

# 安信量化优选股票型发起式证券投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：安信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 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 30 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>1</b>
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>45</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	46
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.....	47
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	78
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	78
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
8.12 投资组合报告附注.....	79
<b>§ 9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>80</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	80
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
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.....	81
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	81
<b>§ 10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>81</b>
<b>§ 11 重大事件揭示.....</b>	<b>82</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	82
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	82
11.4 基金投资策略的改变.....	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	82
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.....	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
11.8 其他重大事件.....	84
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>85</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
<b>§ 13 备查文件目录.....</b>	<b>86</b>
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点.....	86
13.3 查阅方式.....	86

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信量化优选股票型发起式证券投资基金	
基金简称	安信量化优选股票	
基金主代码	006346	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年9月3日	
基金管理人	安信基金管理有限责任公司	
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	57,781,157.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
下属分级基金的交易代码	006346	006347
报告期末下属分级基金的份额总额	11,094,563.95份	46,686,593.92份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	本基金使用量化模型构建股票组合，主要基于对股票市场及上市公司相关数据的深度挖掘，在综合数据可获得性、建模复杂程度的基础上，对数据进行个性化的分析处理，形成了一套完善的选股体系，并据此构建股票组合。资产配置方面，通过对宏观经济周期、宏观政策导向、货币供应量、市场估值水平以及市场情绪等因素的分析，形成对大类资产收益率在不同市场周期的预测和判断，从而确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，适度降低组合系统性风险。债券投资方面，采取稳健的投资管理方式，获得与风险相匹配的投资收益，以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。同时，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将采用国债期货投资策略、资产支持证券投资策略、权证投资策略等，更好地实现本基金的投资目标。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、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	安信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	孙晓奇	郭明
	联系电话	0755-82509999	010-66105799
	电子邮箱	service@essencefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	4008-088-088	95588	
传真	0755-82799292	010-66105798	
注册地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	518026	100140	
法定代表人	刘入领	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.essencefund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号，东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	安信基金管理有限责任公司	广东省深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界商务中心 36 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年		2020 年		2019 年	
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
本期已实现收益	4,488,371.26	435,058.99	6,608,451.82	1,417,694.76	3,982,164.03	1,840,312.63

本期利润	3,884,128.86	-422,351.53	6,826,691.31	909,012.81	4,425,783.56	2,270,131.82
加权平均基金份额本期利润	0.3475	-0.0233	0.5676	0.2111	0.4011	0.2630
本期加权平均净值利润率	15.74%	-1.04%	32.23%	12.36%	32.22%	20.55%
本期基金份额净值增长率	17.49%	17.02%	42.03%	41.42%	44.04%	43.72%
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	14,505,437.86	59,746,986.74	11,024,212.57	4,199,197.27	3,897,793.29	5,098,449.07
期末可供分配基金份额利润	1.3074	1.2797	0.9018	0.8867	0.3563	0.3513
期末基金资产净值	25,799,704.45	107,290,715.36	24,195,092.98	9,300,583.26	15,244,566.60	20,153,582.32
期末基金份额净值	2.3254	2.2981	1.9793	1.9638	1.3936	1.3886
3.1.3 累	2021 年末		2020 年末		2019 年末	

计期末指标						
基金份额累计净值增长率	132.54%	129.81%	97.93%	96.38%	39.36%	38.86%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）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。

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

安信量化优选股票 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	3.10%	0.76%	3.27%	0.64%	-0.17%	0.12%
过去六个月	1.04%	1.02%	7.39%	0.82%	-6.35%	0.20%
过去一年	17.49%	1.13%	14.14%	0.83%	3.35%	0.30%
过去三年	140.35%	1.31%	66.75%	1.17%	73.60%	0.14%
自基金合同生效起至今	132.54%	1.25%	48.34%	1.20%	84.20%	0.05%

安信量化优选股票 C

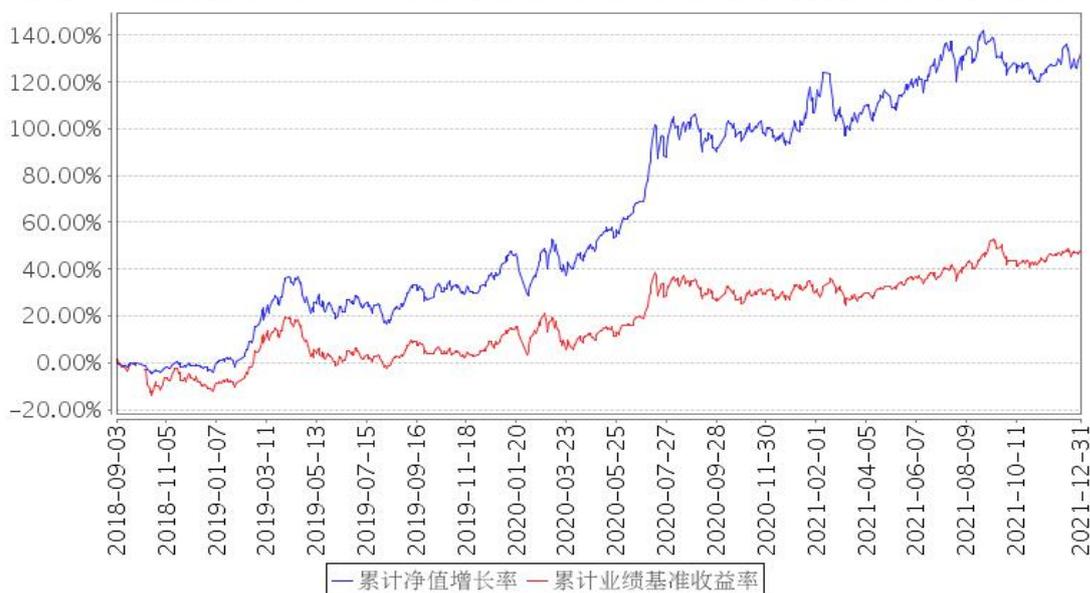
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.00%	0.76%	3.27%	0.64%	-0.27%	0.12%
过去六个月	0.84%	1.02%	7.39%	0.82%	-6.55%	0.20%
过去一年	17.02%	1.13%	14.14%	0.83%	2.88%	0.30%
过去三年	137.85%	1.31%	66.75%	1.17%	71.10%	0.14%
自基金合同生效起至今	129.81%	1.25%	48.34%	1.20%	81.47%	0.05%

注：根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》的约定，本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。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、代表性强的小市值股票，综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体情况；中证综合债券指数选样债券信用类别覆盖全面，期限构成宽泛。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合合同要求，基准指数每日按照 85%、15%的比例采取再平衡，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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

安信量化优选股票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



安信量化优选股票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

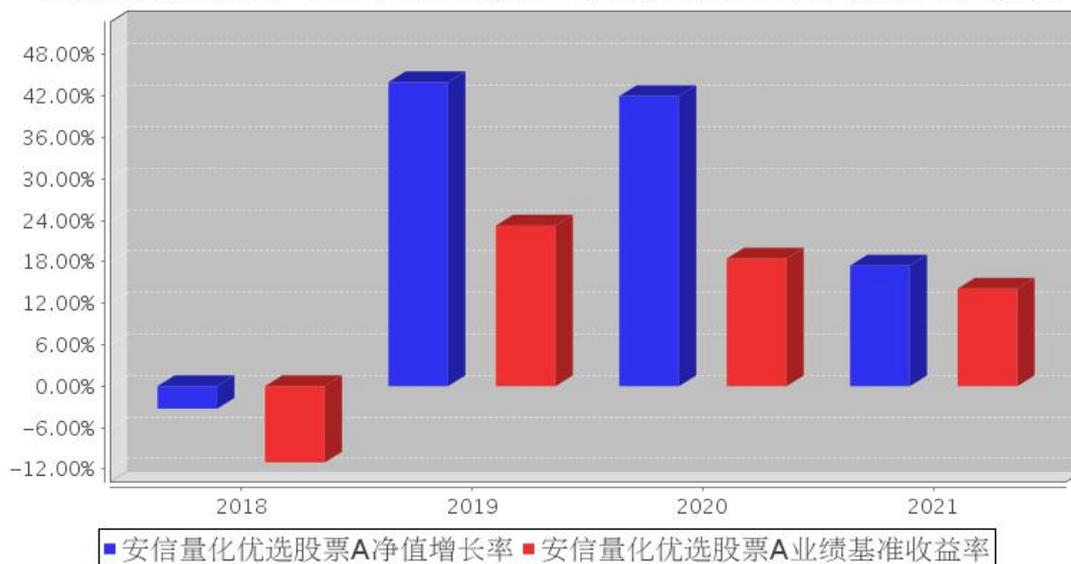


注：1、本基金合同生效日为 2018 年 9 月 3 日。

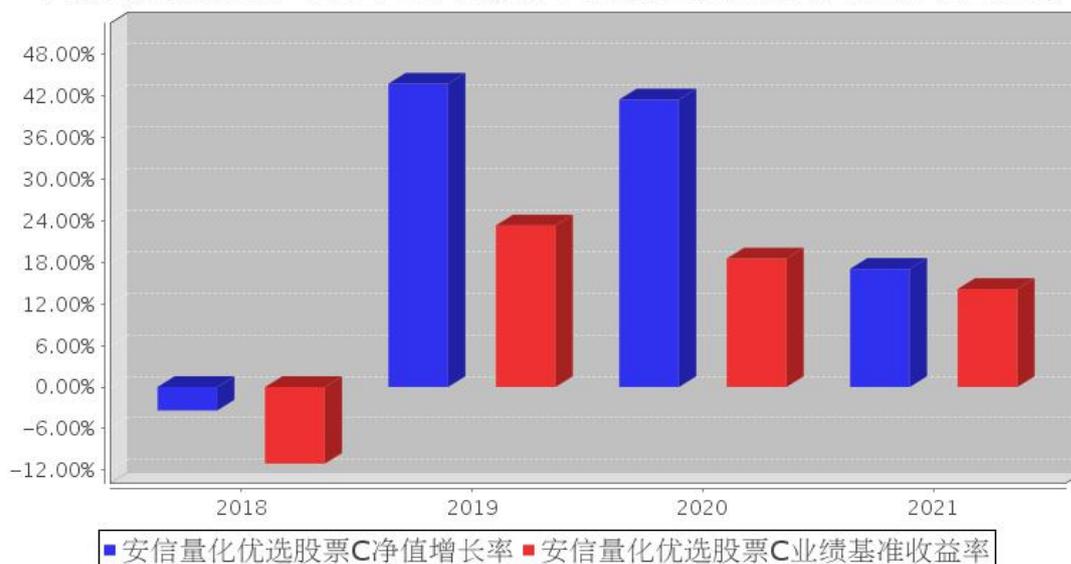
2、本基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。建仓期结束时，本基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

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

安信量化优选股票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



安信量化优选股票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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 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

