294.00	9,801.96	0.00
309	301133	金钟股份	286.00	9,789.78	0.00
310	301045	天禄科技	335.00	9,493.90	0.00
311	300774	倍杰特	444.00	9,279.60	0.00
312	301040	中环海陆	241.00	9,256.81	0.00
313	301193	家联科技	297.00	8,933.76	0.00
314	301062	上海艾录	523.00	8,896.23	0.00
315	301052	果麦文化	252.00	8,482.32	0.00

316	301025	读客文化	403.00	8,398.52	0.00
317	300961	深水海纳	394.00	8,017.90	0.00
318	301066	万事利	344.00	7,853.52	0.00
319	300814	中富电路	328.00	7,806.40	0.00
320	301055	张小泉	355.00	7,699.95	0.00
321	301030	仕净科技	242.00	7,610.90	0.00
322	301081	严牌股份	403.00	7,386.99	0.00
323	300998	宁波方正	201.00	6,699.33	0.00
324	301033	迈普医学	108.00	6,472.44	0.00
325	301049	超越科技	196.00	6,444.48	0.00
326	301032	新柴股份	513.00	6,407.37	0.00
327	301083	百胜智能	416.00	6,335.68	0.00
328	301036	双乐股份	205.00	6,109.00	0.00
329	301041	金百泽	215.00	6,058.70	0.00
330	301072	中捷精工	181.00	6,041.78	0.00
331	301007	德迈仕	303.00	6,035.76	0.00
332	300854	中兰环保	203.00	5,537.84	0.00
333	301063	海锅股份	153.00	5,527.89	0.00
334	001234	泰慕士	333.00	5,504.49	0.00
335	301038	深水规院	266.00	5,381.18	0.00
336	002797	第一创业	700.00	5,124.00	0.00
337	301059	金三江	259.00	4,996.11	0.00
338	301027	华蓝集团	286.00	4,750.46	0.00
339	301037	保立佳	193.00	4,664.81	0.00
340	301073	君亭酒店	144.00	4,616.64	0.00
341	603377	东方时尚	500.00	4,485.00	0.00
342	301053	远信工业	155.00	4,459.35	0.00
343	301057	汇隆新材	218.00	4,144.18	0.00
344	301068	大地海洋	144.00	4,083.84	0.00
345	301079	邵阳液压	140.00	4,083.80	0.00
346	002648	卫星化学	100.00	4,003.00	0.00
347	600811	东方集团	1,300.00	3,913.00	0.00
348	002625	光启技术	100.00	2,401.00	0.00
349	002149	西部材料	100.00	1,852.00	0.00
350	603885	吉祥航空	100.00	1,775.00	0.00
351	600835	上海机电	100.00	1,592.00	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	603444	吉比特	19,592,307.21	4.46
2	002648	卫星化学	18,873,454.86	4.30
3	601233	桐昆股份	17,743,491.00	4.04
4	002030	达安基因	16,288,948.80	3.71
5	600256	广汇能源	16,233,913.40	3.70
6	600885	宏发股份	16,055,485.00	3.66
7	002185	华天科技	15,842,521.00	3.61
8	603486	科沃斯	15,681,702.00	3.57
9	300327	中颖电子	15,195,453.80	3.46
10	002415	海康威视	15,011,492.00	3.42
11	300699	光威复材	14,984,306.40	3.41
12	002920	德赛西威	14,825,995.00	3.38
13	600219	南山铝业	14,784,119.00	3.37
14	000988	华工科技	14,596,760.00	3.33
15	601128	常熟银行	14,116,303.00	3.22
16	600884	杉杉股份	13,934,944.00	3.18
17	002236	大华股份	13,919,945.00	3.17
18	600373	中文传媒	13,489,158.76	3.07
19	601699	潞安环能	13,474,143.00	3.07
20	600563	法拉电子	13,444,863.00	3.06
21	002138	顺络电子	13,212,547.00	3.01
22	000807	云铝股份	13,197,165.50	3.01
23	000830	鲁西化工	13,189,253.77	3.01
24	600089	特变电工	12,920,429.00	2.94
25	000983	山西焦煤	12,713,658.00	2.90
26	600820	隧道股份	12,677,742.93	2.89
27	002396	星网锐捷	12,438,146.94	2.83
28	002382	蓝帆医疗	12,174,208.09	2.77
29	601928	凤凰传媒	12,171,719.00	2.77
30	600867	通化东宝	12,096,022.84	2.76
31	002709	天赐材料	12,041,618.90	2.74
32	002266	浙富控股	12,015,991.00	2.74
33	300316	晶盛机电	11,751,918.00	2.68
34	300463	迈克生物	11,487,241.24	2.62
35	688099	晶晨股份	11,202,014.85	2.55
36	300496	中科创达	10,975,452.00	2.50
37	601615	明阳智能	10,973,737.00	2.50
38	600808	马钢股份	10,921,820.00	2.49
39	000060	中金岭南	10,906,933.01	2.49
40	002065	东华软件	10,904,792.35	2.48
41	300474	景嘉微	10,760,901.00	2.45