安信基金管理有限责任公司经中国证监会批准，成立于 2011 年 12 月，总部位于深圳，注册资本 5.0625 亿元人民币，股东及股权结构为：五矿资本控股有限公司持有 39.84% 的股权，安信证券股份有限公司持有 33.95% 的股权，佛山市顺德区新碧贸易有限公司持有 20.28% 的股权，中广核财务有限责任公司持有 5.93% 的股权。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 77 只开放式基金具体如下：安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、安信平稳增长混合型发起式证券投资基金、安信现金管理货币市场基金、安信宝利债券型证券投资基金（LOF）（原安信宝利分级债券型证券投资基金）、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、安信鑫发优选灵活配置混合型证券投资基金、安信价值精选股票型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、安信动态策略灵活配置混合型证券投资基金、安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信优势增长灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健增值灵活配置混合型证券投资基金、安信鑫安得利灵活配置混合型证券投资基金、安信新常态沪港深精选股票型证券投资基金、安信新动力灵活配置混合型证券投资基金、安信新回报灵活配置混合型证券投资基金、安信新优选灵活配置混合型证券投资基金、安信新目标灵活配置混合型证券投资基金、安信新价值灵活配置混合型证券投资基金、安信新成长灵活配置混合型证券投资基金、安信尊享纯债债券型证券投资基金、安信永丰定期开放债券型证券投资基金、安信活期宝货币市场基金、安信新趋势灵活配置混合型证券投资基金、安信中国制造 2025 沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信合作创新主题沪港深灵活配置混合型证券投资基金、安信工业 4.0 主题沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、安信稳健阿尔法定期开放混合型发起式证券投资基金、安信永泰定期开放债券型发起式证券投资基金、安信尊享添益债券型证券投资基金、安信比较优势灵活配置混合型证券投资基金、安信永盛定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永瑞定期开放债券型发起式证券投资基金、安信永鑫增强债券型证券投资基金（原安信永鑫定期开放债券型证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信恒利增强债券型证券投资基金、安信中证 500 指数增强型证券投资基金、安信盈利驱动股票型证券投资基金、安信聚利增强债券型证券投资基金、安信量化精选沪深 300 指数增强型证券投资基金（原安信新起点灵活配置混合型证券投资基金）、安信鑫日享中短债债券型证券投资基金、

安信核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、安信中短利率债债券型证券投资基金（LOF）、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）、安信民稳增长混合型证券投资基金、安信价值驱动三年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值回报三年持有期混合型证券投资基金、安信丰泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、安信价值成长混合型证券投资基金、安信稳健增利混合型证券投资基金、安信价值发现两年定期开放混合型证券投资基金（LOF）、安信禧悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、安信成长动力一年持有期混合型证券投资基金、安信尊享添利利率债债券型证券投资基金、安信永顺一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信平稳双利 3 个月持有期混合型证券投资基金、安信成长精选混合型证券投资基金、安信稳健聚申一年持有期混合型证券投资基金、安信创新先锋混合型发起式证券投资基金、安信中债 1-3 年政策性金融债指数证券投资基金、安信稳健回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信浩盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、安信医药健康主题股票型发起式证券投资基金、安信平稳合盈一年持有期混合型证券投资基金、安信永盈一年定期开放债券型发起式证券投资基金、安信均衡成长 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信招信一年持有期混合型证券投资基金、安信消费升级一年持有期混合型发起式证券投资基金、安信价值启航混合型证券投资基金、安信宏盈 18 个月持有期混合型证券投资基金、安信稳健汇利一年持有期混合型证券投资基金、安信民安回报一年持有期混合型证券投资基金、安信优质企业三年持有期混合型证券投资基金、安信平衡增利混合型证券投资基金、安信永宁一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
施荣盛	本基金的基金经理	2020 年 1 月 13 日	-	8 年	施荣盛先生，经济学博士。历任东方证券资产管理有限公司量化投资部研究员，安信基金管理有限责任公司量化投资部研究助理、基金经理助理、投资经理，现任安信基金管理有限责任公司量化投资部基金经理。曾任安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、安信沪深 300 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理助理，安信中证复兴发展 100 主题指数型证券投资基金的基金经理；现任安信中证一带一路主题指数型证券投资基金（原安信中证一带一路主题指数分级证券投资基金）、安信量化优选股票型发起式证券投资基金、安信中证深圳科技创新主题指数型证券投资基金（LOF）的基金经理。

注：1、基金经理的“任职日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写；基金经理助理的“任职日期”根据公司决定确定的聘任日期填写。“离任日期”根据公司决定的公告（生效）日期填写。  
2、证券从业年限计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

#### 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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》等有关法律法规、监管部门的相关规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人采用 T 值检验等统计方法，定期对旗下管理的所有基金和投资组合之间发生的同一交易日内、三个交易日内、五个交易日内的同向交易价差进行专项分析和检查。分析结果显示，本基金与本基金管理人旗下管理的所有其他基金和投资组合之间，不存在通过相同品种的同向交易进行投资组合间利益输送的行为。

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共 1 次，为不同基金经理管理的基金因投资策略和流动性需要而发生的反向交易，有关基金经理履行了内部审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 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

本基金作为量化股票型基金，坚持宽基选股，淡化择时，以数量化分析为基础，多维度选股，行业分散，覆盖 A 股多板块优质股票。本基金基于对股票市场和上市公司相关数据进行深度挖掘，使用机器学习等量化模型构建股票组合。在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，力争实现基金财产的长期稳健增值。

从量化投资的因子层面看，波动率、换手率、估值等因子在今年表现良好，而盈利、财务质量、Beta、成长等因子表现平淡，使得价值风格相比成长风格占优。从长期来看，价值风格在赔率和拥挤度等方面仍然有优势，2022 年我们将着重在估值、盈利、财务质量等赔率高和低拥挤度的因子上进行配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末安信量化优选股票 A 基金份额净值为 2.3254 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.49%；安信量化优选股票 C 基金份额净值为 2.2981 元，本报告期基金份额净值增长率为 17.02%；同期业绩比较基准收益率为 14.14%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，从全球层面看，全球经济将延续复苏，但是增速中枢或将下降。受通胀持续上行的影响，美联储由鸽转鹰，世界其他发达经济体也开始紧缩货币政策，包括中国市场在内的全球市场将承压。

从国内层面看，虽然整体经济下行压力较大，国内需求预计恢复态势较弱，出口对经济的拉动也将趋弱，但是我们预期 2022 年政策将积极转向，货币信贷政策将逐步宽松，财政政策方面将会发力，预计会积极推出有利于稳定经济的相关政策，因此，预期市场会是震荡偏弱态势。

受房地产投资下滑、消费疲软等因素影响，中国经济增速的下行压力逐渐增大，稳增长的预期逐渐增强，新老基建的投资价值将进一步提升。“碳中和”和科技突破是坚持高质量发展的强国之路，能源变革、科技行业仍然具有投资机会。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展的实际需要，通过合规培训、梳理业务风险点、细化制度流程、对员工行为以及重点业务稽核检查等方式，保障了基金管理及公司业务的有效开展及合规运作。本基金管理人承诺将持续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金资产安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规、证监会的相关规定以及基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规及基金合同要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所定期对估值调整采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，设立估值委员会。估值委员会负责审定公司基金估值业务管理制度，建立健全估值决策体系，确定不同基金产品及投资品种的估值方法，保证基金估值业务准确真实地反映基金相关金融资产和金融负债的公允价值。估值委员会负责人由公司分管投资的公司领导担任，估值委员会成员由运营部、权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部、固定收益研究部、风险管理部和监察稽核部分别委派一名或多名代表组成，以上人员均具备必要的经验、专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会各成员职责分工如下：权益投资部、固定收益部、特定资产管理部、研究部及固定收益研究部负责关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出合理的估值建议，确保估值的公允性；运营部负责日常估值业务的具体执行，及时准确完成基金估值，并负责和托管行沟通协调核对；风险管理部协助评估相关估值模型及参数，向估值委员会提出建议；监察稽核部负责定期或不定期对估值政策、程序及相关方法的一致性进行检查，确保估值政策和程序的一贯性。当估值委员会委员同时为基金经理时，涉及其相关持仓品种估值调整时采取回避机制，保持估值调整的客观性和独立性。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

截至报告期末本基金管理人已签约的定价服务机构为中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司，由其按约定提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规规定和本基金合同的约定及实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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——安信基金管理有限责任公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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

本托管人依法对安信基金管理有限责任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

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	安信量化优选股票型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了安信量化优选股票型发起式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，后附的安信量化优选股票型发起式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，公允反映了安信量化优选股票型发起式证券投资基金 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，我们独立于安信量化优选股票型发起式证券投资基金，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	无
其他事项	无
其他信息	安信量化优选股票型发起式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	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



## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,737,104.77	1,326,233.83
结算备付金		1,835,802.11	384,465.76
存出保证金		51,236.24	14,625.97
交易性金融资产	7.4.7.2	127,246,174.27	32,229,973.79
其中：股票投资		120,266,467.27	30,430,245.33
基金投资		-	-
债券投资		6,979,707.00	1,799,728.46
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		660,492.00	-
应收利息	7.4.7.5	79,648.08	22,849.47
应收股利		-	-
应收申购款		109,442.61	499.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		134,719,900.08	33,978,648.78
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		508,281.89	-
应付赎回款		1,997.50	249,847.10
应付管理人报酬		167,189.80	42,465.40
应付托管费		27,864.96	7,077.57
应付销售服务费		35,937.57	3,131.52
应付交易费用	7.4.7.7	823,208.54	169,660.58
应交税费		-	0.20
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	65,000.01	10,790.17
负债合计		1,629,480.27	482,972.54
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	57,781,157.87	16,960,312.75
未分配利润	7.4.7.10	75,309,261.94	16,535,363.49
所有者权益合计		133,090,419.81	33,495,676.24
负债和所有者权益总计		134,719,900.08	33,978,648.78

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 57,781,157.87 份，其中安信量化优选股票 A 基金份额总额为 11,094,563.95 份，基金份额净值 2.3254 元；安信量化优选股票 C 基金份额总额为 46,686,593.92 份，基金份额净值 2.2981 元。

## 7.2 利润表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		7,873,611.71	9,446,617.95
1. 利息收入		109,913.76	29,308.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	38,256.66	17,387.16
债券利息收入		71,657.10	11,921.43
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）		8,861,121.79	9,677,819.45
其中：股票投资收益	7.4.7.12	8,398,514.44	9,364,863.21
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	58,966.93	15,205.06
资产支持证券投资	7.4.7.14	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	403,640.42	297,751.18
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-1,461,652.92	-290,442.46

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	364,229.08	29,932.37
减：二、费用		4,411,834.38	1,710,913.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	984,965.34	430,492.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	164,160.85	71,748.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	163,959.52	30,607.94
4. 交易费用	7.4.7.20	3,025,953.31	1,161,716.32
5. 利息支出		5,913.36	4,402.61
其中：卖出回购金融资产支出		5,913.36	4,402.61
6. 税金及附加		0.48	0.05
7. 其他费用	7.4.7.21	66,881.52	11,945.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,461,777.33	7,735,704.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,461,777.33	7,735,704.12

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信量化优选股票型发起式证券投资基金

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）	16,960,312.75	16,535,363.49	33,495,676.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,461,777.33	3,461,777.33
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）	40,820,845.12	55,312,121.12	96,132,966.24
其中：1. 基金申购款	75,555,151.86	101,009,779.80	176,564,931.66
2. 基金赎回款	-34,734,306.74	-45,697,658.68	-80,431,965.42
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)	57,781,157.87	75,309,261.94	133,090,419.81
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)	25,452,629.33	9,945,519.59	35,398,148.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,735,704.12	7,735,704.12
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)	-8,492,316.58	-1,145,860.22	-9,638,176.80
其中：1. 基金申购款	11,947,430.83	8,801,490.82	20,748,921.65
2. 基金赎回款	-20,439,747.41	-9,947,351.04	-30,387,098.45
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)	16,960,312.75	16,535,363.49	33,495,676.24

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：

刘入领

范瑛

苗杨

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

安信量化优选股票型发起式证券投资基金（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”）2018年7月13日下发的证监许可[2018]1119号文关于“准予安信量

化优选股票型发起式证券投资基金注册的批复”的核准，由安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《安信量化优选股票型发起式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。本基金募集期间为 2018 年 8 月 24 日至 2018 年 8 月 28 日，募集结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明(2018) 验字 60962175\_H12 号验资报告。经向中国证监会备案，《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 9 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,026,300.59 份，其中认购资金利息折合 3.08 份基金份额。本基金的基金管理人为安信基金管理有限责任公司，注册登记机构为安信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》及《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》，安信量化优选股票型发起式证券投资基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码，并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安信量化优选股票型发起式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）、国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含分离型可转换债券）、次级债、可交换债券、资产支持证券、银行存款、债券回购、权证、国债期货、股指期货以及法律法规或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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，

对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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于 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项。

本基金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公允价值变动计入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、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

###### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 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

##### 初始确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；应收款项及其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

##### 后续计量

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产采用公允价值进行后续计量。在持有该类金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；应收款项及其他金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，其摊销或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

##### 终止确认

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益。

##### 金融资产转移

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的

有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票、债券、资产支持证券和衍生工具等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述估值原则仍不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能适当反映公允价值的价格估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：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；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的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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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股利收益。债券投资在持有期间应取得的按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除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。资产支持证券投资在持有期间应取得的按证券票面价值与票面利率计算的金额扣除在适用情况下由证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。

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；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，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。

其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同及相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

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。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利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；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；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 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要的会计政策和会计估计事项。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### 7.4.6.2 企业所得税

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》，证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

##### 7.4.6.3 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》、财税[2016]46 号文《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 号文《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定及其他相关法规：

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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，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日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

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。

#### 7.4.6.4 个人所得税

个人所得税税率为20%。基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利、债券的利息及储蓄利息时代扣代缴个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	4,737,104.77	1,326,233.83
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	4,737,104.77	1,326,233.83

### 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	121,301,288.20	120,266,467.27	-1,034,820.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,983,731.50	6,979,707.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,983,731.50	6,979,707.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	128,285,019.70	127,246,174.27	-1,038,845.43
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	30,009,275.27	30,430,245.33	420,970.06
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,797,891.03	1,799,728.46
	银行间市场	-	-
	合计	1,797,891.03	1,799,728.46
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	31,807,166.30	32,229,973.79	422,807.49

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 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	517.79	142.25
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	908.71	190.41
应收债券利息	78,196.17	22,509.55
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	25.41	7.26
合计	79,648.08	22,849.47

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	823,208.54	169,660.58
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	823,208.54	169,660.58

#### 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	0.01	790.17
应付证券出借违约金	-	-
应付信息披露费	50,000.00	-
应付审计费	15,000.00	10,000.00
合计	65,000.01	10,790.17

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

安信量化优选股票 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	12,224,317.46	12,224,317.46
本期申购	1,397,203.14	1,397,203.14
本期赎回（以“-”号填列）	-2,526,956.65	-2,526,956.65
本期末	11,094,563.95	11,094,563.95

安信量化优选股票 C

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	4,735,995.29	4,735,995.29
本期申购	74,157,948.72	74,157,948.72
本期赎回（以“-”号填列）	-32,207,350.09	-32,207,350.09
本期末	46,686,593.92	46,686,593.92

注：申购份额含转换入份额；赎回份额含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

安信量化优选股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,024,212.57	946,562.95	11,970,775.52
本期利润	4,488,371.26	-604,242.40	3,884,128.86
本期基金份额交易产生的变动数	-1,007,145.97	-142,617.91	-1,149,763.88
其中：基金申购款	1,549,081.72	139,183.86	1,688,265.58
基金赎回款	-2,556,227.69	-281,801.77	-2,838,029.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,505,437.86	199,702.64	14,705,140.50

安信量化优选股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,199,197.27	365,390.70	4,564,587.97
本期利润	435,058.99	-857,410.52	-422,351.53
本期基金份额交易产生的变动数	55,112,730.48	1,349,154.52	56,461,885.00
其中：基金申购款	96,292,178.71	3,029,335.51	99,321,514.22
基金赎回款	-41,179,448.23	-1,680,180.99	-42,859,629.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	59,746,986.74	857,134.70	60,604,121.44

#### 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	25,494.42	11,669.91
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	12,421.55	5,477.27
其他	340.69	239.98
合计	38,256.66	17,387.16

#### 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	1,136,804,659.43	442,669,272.35
减：卖出股票成本总额	1,128,406,144.99	433,304,409.14
买卖股票差价收入	8,398,514.44	9,364,863.21

#### 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	3,180,043.66	1,364,623.13
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,072,510.52	1,332,185.38
减：应收利息总额	48,566.21	17,232.69
买卖债券差价收入	58,966.93	15,205.06

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 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

	日	日
股票投资产生的股利收益	403,640.42	297,751.18
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	403,640.42	297,751.18

#### 7.4.7.18 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	-1,461,652.92	-290,442.46
股票投资	-1,455,790.99	-292,279.89
债券投资	-5,861.93	1,837.43
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	-1,461,652.92	-290,442.46

#### 7.4.7.19 其他收入

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
基金赎回费收入	364,064.29	29,195.33
基金转换费收入	164.79	735.03
其他	-	2.01
合计	364,229.08	29,932.37

#### 7.4.7.20 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	3,025,953.31	1,161,716.32
银行间市场交易费用	-	-

合计	3,025,953.31	1,161,716.32
----	--------------	--------------

#### 7.4.7.21 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	15,000.00	10,000.00
信息披露费	50,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	1,881.52	1,945.68
合计	66,881.52	11,945.68

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
安信基金管理有限责任公司（“安信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
安信证券股份有限公司（“安信证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
五矿资本控股有限公司	基金管理人的股东
中广核财务有限责任公司	基金管理人的股东
佛山市顺德区新碧贸易有限公司	基金管理人的股东
安信乾盛财富管理（深圳）有限公司	基金管理人的子公司

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 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	984,965.34	430,492.54
其中：支付销售机构的客户维护费	12,377.27	12,905.67

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 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	164,160.85	71,748.69

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 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		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信基金	-	160,122.07	160,122.07
安信证券	-	1,475.93	1,475.93
合计	-	161,598.00	161,598.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C	合计
安信基金	-	26,644.53	26,644.53
安信证券	-	802.44	802.44
合计	-	27,446.97	27,446.97

注：基金销售服务费每日计提，按月支付。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%。本基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

### 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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

#### 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

本基金于本期及上年度可比期间均无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。

#### 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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.31%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 3 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	58.96%	-

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：本基金管理人运用固有资金投资本基金所适用的费率/用与本基金法律文件的规定一致。

#### 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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本期末及上年度末均未投资本基金。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
工商银行	4,737,104.77	25,494.42	1,326,233.83	11,669.91

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无需说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 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	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
688232	新点软件	2021年11月10日	2022年5月17日	新股锁定	48.49	41.99	1,732	83,984.68	72,726.68	-
688248	南网科技	2021年12月14日	2022年6月22日	新股锁定	12.24	18.90	3,528	43,182.72	66,679.20	-

688262	国芯科技	2021 年 12 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股未 上市	41.98	41.98	1,161	48,738.78	48,738.78	-
--------	------	------------------------	----------------------	-----------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本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

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人坚持“风险管理创造价值”、“风险管理人人有责”、“合规风险零容忍”的理念，将风险管理融入到公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的控制。本基金管理人为全面、深入控制风险，建立了自下而上的三层风险管理体系。在业务操作层面由公司各部门和各级业务岗位进行业务一线风险的自控和互控。经理层下设的风险控制委员会、投资决策委员会等专业委员会和监察稽核部、风险管理部组成公司风险管理的第二层防线，负责组织和协调公司内部的风险管理工作，查找、评估业务中的风险隐患，提出处理意见并监督执行。本基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会、审计委员会和督察长作为风险管理的第三层防线，负责制定公司风险管理的框架、监督风险管理的执行情况并督促公司保护持有人的合法权益。

本基金主要的投资工具包括股票投资、债券投资等金融工具，在日常经营活动中面临信用风险、流动性风险及市场风险等相关风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡。

本基金管理人通过定性和定量两种方式对本基金投资的金融工具进行风险管理。一方面从定

性的角度出发，对本基金存在的风险、风险的严重程度及风险发生的可能性进行评估、分析和宏观控制；另一方面从定量分析的角度出发，通过金融建模和特定风险量化指标计算，在日常工作中实时地对各种量化风险进行跟踪、检查和预警，并通过相应决策将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

在基金投资过程中，信用风险主要是指因债券交易对手未履行合约责任，或者基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人建立了严格的债券备选池制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场通过对交易对手的资信情况进行充分审慎的评估，同时对证券交割方式进行限制以控制交易对手的违约风险。

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2020 年 12 月 31 日：0.02%）。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	6,528,492.00	1,793,128.50
合计	6,528,492.00	1,793,128.50

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

3. 债券投资以净价列示。

##### 7.4.13.2.2 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	-	6,599.96
未评级	451,215.00	-
合计	451,215.00	6,599.96

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。
3. 债券投资以净价列示。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的现金流量和投资品种的公允价值受市场利率变动而发生波动的风险。银