42	300146	汤臣倍健	10,734,514.94	2.45
43	300271	华宇软件	10,621,831.00	2.42
44	000630	铜陵有色	10,548,124.00	2.40
45	002690	美亚光电	10,480,487.00	2.39
46	000009	中国宝安	10,478,834.00	2.39
47	000039	中集集团	10,401,525.00	2.37
48	600415	小商品城	10,243,245.87	2.33
49	601801	皖新传媒	10,224,609.88	2.33
50	600426	华鲁恒升	10,169,815.24	2.32
51	600171	上海贝岭	10,150,697.00	2.31
52	000825	太钢不锈	9,984,709.50	2.28
53	601689	拓普集团	9,911,213.00	2.26
54	000932	华菱钢铁	9,871,879.00	2.25
55	002223	鱼跃医疗	9,778,598.00	2.23
56	002233	塔牌集团	9,742,868.00	2.22
57	002180	纳思达	9,720,134.00	2.21
58	000898	鞍钢股份	9,706,790.00	2.21
59	002028	思源电气	9,659,940.00	2.20
60	600598	北大荒	9,622,989.00	2.19
61	300059	东方财富	9,583,805.50	2.18
62	000799	酒鬼酒	9,507,432.00	2.17
63	600435	北方导航	9,471,839.00	2.16
64	000581	威孚高科	9,442,462.69	2.15
65	600699	均胜电子	9,424,770.00	2.15
66	600549	厦门钨业	9,318,065.40	2.12
67	603568	伟明环保	9,312,607.76	2.12
68	300244	迪安诊断	9,296,710.32	2.12
69	600497	驰宏锌锗	9,251,006.00	2.11
70	601658	邮储银行	9,120,275.00	2.08
71	300166	东方国信	9,115,810.74	2.08
72	002013	中航机电	9,105,919.00	2.08
73	002818	富森美	9,076,391.23	2.07
74	600642	申能股份	9,075,129.00	2.07
75	600438	通威股份	8,911,648.00	2.03
76	600862	中航高科	8,893,653.00	2.03
77	601168	西部矿业	8,808,592.18	2.01

## 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	002648	卫星化学	19,620,331.00	4.47
2	600089	特变电工	17,852,243.23	4.07
3	601233	桐昆股份	16,807,469.00	3.83
4	601865	福莱特	16,673,708.95	3.80
5	002709	天赐材料	16,654,310.60	3.80
6	300327	中颖电子	16,557,077.57	3.77
7	603444	吉比特	16,518,698.49	3.76
8	002138	顺络电子	16,046,268.40	3.66
9	002415	海康威视	15,467,773.82	3.52
10	600219	南山铝业	15,318,498.97	3.49
11	002920	德赛西威	14,931,979.86	3.40
12	603486	科沃斯	14,618,164.00	3.33
13	600256	广汇能源	14,376,253.00	3.28
14	300699	光威复材	13,757,924.40	3.14
15	000983	山西焦煤	13,752,107.00	3.13
16	300316	晶盛机电	13,743,468.55	3.13
17	002705	新宝股份	13,543,966.00	3.09
18	002236	大华股份	13,123,169.00	2.99
19	002372	伟星新材	12,802,076.00	2.92
20	601658	邮储银行	12,452,790.00	2.84
21	600867	通化东宝	11,922,658.04	2.72
22	600820	隧道股份	11,872,180.00	2.71
23	600143	金发科技	11,547,397.00	2.63
24	603260	合盛硅业	11,507,009.00	2.62
25	000932	华菱钢铁	11,414,151.09	2.60
26	601128	常熟银行	11,084,497.00	2.53
27	300443	金雷股份	11,048,602.00	2.52
28	002382	蓝帆医疗	10,956,816.46	2.50
29	600563	法拉电子	10,893,840.00	2.48
30	002690	美亚光电	10,720,422.02	2.44
31	601801	皖新传媒	10,652,675.00	2.43
32	002839	张家港行	10,553,643.51	2.40
33	600507	方大特钢	10,493,321.87	2.39
34	600435	北方导航	10,425,930.00	2.38
35	002266	浙富控股	10,412,199.80	2.37
36	300496	中科创达	10,332,941.00	2.35
37	000937	冀中能源	10,317,814.10	2.35
38	000807	云铝股份	10,224,888.00	2.33
39	000630	铜陵有色	10,124,283.00	2.31
40	600373	中文传媒	10,124,165.80	2.31
41	600426	华鲁恒升	9,972,976.96	2.27
42	002241	歌尔股份	9,888,801.00	2.25