行存款、结算备付金及债券投资等品种的公允价值均面临在市场利率上升时出现下降的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，采用久期、凸度、VaR（在险价值）等量化风险指标评估基金的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 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	4,737,104.77	-	-	-	4,737,104.77
结算备付金	1,835,802.11	-	-	-	1,835,802.11
存出保证金	51,236.24	-	-	-	51,236.24
交易性金融资产	6,979,707.00	-	-	-120,266,467.27	127,246,174.27
应收利息	-	-	-	79,648.08	79,648.08
应收申购款	-	-	-	109,442.61	109,442.61
应收证券清算款	-	-	-	660,492.00	660,492.00
资产总计	13,603,850.12	-	-	-121,116,049.96	134,719,900.08
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,997.50	1,997.50
应付管理人报酬	-	-	-	167,189.80	167,189.80
应付托管费	-	-	-	27,864.96	27,864.96
应付证券清算款	-	-	-	508,281.89	508,281.89
应付销售服务费	-	-	-	35,937.57	35,937.57
应付交易费用	-	-	-	823,208.54	823,208.54
其他负债	-	-	-	65,000.01	65,000.01
负债总计	-	-	-	1,629,480.27	1,629,480.27
利率敏感度缺口	13,603,850.12	-	-	-119,486,569.69	133,090,419.81
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,326,233.83	-	-	-	1,326,233.83
结算备付金	384,465.76	-	-	-	384,465.76
存出保证金	14,625.97	-	-	-	14,625.97
交易性金融资产	1,793,128.50	-	6,599.96	30,430,245.33	32,229,973.79
应收利息	-	-	-	22,849.47	22,849.47
应收申购款	-	-	-	499.96	499.96
资产总计	3,518,454.06	-	6,599.96	30,453,594.76	33,978,648.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	249,847.10	249,847.10
应付管理人报酬	-	-	-	42,465.40	42,465.40
应付托管费	-	-	-	7,077.57	7,077.57

应付销售服务费	-	-	-	3,131.52	3,131.52
应付交易费用	-	-	-	169,660.58	169,660.58
应交税费	-	-	-	0.20	0.20
其他负债	-	-	-	10,790.17	10,790.17
负债总计	-	-	-	482,972.54	482,972.54
利率敏感度缺口	3,518,454.06	-	6,599.96	29,970,622.22	33,495,676.24

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	8,540.91	2,024.70
2. 市场利率上升 25 个基点	-8,519.01	-2,018.06	

#### 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。本基金持有的金融工具均以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例为80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，

定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（在险价值）等量化指标评估本基金潜在的价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	120,266,467.27	90.36	30,430,245.33	90.85
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	120,266,467.27	90.36	30,430,245.33	90.85

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	5,844,325.46	1,537,755.07
2. 沪深 300 指数下降 5%	-5,844,325.46	-1,537,755.07	

#### 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 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.14.2 其他事项

###### (1) 公允价值

管理层已经评估了银行存款、结算备付金、买入返售金融资产、其他应收款项类投资以及其

他金融负债因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

#### 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 120,072,818.12 元，划分为第二层次的余额为人民币 7,173,356.15 元，无划分为第三层次余额（于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性金融资产中划分为第一层次的余额为人民币 30,419,637.72 元，划分为第二层次的余额为人民币 1,810,336.07 元，无划分为第三层次余额）。

#### 公允价值所属层次间重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于证券交易所上市的股票，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间或限售期间将相关股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关股票公允价值应属第二层次或第三层次。

对于证券交易所上市的可转换、可交换债券，若出现交易不活跃的情况，本基金不会于交易不活跃期间将债券的公允价值列入第一层次；根据估值调整中所采用输入值的可观察性和重要性，确定相关债券公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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。

(2)根据《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》(财会〔2017〕7 号)、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》(财会〔2017〕8 号)、《企业会计准则第 24 号—套期会计》(财会〔2017〕9 号)、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(财会〔2017〕14 号)(以上统称新金融工具相关会计准则)，以及《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》(财会〔2020〕22 号)，自 2022 年 1 月 1 日起，本基金开始执行新金融工具相关会计准则。

#### 7.4.14.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 24 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	120,266,467.27	89.27

	其中：股票	120,266,467.27	89.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,979,707.00	5.18
	其中：债券	6,979,707.00	5.18
	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	6,572,906.88	4.88
8	其他各项资产	900,818.93	0.67
9	合计	134,719,900.08	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	753,504.00	0.57
B	采矿业	1,300,270.00	0.98
C	制造业	97,445,144.75	73.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	930,384.00	0.70
E	建筑业	744,814.00	0.56
F	批发和零售业	861,570.00	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	1,769,142.00	1.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,827,111.92	3.63
J	金融业	4,344,716.68	3.26
K	房地产业	245,024.00	0.18
L	租赁和商务服务业	899,581.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	5,684,440.25	4.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	204,925.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	177,917.67	0.13
S	综合	77,922.00	0.06
	合计	120,266,467.27	90.36

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002371	北方华创	5,500	1,908,610.00	1.43
2	603915	国茂股份	48,200	1,874,980.00	1.41
3	688012	中微公司	14,356	1,817,469.60	1.37
4	300759	康龙化成	12,400	1,751,748.00	1.32
5	300347	泰格医药	13,400	1,712,520.00	1.29
6	603659	璞泰来	9,700	1,557,917.00	1.17
7	002812	恩捷股份	6,100	1,527,440.00	1.15
8	300294	博雅生物	39,500	1,514,825.00	1.14
9	300382	斯莱克	60,400	1,391,616.00	1.05
10	300432	富临精工	46,800	1,375,920.00	1.03
11	603606	东方电缆	25,000	1,279,000.00	0.96
12	300680	隆盛科技	40,900	1,276,080.00	0.96
13	002129	中环股份	27,600	1,152,300.00	0.87
14	600862	中航高科	30,900	1,104,984.00	0.83
15	601877	正泰电器	20,500	1,104,745.00	0.83
16	603806	福斯特	8,300	1,083,565.00	0.81
17	300568	星源材质	29,000	1,065,170.00	0.80
18	002518	科士达	42,200	1,059,220.00	0.80
19	603985	恒润股份	19,200	1,025,664.00	0.77
20	002824	和胜股份	22,500	1,020,825.00	0.77
21	603127	昭衍新药	8,800	1,015,784.00	0.76
22	300745	欣锐科技	15,800	1,014,360.00	0.76
23	600521	华海药业	46,400	1,005,024.00	0.76
24	002493	荣盛石化	54,800	995,168.00	0.75
25	002916	深南电路	8,150	992,833.00	0.75
26	002460	赣锋锂业	6,900	985,665.00	0.74
27	688186	广大特材	21,787	971,918.07	0.73
28	688202	美迪西	1,995	968,752.05	0.73
29	603833	欧派家居	6,500	958,750.00	0.72
30	600887	伊利股份	23,000	953,580.00	0.72
31	600660	福耀玻璃	20,200	952,228.00	0.72
32	688556	高测股份	14,068	949,449.32	0.71
33	688200	华峰测控	1,851	947,526.90	0.71
34	300421	力星股份	43,200	946,944.00	0.71

35	600760	中航沈飞	13,900	945,756.00	0.71
36	002409	雅克科技	11,600	941,572.00	0.71
37	002594	比亚迪	3,500	938,420.00	0.71
38	002352	顺丰控股	13,600	937,312.00	0.70
39	600030	中信证券	35,400	934,914.00	0.70
40	300627	华测导航	20,300	933,800.00	0.70
41	003022	联泓新科	25,500	929,220.00	0.70
42	600845	宝信软件	15,200	924,616.00	0.69
43	002881	美格智能	21,500	921,920.00	0.69
44	603088	宁波精达	82,700	921,278.00	0.69
45	603938	三孚股份	25,000	919,750.00	0.69
46	002073	软控股份	116,700	919,596.00	0.69
47	002895	川恒股份	37,000	913,530.00	0.69
48	601633	长城汽车	18,600	902,844.00	0.68
49	601888	中国中免	4,100	899,581.00	0.68
50	300035	中科电气	29,700	898,425.00	0.68
51	300438	鹏辉能源	18,900	892,836.00	0.67
52	603517	绝味食品	12,900	881,457.00	0.66
53	002326	永太科技	17,200	880,812.00	0.66
54	300558	贝达药业	11,000	878,130.00	0.66
55	300718	长盛轴承	52,000	877,760.00	0.66
56	601318	中国平安	17,200	867,052.00	0.65
57	300777	中简科技	14,000	866,320.00	0.65
58	600690	海尔智家	28,400	848,876.00	0.64
59	000858	五粮液	3,800	846,108.00	0.64
60	688037	芯源微	4,963	837,754.40	0.63
61	300499	高澜股份	52,500	828,450.00	0.62
62	600519	贵州茅台	400	820,000.00	0.62
63	600018	上港集团	147,100	806,108.00	0.61
64	601808	中海油服	52,400	786,000.00	0.59
65	300682	朗新科技	21,000	777,630.00	0.58
66	300661	圣邦股份	2,500	772,500.00	0.58
67	601766	中国中车	123,900	754,551.00	0.57
68	300861	美畅股份	9,700	754,369.00	0.57
69	601012	隆基股份	8,700	749,940.00	0.56
70	003011	海象新材	21,900	748,323.00	0.56
71	600900	长江电力	32,300	733,210.00	0.55
72	300505	川金诺	23,400	716,976.00	0.54
73	601138	工业富联	60,000	715,200.00	0.54
74	002669	康达新材	43,100	704,254.00	0.53
75	002001	新和成	22,400	697,088.00	0.52
76	002805	丰元股份	21,900	690,945.00	0.52

77	002335	科华数据	18,600	676,296.00	0.51
78	688388	嘉元科技	5,368	673,952.40	0.51
79	000725	京东方 A	127,900	645,895.00	0.49
80	603906	龙蟠科技	16,900	625,976.00	0.47
81	300488	恒锋工具	22,000	623,920.00	0.47
82	300443	金雷股份	10,800	623,808.00	0.47
83	603876	鼎胜新材	16,000	602,400.00	0.45
84	002141	贤丰控股	91,200	590,976.00	0.44
85	300034	钢研高纳	10,200	587,520.00	0.44
86	002850	科达利	3,600	577,224.00	0.43
87	600438	通威股份	12,600	566,496.00	0.43
88	600850	电科数字	16,400	559,732.00	0.42
89	600705	中航产融	140,700	558,579.00	0.42
90	600765	中航重机	10,900	550,341.00	0.41
91	002312	川发龙蟒	41,600	544,128.00	0.41
92	688508	芯朋微	4,629	536,315.94	0.40
93	300274	阳光电源	3,500	510,300.00	0.38
94	300775	三角防务	10,100	493,789.00	0.37
95	603920	世运电路	22,000	490,600.00	0.37
96	300772	运达股份	11,100	488,178.00	0.37
97	300648	星云股份	8,100	487,539.00	0.37
98	002453	华软科技	26,700	484,338.00	0.36
99	600332	白云山	14,000	478,800.00	0.36
100	603507	振江股份	11,700	478,530.00	0.36
101	688330	宏力达	4,195	476,803.70	0.36
102	300390	天华超净	5,800	469,800.00	0.35
103	603610	麒盛科技	18,100	468,066.00	0.35
104	603129	春风动力	2,700	467,100.00	0.35
105	300850	新强联	2,600	464,126.00	0.35
106	601319	中国人保	98,500	462,950.00	0.35
107	603115	海星股份	17,400	455,880.00	0.34
108	600481	双良节能	45,100	453,706.00	0.34
109	300433	蓝思科技	19,500	448,110.00	0.34
110	600108	亚盛集团	126,800	447,604.00	0.34
111	002483	润邦股份	54,300	438,744.00	0.33
112	300391	康跃科技	28,800	437,760.00	0.33
113	300696	爱乐达	8,400	436,296.00	0.33
114	603822	嘉澳环保	10,400	432,536.00	0.32
115	688536	思瑞浦	563	432,384.00	0.32
116	000938	紫光股份	18,800	429,580.00	0.32
117	688063	派能科技	2,177	428,869.00	0.32
118	000333	美的集团	5,700	420,717.00	0.32

119	601390	中国中铁	72,600	420,354.00	0.32
120	688301	奕瑞科技	824	409,445.60	0.31
121	600132	重庆啤酒	2,700	408,564.00	0.31
122	688408	中信博	2,301	406,149.51	0.31
123	600019	宝钢股份	56,700	405,972.00	0.31
124	600482	中国动力	20,200	397,940.00	0.30
125	300751	迈为股份	600	385,380.00	0.29
126	603185	上机数控	2,300	384,054.00	0.29
127	603290	斯达半导	1,000	381,000.00	0.29
128	002268	卫士通	6,800	380,392.00	0.29
129	601601	中国太保	13,900	376,968.00	0.28
130	603707	健友股份	8,800	369,600.00	0.28
131	603218	日月股份	11,200	369,040.00	0.28
132	300395	菲利华	5,500	361,570.00	0.27
133	601211	国泰君安	20,100	359,589.00	0.27
134	603948	建业股份	12,700	354,330.00	0.27
135	002544	杰赛科技	14,400	341,856.00	0.26
136	688122	西部超导	3,524	341,616.56	0.26
137	300082	奥克股份	22,000	339,900.00	0.26
138	603505	金石资源	9,100	329,693.00	0.25
139	002870	香山股份	8,600	326,456.00	0.25
140	603583	捷昌驱动	6,300	312,669.00	0.23
141	601607	上海医药	15,400	305,998.00	0.23
142	300820	英杰电气	3,400	305,660.00	0.23
143	600036	招商银行	5,900	287,389.00	0.22
144	002157	正邦科技	27,800	268,548.00	0.20
145	300835	龙磁科技	3,700	266,955.00	0.20
146	600161	天坛生物	9,200	266,432.00	0.20
147	002821	凯莱英	600	261,000.00	0.20
148	000002	万科A	12,400	245,024.00	0.18
149	002508	老板电器	6,800	244,936.00	0.18
150	603380	易德龙	6,200	237,460.00	0.18
151	300693	盛弘股份	6,300	231,147.00	0.17
152	601933	永辉超市	57,000	230,850.00	0.17
153	605266	健之佳	3,000	229,710.00	0.17
154	603595	东尼电子	6,100	225,273.00	0.17
155	002651	利君股份	16,100	213,003.00	0.16
156	300748	金力永磁	4,600	206,494.00	0.16
157	300672	国科微	1,100	204,050.00	0.15
158	600795	国电电力	62,200	197,174.00	0.15
159	600585	海螺水泥	4,800	193,440.00	0.15
160	002860	星帅尔	7,500	183,000.00	0.14

161	300791	仙乐健康	4,300	179,310.00	0.13
162	603799	华友钴业	1,600	176,496.00	0.13
163	688023	安恒信息	698	175,016.52	0.13
164	605288	凯迪股份	2,700	174,285.00	0.13
165	300059	东方财富	4,600	170,706.00	0.13
166	600703	三安光电	4,500	169,020.00	0.13
167	600745	闻泰科技	1,300	168,090.00	0.13
168	000876	新希望	11,000	167,310.00	0.13
169	688356	键凯科技	481	162,159.53	0.12
170	300870	欧陆通	1,900	159,144.00	0.12
171	300393	中来股份	8,000	152,320.00	0.11
172	000823	超声电子	11,000	149,820.00	0.11
173	601999	出版传媒	21,200	148,400.00	0.11
174	000063	中兴通讯	4,400	147,400.00	0.11
175	300769	德方纳米	300	147,348.00	0.11
176	002044	美年健康	18,500	145,225.00	0.11
177	605333	沪光股份	6,800	140,624.00	0.11
178	300207	欣旺达	3,300	139,128.00	0.10
179	002736	国信证券	11,500	132,020.00	0.10
180	300833	浩洋股份	1,600	129,648.00	0.10
181	300118	东方日升	3,900	126,633.00	0.10
182	603288	海天味业	1,200	126,132.00	0.09
183	002025	航天电器	1,500	125,925.00	0.09
184	600610	中毅达	8,600	124,184.00	0.09
185	300260	新莱应材	2,600	122,642.00	0.09
186	601618	中国中冶	32,000	122,560.00	0.09
187	300630	普利制药	2,200	121,088.00	0.09
188	601668	中国建筑	24,000	120,000.00	0.09
189	002986	宇新股份	3,300	118,734.00	0.09
190	600872	中炬高新	3,100	117,707.00	0.09
191	002136	安纳达	7,200	117,072.00	0.09
192	600210	紫江企业	12,700	116,586.00	0.09
193	000403	派林生物	4,100	114,923.00	0.09
194	300831	派瑞股份	5,800	114,550.00	0.09
195	605183	确成股份	5,800	113,970.00	0.09
196	300725	药石科技	800	113,736.00	0.09
197	300457	赢合科技	3,700	113,664.00	0.09
198	600141	兴发集团	3,000	113,640.00	0.09
199	300681	英搏尔	1,100	112,420.00	0.08
200	603392	万泰生物	500	110,750.00	0.08
201	688389	普门科技	4,689	107,847.00	0.08
202	603259	药明康德	900	106,722.00	0.08

203	002841	视源股份	1,300	105,820.00	0.08
204	600725	云维股份	28,300	105,276.00	0.08
205	000301	东方盛虹	5,100	98,634.00	0.07
206	002865	钧达股份	1,400	98,000.00	0.07
207	002558	巨人网络	7,800	93,366.00	0.07
208	002597	金禾实业	1,800	92,430.00	0.07
209	600529	山东药玻	2,100	92,190.00	0.07
210	000783	长江证券	12,000	90,480.00	0.07
211	002434	万里扬	6,100	89,914.00	0.07
212	603877	太平鸟	3,200	89,216.00	0.07
213	002957	科瑞技术	3,500	89,005.00	0.07
214	603738	泰晶科技	1,500	88,950.00	0.07
215	601186	中国铁建	10,500	81,900.00	0.06
216	000009	中国宝安	5,400	77,922.00	0.06
217	603650	彤程新材	1,500	75,480.00	0.06
218	688232	新点软件	1,732	72,726.68	0.05
219	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.05
220	688248	南网科技	3,528	66,679.20	0.05
221	002024	苏宁易购	15,900	65,508.00	0.05
222	002192	融捷股份	500	65,075.00	0.05
223	600664	哈药股份	17,900	63,545.00	0.05
224	002407	多氟多	1,400	62,986.00	0.05
225	300404	博济医药	4,500	62,235.00	0.05
226	600309	万华化学	600	60,600.00	0.05
227	688550	瑞联新材	611	60,592.87	0.05
228	600763	通策医疗	300	59,700.00	0.04
229	603722	阿科力	1,100	59,312.00	0.04
230	300179	四方达	5,400	58,914.00	0.04
231	300691	联合光电	2,500	58,800.00	0.04
232	300582	英飞特	2,700	58,401.00	0.04
233	002709	天赐材料	500	57,325.00	0.04
234	002765	蓝黛科技	6,800	57,120.00	0.04
235	603893	瑞芯微	400	54,760.00	0.04
236	600028	中国石化	12,800	54,144.00	0.04
237	603155	新亚强	1,000	54,110.00	0.04
238	688262	国芯科技	1,161	48,738.78	0.04
239	600577	精达股份	6,400	47,616.00	0.04
240	600893	航发动力	600	38,076.00	0.03
241	002714	牧原股份	700	37,352.00	0.03
242	600016	民生银行	8,800	34,320.00	0.03
243	300037	新宙邦	300	33,900.00	0.03
244	603993	洛阳钼业	6,000	33,480.00	0.03

245	000762	西藏矿业	600	31,878.00	0.02
246	002876	三利谱	500	31,240.00	0.02
247	002283	天润工业	3,200	30,208.00	0.02
248	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.02
249	000829	天音控股	1,600	29,504.00	0.02
250	603690	至纯科技	600	28,890.00	0.02
251	300604	长川科技	500	28,750.00	0.02
252	600110	诺德股份	1,800	28,710.00	0.02
253	603399	吉翔股份	4,100	27,101.00	0.02
254	600071	凤凰光学	500	25,730.00	0.02
255	001317	三羊马	300	25,722.00	0.02
256	000822	山东海化	3,600	25,020.00	0.02
257	300529	健帆生物	400	21,320.00	0.02
258	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
259	603076	乐惠国际	400	14,528.00	0.01
260	603297	永新光学	100	12,107.00	0.01
261	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
262	002832	比音勒芬	100	2,545.00	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	600809	山西汾酒	12,899,210.88	38.51
2	600036	招商银行	8,840,033.00	26.39
3	603659	璞泰来	8,458,213.00	25.25
4	600309	万华化学	8,446,341.40	25.22
5	600519	贵州茅台	8,199,197.00	24.48
6	300782	卓胜微	7,754,611.00	23.15
7	601166	兴业银行	7,611,022.00	22.72
8	002129	中环股份	7,520,035.73	22.45
9	603501	韦尔股份	7,181,811.00	21.44
10	601318	中国平安	6,872,587.00	20.52
11	603806	福斯特	6,726,408.73	20.08
12	603259	药明康德	6,676,238.15	19.93
13	002812	恩捷股份	6,561,938.00	19.59
14	603986	兆易创新	6,484,050.00	19.36
15	000799	酒鬼酒	6,285,923.00	18.77
16	601636	旗滨集团	6,108,323.39	18.24
17	000568	泸州老窖	6,018,951.20	17.97
18	000858	五粮液	5,950,097.00	17.76

19	000725	京东方 A	5,767,015.00	17.22
20	300347	泰格医药	5,731,567.00	17.11
21	300122	智飞生物	5,605,836.00	16.74
22	002415	海康威视	5,575,013.47	16.64
23	300759	康龙化成	5,457,627.13	16.29
24	002049	紫光国微	5,370,923.00	16.03
25	601888	中国中免	5,030,977.00	15.02
26	300059	东方财富	4,929,788.70	14.72
27	600436	片仔癀	4,908,625.00	14.65
28	601919	中远海控	4,902,616.00	14.64
29	600702	舍得酒业	4,897,700.22	14.62
30	600900	长江电力	4,852,687.00	14.49
31	603799	华友钴业	4,780,260.00	14.27
32	600019	宝钢股份	4,660,991.00	13.92
33	600887	伊利股份	4,392,967.00	13.12
34	000786	北新建材	4,376,328.00	13.07
35	603833	欧派家居	4,314,601.00	12.88
36	601012	隆基股份	4,246,278.80	12.68
37	002460	赣锋锂业	4,207,978.00	12.56
38	002568	百润股份	4,178,858.80	12.48
39	300142	沃森生物	4,160,874.00	12.42
40	600132	重庆啤酒	4,157,364.00	12.41
41	601088	中国神华	4,098,741.00	12.24
42	600845	宝信软件	4,070,778.27	12.15
43	601600	中国铝业	4,018,723.00	12.00
44	300274	阳光电源	4,008,320.81	11.97
45	000100	TCL 科技	3,890,603.00	11.62
46	601939	建设银行	3,838,367.00	11.46
47	600600	青岛啤酒	3,812,832.00	11.38
48	300015	爱尔眼科	3,804,094.00	11.36
49	600690	海尔智家	3,803,230.00	11.35
50	601838	成都银行	3,784,371.00	11.30
51	002841	视源股份	3,759,802.63	11.22
52	300294	博雅生物	3,728,029.72	11.13
53	603899	晨光文具	3,722,932.00	11.11
54	300014	亿纬锂能	3,658,274.00	10.92
55	600018	上港集团	3,639,403.85	10.87
56	002271	东方雨虹	3,636,426.00	10.86
57	300433	蓝思科技	3,626,648.00	10.83
58	002027	分众传媒	3,548,357.00	10.59
59	300363	博腾股份	3,502,252.00	10.46
60	000651	格力电器	3,466,413.00	10.35