43	600908	无锡银行	9,807,729.73	2.23
44	002185	华天科技	9,807,061.00	2.23
45	300244	迪安诊断	9,555,442.22	2.18
46	603986	兆易创新	9,433,048.80	2.15
47	300463	迈克生物	9,328,738.00	2.13
48	002242	九阳股份	9,289,853.62	2.12
49	601012	隆基股份	9,086,986.13	2.07
50	002818	富森美	8,922,593.20	2.03
51	000528	柳 工	8,865,363.20	2.02
52	600885	宏发股份	8,858,537.00	2.02
53	002056	横店东磁	8,769,760.83	2.00

#### 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	2,594,993,326.01
卖出股票的收入（成交）总额	2,469,382,239.58

注：“买入金额”、“卖出金额”均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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

代码	名称	持仓量	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2206	IC2206	6.00	8,577,360.00	522,426.67	-
IC2203	IC2203	2.00	2,922,320.00	198,543.33	-
公允价值变动总额合计					720,970.00
股指期货投资本期收益					3,110,248.54
股指期货投资本期公允价值变动					720,970.00

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

### 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

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金基金合同，本基金不得参与国债期货交易。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。

本基金投资的前十大证券的发行主体除东北证券（000686.SZ）外，在报告编制日前一年内，没有收到公开谴责和处罚的情形。本报告编制日前一年内，东北证券股份有限公司由于作为受托管理人，未充分履行督导发行人履行信息披露义务的职责而被中国证券监督管理委员会及其派出机构出具警示函。

本基金采用量化模型选择证券，上述证券为量化模型根据关注的指标选择结果，所以不影响基金管理人对该证券的投资决策。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,708,536.73
2	应收证券清算款	5,220,944.09
3	应收股利	-
4	应收利息	10,003.57
5	应收申购款	89,876.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,029,360.96

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
申万菱信量化小	22,436	11,922.00	128,924,419.81	48.20%	138,557,641.51	51.80%

盘股票(LOF)A						
申万菱信量化小盘股票(LOF)C	74	185.95	5,892.37	42.82%	7,867.63	57.18%
合计	22,506	11,885.53	128,930,312.18	48.20%	138,565,509.14	51.80%

注：“持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	陈翠芳	669,590.00	13.59%
2	吴家驹	586,576.00	11.90%
3	吴祥宝	256,106.00	5.20%
4	宋晖	171,082.00	3.47%
5	尤超	164,022.00	3.33%
6	陈勇	128,300.00	2.60%
7	吴建城	121,903.00	2.47%
8	章蒙恩	113,100.00	2.30%
9	戴亚克	96,824.00	1.96%
10	粟航	86,000.00	1.75%

注：以上数据由中国证券登记结算有限责任公司提供。

## 9.3 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	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	38,220.34	0.01%
	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	0.00	0.00%
	合计	38,220.34	0.01%

注：分级基金管理人的从业人员持有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）。

## 9.4 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	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	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	0
	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	0~10
	申万菱信量化小盘股票(LOF)C	0
	合计	0~10

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信量化小盘股票(LOF)A	申万菱信量化小盘股票(LOF)C
本报告期期初基金份额总额	204,681,789.29	-
本报告期基金总申购份额	159,722,450.24	30,718.68
减：本报告期基金总赎回份额	96,922,178.21	16,958.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	267,482,061.32	13,760.00

注：本基金自 2021 年 10 月 25 日起实施基金份额分级。

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内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

- 1、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由刘郎先生变更为陈晓升先生。
- 2、本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由杨正平先生变更为金杰先生。
- 3、本报告期内，经基金管理人董事会决议，同意公司董事长由刘郎先生变更为陈晓升先生。
- 4、本报告期内，经基金管理人董事会决议，同意公司首席信息官由张丽红女士变更为钟瑜阳先生。

5、本报告期内，基金托管人任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

### 11.7 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,上海证监局对我司进行了常规全面现场检查,提出了公司内部控制存在的问题,公司高度重视,积极落实相关整改工作,并向上海证监局提交整改报告。