61	601138	工业富联	3,448,352.00	10.29
62	002430	杭氧股份	3,437,279.00	10.26
63	000001	平安银行	3,405,101.00	10.17
64	600196	复星医药	3,333,603.52	9.95
65	002876	三利谱	3,299,170.24	9.85
66	300124	汇川技术	3,280,996.74	9.80
67	002508	老板电器	3,273,676.00	9.77
68	000661	长春高新	3,253,984.00	9.71
69	600110	诺德股份	3,242,504.00	9.68
70	601857	中国石油	3,213,104.00	9.59
71	603127	昭衍新药	3,174,087.00	9.48
72	002340	格林美	3,166,741.00	9.45
73	002920	德赛西威	3,160,636.00	9.44
74	002484	江海股份	3,152,414.00	9.41
75	600763	通策医疗	3,128,970.00	9.34
76	600028	中国石化	3,104,498.00	9.27
77	600438	通威股份	3,028,218.00	9.04
78	300763	锦浪科技	3,022,457.00	9.02
79	600183	生益科技	2,967,995.00	8.86
80	601899	紫金矿业	2,949,530.00	8.81
81	002493	荣盛石化	2,945,944.00	8.79
82	300725	药石科技	2,911,288.00	8.69
83	002648	卫星化学	2,894,326.00	8.64
84	600919	江苏银行	2,891,109.00	8.63
85	603055	台华新材	2,889,980.00	8.63
86	601238	广汽集团	2,871,767.00	8.57
87	601633	长城汽车	2,856,469.00	8.53
88	002371	北方华创	2,832,333.77	8.46
89	600837	海通证券	2,807,174.00	8.38
90	002821	凯莱英	2,790,210.00	8.33
91	601601	中国太保	2,758,216.00	8.23
92	601006	大秦铁路	2,738,007.00	8.17
93	600460	士兰微	2,734,616.68	8.16
94	002179	中航光电	2,723,153.00	8.13
95	688139	海尔生物	2,693,396.81	8.04
96	601100	恒立液压	2,693,023.92	8.04
97	601607	上海医药	2,691,343.33	8.03
98	002850	科达利	2,690,161.00	8.03
99	300769	德方纳米	2,674,251.00	7.98
100	000333	美的集团	2,648,389.00	7.91
101	601229	上海银行	2,640,053.00	7.88
102	600705	中航产融	2,622,230.57	7.83

103	002060	粤水电	2,611,869.00	7.80
104	601336	新华保险	2,609,554.00	7.79
105	002352	顺丰控股	2,598,065.00	7.76
106	002245	蔚蓝锂芯	2,575,244.00	7.69
107	601628	中国人寿	2,559,574.00	7.64
108	603517	绝味食品	2,548,920.00	7.61
109	601799	星宇股份	2,535,074.83	7.57
110	000683	远兴能源	2,514,164.00	7.51
111	688388	嘉元科技	2,511,072.08	7.50
112	000009	中国宝安	2,463,069.00	7.35
113	603882	金域医学	2,423,579.00	7.24
114	601898	中煤能源	2,407,041.00	7.19
115	600873	梅花生物	2,395,966.00	7.15
116	300628	亿联网络	2,391,848.00	7.14
117	600050	中国联通	2,382,184.00	7.11
118	688169	石头科技	2,373,876.59	7.09
119	601669	中国电建	2,364,200.00	7.06
120	300568	星源材质	2,352,807.00	7.02
121	600298	安琪酵母	2,315,289.00	6.91
122	600329	中新药业	2,308,103.24	6.89
123	603877	太平鸟	2,288,098.00	6.83
124	300737	科顺股份	2,271,936.00	6.78
125	300661	圣邦股份	2,256,413.00	6.74
126	300223	北京君正	2,251,582.00	6.72
127	300146	汤臣倍健	2,246,225.00	6.71
128	600297	广汇汽车	2,226,910.00	6.65
129	300751	迈为股份	2,222,140.00	6.63
130	000629	攀钢钒钛	2,222,082.00	6.63
131	603026	石大胜华	2,193,661.00	6.55
132	603220	中贝通信	2,174,859.00	6.49
133	600753	东方银星	2,169,705.00	6.48
134	000063	中兴通讯	2,152,994.00	6.43
135	603915	国茂股份	2,146,302.76	6.41
136	300671	富满微	2,145,865.00	6.41
137	300358	楚天科技	2,137,670.00	6.38
138	601577	长沙银行	2,136,804.00	6.38
139	601598	中国外运	2,127,141.38	6.35
140	300171	东富龙	2,121,707.00	6.33
141	300432	富临精工	2,119,848.00	6.33
142	000301	东方盛虹	2,107,726.74	6.29
143	000657	中钨高新	2,101,687.00	6.27
144	603179	新泉股份	2,069,479.16	6.18

145	002270	华明装备	2,054,359.50	6.13
146	603688	石英股份	2,051,996.00	6.13
147	600169	太原重工	2,046,260.00	6.11
148	688002	睿创微纳	2,033,874.77	6.07
149	002594	比亚迪	2,030,700.00	6.06
150	600586	金晶科技	2,026,410.00	6.05
151	600114	东睦股份	2,023,851.00	6.04
152	002044	美年健康	2,008,466.00	6.00
153	600219	南山铝业	2,002,806.00	5.98
154	600782	新钢股份	1,997,523.00	5.96
155	002192	融捷股份	1,993,628.00	5.95
156	601877	正泰电器	1,969,934.00	5.88
157	002677	浙江美大	1,957,655.00	5.84
158	300073	当升科技	1,943,607.00	5.80
159	603486	科沃斯	1,940,971.00	5.79
160	603993	洛阳钼业	1,914,782.00	5.72
161	688012	中微公司	1,913,551.81	5.71
162	300082	奥克股份	1,911,570.00	5.71
163	000671	阳光城	1,896,764.00	5.66
164	002706	良信股份	1,894,741.00	5.66
165	601377	兴业证券	1,888,456.66	5.64
166	601225	陕西煤业	1,886,867.00	5.63
167	300408	三环集团	1,853,133.14	5.53
168	603678	火炬电子	1,844,651.00	5.51
169	688556	高测股份	1,836,321.71	5.48
170	600926	杭州银行	1,833,441.00	5.47
171	300413	芒果超媒	1,825,974.00	5.45
172	002832	比音勒芬	1,823,222.90	5.44
173	601211	国泰君安	1,823,169.00	5.44
174	603185	上机数控	1,795,852.00	5.36
175	002230	科大讯飞	1,792,364.00	5.35
176	603801	志邦家居	1,784,010.48	5.33
177	000510	新金路	1,773,401.00	5.29
178	600466	蓝光发展	1,767,547.00	5.28
179	002008	大族激光	1,764,028.00	5.27
180	601233	桐昆股份	1,761,191.25	5.26
181	603938	三孚股份	1,753,488.00	5.23
182	001979	招商蛇口	1,751,067.00	5.23
183	000545	金浦钛业	1,747,563.00	5.22
184	601699	潞安环能	1,744,324.00	5.21
185	601339	百隆东方	1,740,046.00	5.19
186	601169	北京银行	1,738,268.00	5.19

187	688202	美迪西	1,727,211.34	5.16
188	600176	中国巨石	1,724,797.85	5.15
189	600966	博汇纸业	1,708,966.00	5.10
190	600660	福耀玻璃	1,708,257.00	5.10
191	600233	圆通速递	1,707,666.00	5.10
192	600426	华鲁恒升	1,706,421.60	5.09
193	600497	驰宏锌锗	1,703,974.00	5.09
194	000823	超声电子	1,701,800.00	5.08
195	603755	日辰股份	1,692,727.00	5.05
196	601808	中海油服	1,691,067.00	5.05
197	300702	天宇股份	1,680,424.73	5.02
198	002312	川发龙蟒	1,673,669.00	5.00
199	600325	华发股份	1,656,643.00	4.95
200	002409	雅克科技	1,651,313.00	4.93
201	000983	山西焦煤	1,645,908.00	4.91
202	603906	龙蟠科技	1,644,674.00	4.91
203	300655	晶瑞电材	1,640,581.00	4.90
204	603613	国联股份	1,625,672.00	4.85
205	002139	拓邦股份	1,623,226.00	4.85
206	300390	天华超净	1,621,235.00	4.84
207	000002	万 科 A	1,614,239.00	4.82
208	600307	酒钢宏兴	1,607,603.00	4.80
209	300718	长盛轴承	1,606,099.00	4.79
210	300662	科锐国际	1,594,849.20	4.76
211	300861	美畅股份	1,591,369.00	4.75
212	603606	东方电缆	1,587,264.00	4.74
213	600022	山东钢铁	1,585,223.00	4.73
214	000887	中鼎股份	1,580,797.00	4.72
215	002254	泰和新材	1,571,477.00	4.69
216	600332	白云山	1,570,304.00	4.69
217	002304	洋河股份	1,569,507.00	4.69
218	000961	中南建设	1,555,924.00	4.65
219	600160	巨化股份	1,552,971.00	4.64
220	601677	明泰铝业	1,550,124.00	4.63
221	002206	海 利 得	1,548,877.00	4.62
222	600315	上海家化	1,546,657.00	4.62
223	300458	全志科技	1,546,268.00	4.62
224	603727	博迈科	1,545,595.00	4.61
225	603979	金诚信	1,541,145.21	4.60
226	601117	中国化学	1,532,206.00	4.57
227	000822	山东海化	1,526,560.00	4.56
228	002001	新 和 成	1,525,246.80	4.55

229	002709	天赐材料	1,517,998.00	4.53
230	603987	康德莱	1,513,026.00	4.52
231	002614	奥佳华	1,509,382.00	4.51
232	601328	交通银行	1,497,876.00	4.47
233	002585	双星新材	1,496,845.00	4.47
234	601390	中国中铁	1,488,370.00	4.44
235	000776	广发证券	1,487,179.00	4.44
236	600559	老白干酒	1,485,617.00	4.44
237	600594	益佰制药	1,478,311.00	4.41
238	603707	健友股份	1,469,560.79	4.39
239	601137	博威合金	1,458,688.00	4.35
240	300438	鹏辉能源	1,455,216.00	4.34
241	600346	恒力石化	1,455,046.00	4.34
242	600030	中信证券	1,453,056.00	4.34
243	600584	长电科技	1,442,538.00	4.31
244	002543	万和电气	1,441,882.00	4.30
245	300119	瑞普生物	1,441,719.00	4.30
246	002738	中矿资源	1,441,505.42	4.30
247	002895	川恒股份	1,440,151.22	4.30
248	688188	柏楚电子	1,434,154.41	4.28
249	300382	斯莱克	1,433,154.00	4.28
250	603612	索通发展	1,420,205.00	4.24
251	601515	东风股份	1,418,891.00	4.24
252	300454	深信服	1,418,853.00	4.24
253	002536	飞龙股份	1,412,154.00	4.22
254	688056	莱伯泰科	1,408,643.49	4.21
255	002456	欧菲光	1,407,044.00	4.20
256	600779	水井坊	1,403,835.98	4.19
257	600123	兰花科创	1,382,652.51	4.13
258	002145	中核钛白	1,367,385.00	4.08
259	300745	欣锐科技	1,359,902.00	4.06
260	688356	键凯科技	1,354,375.15	4.04
261	002918	蒙娜丽莎	1,353,228.00	4.04
262	002258	利尔化学	1,351,134.00	4.03
263	600862	中航高科	1,341,130.00	4.00
264	600908	无锡银行	1,332,094.00	3.98
265	603985	恒润股份	1,330,173.56	3.97
266	601319	中国人保	1,328,717.00	3.97
267	603225	新风鸣	1,326,003.00	3.96
268	688519	南亚新材	1,325,411.23	3.96
269	002824	和胜股份	1,321,268.50	3.94
270	000902	新洋丰	1,317,083.00	3.93

271	300775	三角防务	1,313,437.00	3.92
272	600481	双良节能	1,312,962.00	3.92
273	600760	中航沈飞	1,303,149.00	3.89
274	002326	永太科技	1,298,207.00	3.88
275	000778	新兴铸管	1,294,324.00	3.86
276	003022	联泓新科	1,292,773.00	3.86
277	000959	首钢股份	1,279,748.00	3.82
278	688122	西部超导	1,275,972.56	3.81
279	603392	万泰生物	1,275,600.00	3.81
280	000615	奥园美谷	1,275,125.00	3.81
281	300750	宁德时代	1,272,883.00	3.80
282	300593	新雷能	1,270,712.00	3.79
283	300595	欧普康视	1,268,835.00	3.79
284	600803	新奥股份	1,267,717.00	3.78
285	688366	昊海生科	1,267,435.92	3.78
286	600429	三元股份	1,263,164.00	3.77
287	600166	福田汽车	1,260,131.00	3.76
288	600741	华域汽车	1,259,101.00	3.76
289	600428	中远海特	1,254,115.00	3.74
290	600293	三峡新材	1,253,130.00	3.74
291	688200	华峰测控	1,252,480.61	3.74
292	603260	合盛硅业	1,251,742.00	3.74
293	600885	宏发股份	1,250,465.00	3.73
294	300003	乐普医疗	1,239,953.00	3.70
295	000709	河钢股份	1,218,504.00	3.64
296	601998	中信银行	1,216,756.00	3.63
297	002335	科华数据	1,216,349.00	3.63
298	002916	深南电路	1,213,109.00	3.62
299	603444	吉比特	1,210,906.00	3.62
300	603505	金石资源	1,208,100.70	3.61
301	600027	华电国际	1,206,180.00	3.60
302	603180	金牌厨柜	1,202,420.60	3.59
303	002714	牧原股份	1,201,985.00	3.59
304	002518	科士达	1,185,850.00	3.54
305	600839	四川长虹	1,173,984.00	3.50
306	002036	联创电子	1,173,571.00	3.50
307	300143	盈康生命	1,173,439.00	3.50
308	300680	隆盛科技	1,172,293.00	3.50
309	000060	中金岭南	1,162,272.00	3.47
310	600062	华润双鹤	1,156,948.00	3.45
311	600141	兴发集团	1,145,080.00	3.42
312	300767	震安科技	1,143,364.00	3.41

313	601009	南京银行	1,141,223.00	3.41
314	603876	鼎胜新材	1,139,552.00	3.40
315	300037	新宙邦	1,136,658.90	3.39
316	603380	易德龙	1,133,631.00	3.38
317	603948	建业股份	1,118,688.00	3.34
318	002283	天润工业	1,118,072.00	3.34
319	002372	伟星新材	1,117,529.00	3.34
320	002839	张家港行	1,109,868.00	3.31
321	002612	朗姿股份	1,107,470.00	3.31
322	688518	联赢激光	1,106,858.90	3.30
323	300505	川金诺	1,099,373.00	3.28
324	600989	宝丰能源	1,096,140.00	3.27
325	002241	歌尔股份	1,086,234.00	3.24
326	002120	韵达股份	1,082,662.00	3.23
327	600161	天坛生物	1,080,363.00	3.23
328	002064	华峰化学	1,078,678.00	3.22
329	603195	公牛集团	1,078,629.00	3.22
330	300639	凯普生物	1,072,237.00	3.20
331	002176	江特电机	1,066,991.00	3.19
332	300421	力星股份	1,065,289.00	3.18
333	002268	卫士通	1,063,583.00	3.18
334	688508	芯朋微	1,060,008.91	3.16
335	000598	兴蓉环境	1,058,886.00	3.16
336	600499	科达制造	1,054,720.00	3.15
337	000888	峨眉山 A	1,054,457.00	3.15
338	600348	华阳股份	1,053,645.00	3.15
339	000898	鞍钢股份	1,053,261.00	3.14
340	603300	华铁应急	1,051,570.00	3.14
341	603506	南都物业	1,050,724.60	3.14
342	688037	芯源微	1,046,032.80	3.12
343	601985	中国核电	1,040,517.00	3.11
344	300681	英搏尔	1,040,291.00	3.11
345	002859	洁美科技	1,038,779.00	3.10
346	688516	奥特维	1,031,730.31	3.08
347	600577	精达股份	1,031,132.00	3.08
348	002167	东方锆业	1,026,916.00	3.07
349	688007	光峰科技	1,025,497.26	3.06
350	688396	华润微	1,025,429.40	3.06
351	600104	上汽集团	1,019,282.00	3.04
352	601766	中国中车	1,018,588.00	3.04
353	000999	华润三九	1,013,663.00	3.03
354	603595	东尼电子	1,010,290.00	3.02

355	600496	精工钢构	1,006,822.00	3.01
356	002881	美格智能	1,004,238.00	3.00
357	600308	华泰股份	1,002,895.00	2.99
358	688186	广大特材	1,000,280.51	2.99
359	601388	怡球资源	992,321.00	2.96
360	000825	太钢不锈	990,619.44	2.96
361	603038	华立股份	988,689.00	2.95
362	600420	国药现代	980,167.00	2.93
363	603088	宁波精达	979,255.52	2.92
364	002073	软控股份	976,954.00	2.92
365	601179	中国西电	974,688.00	2.91
366	600039	四川路桥	973,392.00	2.91
367	601128	常熟银行	969,409.00	2.89
368	300179	四方达	967,693.00	2.89
369	002985	北摩高科	967,269.00	2.89
370	600997	开滦股份	966,317.00	2.88
371	300006	莱美药业	959,136.00	2.86
372	603233	大参林	954,420.40	2.85
373	000039	中集集团	952,076.10	2.84
374	002727	一心堂	949,514.00	2.83
375	300243	瑞丰高材	947,436.00	2.83
376	000733	振华科技	946,901.00	2.83
377	300777	中简科技	943,843.00	2.82
378	688330	宏力达	942,920.54	2.82
379	600521	华海药业	942,770.00	2.81
380	300627	华测导航	942,449.60	2.81
381	002588	史丹利	942,384.00	2.81
382	300499	高澜股份	941,829.00	2.81
383	000425	徐工机械	940,646.00	2.81
384	603290	斯达半导	939,173.00	2.80
385	600872	中炬高新	938,527.00	2.80
386	601882	海天精工	935,846.00	2.79
387	601818	光大银行	932,769.00	2.78
388	000987	越秀金控	932,754.85	2.78
389	300035	中科电气	931,309.00	2.78
390	688357	建龙微纳	929,194.37	2.77
391	300558	贝达药业	924,983.00	2.76
392	000807	云铝股份	924,838.00	2.76
393	002507	涪陵榨菜	920,366.00	2.75
394	603379	三美股份	916,656.00	2.74
395	600016	民生银行	915,005.00	2.73
396	000666	经纬纺机	914,089.00	2.73

397	600703	三安光电	907,050.00	2.71
398	000700	模塑科技	906,335.39	2.71
399	601666	平煤股份	906,223.00	2.71
400	002127	南极电商	906,161.00	2.71
401	603650	彤程新材	900,163.00	2.69
402	688310	迈得医疗	898,615.90	2.68
403	603816	顾家家居	895,056.00	2.67
404	002453	华软科技	894,123.00	2.67
405	600696	岩石股份	889,178.00	2.65
406	002318	久立特材	886,007.00	2.65
407	603489	八方股份	884,698.00	2.64
408	605399	晨光新材	883,484.00	2.64
409	603267	鸿远电子	882,835.70	2.64
410	002328	新朋股份	880,126.70	2.63
411	601618	中国中冶	876,575.00	2.62
412	600103	青山纸业	876,355.00	2.62
413	601001	晋控煤业	873,356.00	2.61
414	002067	景兴纸业	873,112.00	2.61
415	603345	安井食品	871,961.00	2.60
416	300406	九强生物	870,664.14	2.60
417	002182	云海金属	869,879.00	2.60
418	002123	梦网科技	866,705.00	2.59
419	600189	泉阳泉	866,278.00	2.59
420	601678	滨化股份	865,746.00	2.58
421	300158	振东制药	865,299.00	2.58
422	300721	怡达股份	858,720.00	2.56
423	002681	奋达科技	858,335.00	2.56
424	300502	新易盛	857,365.00	2.56
425	002101	广东鸿图	854,285.00	2.55
426	002497	雅化集团	852,546.00	2.55
427	601018	宁波港	852,096.00	2.54
428	002867	周大生	850,814.00	2.54
429	600282	南钢股份	846,222.00	2.53
430	601928	凤凰传媒	844,536.00	2.52
431	600031	三一重工	840,296.00	2.51
432	000852	石化机械	839,954.00	2.51
433	600901	江苏租赁	839,721.00	2.51
434	002669	康达新材	839,588.00	2.51
435	600836	上海易连	839,567.00	2.51
436	300017	网宿科技	833,947.00	2.49
437	600664	哈药股份	832,486.00	2.49
438	600829	人民同泰	830,685.00	2.48