除上述情况外,本报告期内,本基金托管人及其基金管理人、基金托管人高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
申万宏源证券	2	1,727,230,839.27	34.23%	1,588,348.17	34.20%	-
东方财富证券	2	691,094,087.78	13.70%	637,730.91	13.73%	-
天风证券	2	456,484,679.49	9.05%	425,130.80	9.15%	-
方正证券	2	377,345,446.45	7.48%	346,146.50	7.45%	-
中信建投证券	2	331,134,906.71	6.56%	304,479.87	6.56%	-
安信证券	1	292,010,034.16	5.79%	266,110.68	5.73%	-
中泰证券	3	231,719,234.90	4.59%	215,105.38	4.63%	-
西部证券	2	178,995,999.80	3.55%	163,120.17	3.51%	-
太平洋证券	1	130,378,979.85	2.58%	121,422.01	2.61%	-
光大证券	1	119,893,120.42	2.38%	109,259.35	2.35%	-

申港证券	1	104,461,507.26	2.07%	97,284.70	2.09%	-
东吴证券	1	94,262,961.62	1.87%	85,902.70	1.85%	-
国信证券	1	46,071,905.89	0.91%	41,985.56	0.90%	-
东兴证券	1	42,914,332.95	0.85%	39,107.76	0.84%	-
东北证券	2	39,713,017.65	0.79%	36,224.34	0.78%	-
海通证券	2	38,073,618.83	0.75%	35,458.02	0.76%	-
长江证券	1	31,668,496.25	0.63%	29,492.32	0.63%	-
华泰证券	1	20,002,708.99	0.40%	18,228.72	0.39%	-
财通证券	2	19,866,036.87	0.39%	18,501.39	0.40%	-
信达证券	1	18,200,947.94	0.36%	16,586.56	0.36%	-
银河证券	1	15,830,156.14	0.31%	14,426.06	0.31%	-
中信证券	2	11,317,596.00	0.22%	10,313.73	0.22%	-
平安证券	1	9,520,637.87	0.19%	8,676.61	0.19%	-
招商证券	2	8,227,130.12	0.16%	7,497.43	0.16%	-
国元证券	1	4,448,280.30	0.09%	4,142.68	0.09%	-
兴业证券	1	1,754,425.00	0.03%	1,598.83	0.03%	-
东方证券	1	1,227,770.00	0.02%	1,118.82	0.02%	-
民生证券	1	599,684.00	0.01%	546.57	0.01%	-
第一创业	1	598,372.00	0.01%	557.26	0.01%	-
广发证券	1	471,644.28	0.01%	429.78	0.01%	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	2	-	-	-	-	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

## 11.9 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	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(申万菱信量化小盘股票(LOF)C)产品资料概要更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-12-16
2	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(申万菱信量化小盘股票(LOF)A)产品资料概要更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-12-16
3	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2021年第3号)	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-12-16
4	关于申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)增加C类基金份额并相应修订基金合同及托管协议的公告	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-10-21
5	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2021年第2号)	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-10-21
6	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)托管协议更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-10-21
7	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金合同更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-10-21
8	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(申万菱信量化小盘股票(LOF)A)产品资料概要更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-10-21
9	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)(申万菱信量化小盘股票(LOF)C)产品资料概要更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-10-21
10	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)产品资料概要更新	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-03-22
11	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)更新招募说明书(2021年第1号)	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-03-22
12	申万菱信量化小盘股票型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	《上海证券报》、规定互联网网站	2021-03-22

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

## 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210617—20211231	0.00	107,984,782.00	0.00	107,984,782.00	40.37%



**产品特有风险**

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。在单一投资者持有基金份额比例较高的情况下，如投资者集中赎回，可能会给基金带来流动性冲击。基金管理人将专业审慎、勤勉尽责地管控基金的流动性风险，保护持有人利益。

**12.2 影响投资者决策的其他重要信息**

本报告期内，根据深交所基金增加扩位简称的通知，自8月23日起，本基金新增扩位简称“申万量化LOF”，适用于交易、申购赎回及行情展示。详见本基金管理人发布的相关公告。

本报告期内，本基金新设C类基金份额。本基金新增的C类基金份额不开放场内申购与赎回，不上市交易。C类基金份额投资者仅可通过场外方式对基金份额进行申购与赎回。详见本基金管理人发布的相关公告。

**§13 备查文件目录****13.1 备查文件目录**

基金合同；  
招募说明书及其更新；  
产品资料概要及其更新；  
发售公告；  
成立公告；  
定期报告；  
其他临时公告。

**13.2 存放地点**

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

**13.3 查阅方式**

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二二年三月三十一日