439	601019	山东出版	829,857.00	2.48
440	300443	金雷股份	824,182.00	2.46
441	000407	胜利股份	823,531.00	2.46
442	000989	九芝堂	823,325.58	2.46
443	603920	世运电路	822,450.00	2.46
444	603610	麒盛科技	820,521.90	2.45
445	002544	杰赛科技	816,734.00	2.44
446	002141	贤丰控股	816,454.00	2.44
447	601311	骆驼股份	814,697.42	2.43
448	002572	索菲亚	813,160.00	2.43
449	688301	奕瑞科技	812,297.70	2.43
450	002966	苏州银行	811,448.00	2.42
451	600567	山鹰国际	809,788.00	2.42
452	600717	天津港	805,398.00	2.40
453	600231	凌钢股份	805,388.50	2.40
454	601168	西部矿业	802,450.00	2.40
455	002345	潮宏基	801,037.00	2.39
456	603416	信捷电气	798,601.00	2.38
457	000761	本钢板材	795,080.89	2.37
458	600010	包钢股份	789,600.00	2.36
459	300207	欣旺达	789,020.00	2.36
460	603507	振江股份	787,063.00	2.35
461	600549	厦门钨业	784,558.00	2.34
462	601865	福莱特	781,284.00	2.33
463	300369	绿盟科技	779,358.00	2.33
464	601077	渝农商行	778,675.00	2.32
465	688398	赛特新材	776,122.24	2.32
466	601002	晋亿实业	774,505.00	2.31
467	603208	江山欧派	773,595.64	2.31
468	600108	亚盛集团	773,139.00	2.31
469	002651	利君股份	768,993.00	2.30
470	002110	三钢闽光	767,802.00	2.29
471	600399	抚顺特钢	766,031.00	2.29
472	300833	浩洋股份	762,455.00	2.28
473	603129	春风动力	761,775.00	2.27
474	688020	方邦股份	761,468.52	2.27
475	600713	南京医药	761,456.00	2.27
476	002805	丰元股份	759,747.00	2.27
477	002301	齐心集团	759,416.00	2.27
478	002142	宁波银行	758,969.00	2.27
479	300682	朗新科技	756,865.00	2.26
480	002833	弘亚数控	755,253.80	2.25

481	002216	三全食品	751,016.98	2.24
482	600569	安阳钢铁	749,964.00	2.24
483	600406	国电南瑞	741,951.00	2.22
484	600546	山煤国际	740,597.00	2.21
485	002080	中材科技	739,290.00	2.21
486	603156	养元饮品	738,483.79	2.20
487	603033	三维股份	737,952.00	2.20
488	002225	濮耐股份	737,553.00	2.20
489	000833	粤桂股份	735,271.00	2.20
490	603288	海天味业	735,111.00	2.19
491	601800	中国交建	734,818.00	2.19
492	000949	新乡化纤	732,584.00	2.19
493	600691	阳煤化工	727,359.00	2.17
494	002511	中顺洁柔	724,576.00	2.16
495	600276	恒瑞医药	722,856.00	2.16
496	300181	佐力药业	721,920.00	2.16
497	000883	湖北能源	718,511.00	2.15
498	003011	海象新材	718,502.40	2.15
499	002948	青岛银行	717,566.00	2.14
500	600256	广汇能源	712,818.00	2.13
501	000933	神火股份	712,274.00	2.13
502	600482	中国动力	708,493.00	2.12
503	600388	龙净环保	705,313.08	2.11
504	300672	国科微	703,075.00	2.10
505	300273	和佳医疗	702,351.00	2.10
506	600507	方大特钢	701,682.00	2.09
507	600971	恒源煤电	699,469.00	2.09
508	300373	扬杰科技	699,064.00	2.09
509	002785	万里石	698,231.00	2.08
510	601880	辽港股份	697,625.91	2.08
511	600422	昆药集团	692,996.00	2.07
512	002299	圣农发展	690,973.00	2.06
513	600120	浙江东方	687,312.00	2.05
514	603568	伟明环保	687,255.00	2.05
515	603115	海星股份	686,581.00	2.05
516	688066	航天宏图	685,653.96	2.05
517	600025	华能水电	684,974.00	2.04
518	000990	诚志股份	683,816.00	2.04
519	300693	盛弘股份	682,897.00	2.04
520	000012	南玻A	682,101.00	2.04
521	688036	传音控股	681,016.48	2.03
522	600008	首创环保	679,714.00	2.03

523	600210	紫江企业	677,968.00	2.02
524	002031	巨轮智能	677,463.00	2.02
525	300790	宇瞳光学	677,395.00	2.02
526	000905	厦门港务	676,418.00	2.02
527	600808	马钢股份	670,712.00	2.00
528	002236	大华股份	670,098.00	2.00

注：本项的“累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600809	山西汾酒	13,746,434.38	41.04
2	603501	韦尔股份	8,467,153.00	25.28
3	600036	招商银行	8,318,158.00	24.83
4	600309	万华化学	8,254,517.00	24.64
5	300782	卓胜微	8,059,745.56	24.06
6	600519	贵州茅台	7,882,201.00	23.53
7	601166	兴业银行	7,475,629.00	22.32
8	603659	璞泰来	7,364,868.60	21.99
9	603986	兆易创新	6,666,743.54	19.90
10	000799	酒鬼酒	6,593,617.00	19.68
11	603259	药明康德	6,396,687.80	19.10
12	000568	泸州老窖	6,352,256.00	18.96
13	002129	中环股份	6,321,114.00	18.87
14	601636	旗滨集团	6,062,725.00	18.10
15	601318	中国平安	5,806,914.00	17.34
16	002049	紫光国微	5,804,247.00	17.33
17	603806	福斯特	5,668,554.38	16.92
18	002415	海康威视	5,513,712.00	16.46
19	000858	五粮液	5,420,836.00	16.18
20	300122	智飞生物	5,374,111.00	16.04
21	600436	片仔癀	5,183,828.00	15.48
22	600702	舍得酒业	5,057,322.00	15.10
23	601919	中远海控	5,028,327.61	15.01
24	002812	恩捷股份	4,896,352.00	14.62
25	603799	华友钴业	4,890,665.00	14.60
26	300059	东方财富	4,814,612.74	14.37
27	000725	京东方 A	4,670,743.00	13.94
28	000786	北新建材	4,498,376.00	13.43
29	300142	沃森生物	4,498,076.98	13.43

30	002568	百润股份	4,305,538.30	12.85
31	600600	青岛啤酒	4,234,636.00	12.64
32	600900	长江电力	4,152,727.00	12.40
33	300274	阳光电源	4,141,952.00	12.37
34	600019	宝钢股份	4,098,323.00	12.24
35	300014	亿纬锂能	4,023,433.00	12.01
36	601899	紫金矿业	3,975,453.00	11.87
37	600132	重庆啤酒	3,975,014.00	11.87
38	601888	中国中免	3,939,515.48	11.76
39	002271	东方雨虹	3,932,568.00	11.74
40	300015	爱尔眼科	3,904,539.84	11.66
41	601088	中国神华	3,901,272.00	11.65
42	300347	泰格医药	3,899,161.00	11.64
43	000100	TCL 科技	3,828,675.00	11.43
44	601939	建设银行	3,743,221.00	11.18
45	601838	成都银行	3,707,686.00	11.07
46	603899	晨光文具	3,684,411.12	11.00
47	300363	博腾股份	3,664,880.00	10.94
48	002430	杭氧股份	3,643,251.05	10.88
49	601012	隆基股份	3,623,316.00	10.82
50	600887	伊利股份	3,590,931.00	10.72
51	603833	欧派家居	3,576,256.56	10.68
52	002841	视源股份	3,551,287.00	10.60
53	601600	中国铝业	3,469,656.00	10.36
54	002027	分众传媒	3,437,979.60	10.26
55	300124	汇川技术	3,433,509.93	10.25
56	600196	复星医药	3,422,996.16	10.22
57	002876	三利谱	3,394,200.00	10.13
58	000001	平安银行	3,354,495.00	10.01
59	000651	格力电器	3,344,160.00	9.98
60	600110	诺德股份	3,288,354.00	9.82
61	300759	康龙化成	3,241,475.00	9.68
62	300433	蓝思科技	3,212,886.72	9.59
63	002484	江海股份	3,206,743.00	9.57
64	688139	海尔生物	3,203,078.89	9.56
65	002920	德赛西威	3,198,556.00	9.55
66	002508	老板电器	3,148,548.00	9.40
67	002179	中航光电	3,118,709.00	9.31
68	002460	赣锋锂业	3,116,446.00	9.30
69	300763	锦浪科技	3,102,795.00	9.26
70	000661	长春高新	3,074,820.00	9.18
71	600690	海尔智家	3,063,764.00	9.15

72	601857	中国石油	3,055,927.00	9.12
73	600845	宝信软件	3,023,480.60	9.03
74	002648	卫星化学	3,020,980.74	9.02
75	002340	格林美	3,017,311.00	9.01
76	300737	科顺股份	3,012,647.00	8.99
77	600763	通策医疗	3,010,533.00	8.99
78	600183	生益科技	2,981,355.00	8.90
79	603055	台华新材	2,972,498.86	8.87
80	600028	中国石化	2,971,357.00	8.87
81	601100	恒立液压	2,970,924.40	8.87
82	600460	士兰微	2,944,510.00	8.79
83	600018	上港集团	2,885,250.00	8.61
84	601238	广汽集团	2,858,256.00	8.53
85	600919	江苏银行	2,815,690.00	8.41
86	600837	海通证券	2,792,871.00	8.34
87	300769	德方纳米	2,766,863.00	8.26
88	002821	凯莱英	2,766,107.00	8.26
89	601006	大秦铁路	2,693,502.00	8.04
90	601138	工业富联	2,690,888.00	8.03
91	300725	药石科技	2,654,346.00	7.92
92	002060	粤水电	2,654,053.00	7.92
93	601799	星宇股份	2,601,708.00	7.77
94	601669	中国电建	2,588,922.00	7.73
95	601229	上海银行	2,585,325.00	7.72
96	600438	通威股份	2,570,419.00	7.67
97	601628	中国人寿	2,482,901.00	7.41
98	000683	远兴能源	2,468,772.00	7.37
99	002245	蔚蓝锂芯	2,450,464.00	7.32
100	601336	新华保险	2,440,726.00	7.29
101	002139	拓邦股份	2,433,431.00	7.26
102	600329	中新药业	2,420,704.56	7.23
103	300628	亿联网络	2,379,157.22	7.10
104	603882	金域医学	2,359,728.00	7.04
105	600050	中国联通	2,354,977.00	7.03
106	601898	中煤能源	2,340,802.00	6.99
107	000009	中国宝安	2,340,495.00	6.99
108	601607	上海医药	2,316,476.05	6.92
109	601601	中国太保	2,316,090.00	6.91
110	600298	安琪酵母	2,310,253.00	6.90
111	000333	美的集团	2,286,158.00	6.83
112	688169	石头科技	2,265,480.65	6.76
113	000629	攀钢钒钛	2,262,796.00	6.76

114	300671	富满微	2,257,364.00	6.74
115	603026	石大胜华	2,236,476.80	6.68
116	600873	梅花生物	2,220,852.00	6.63
117	600297	广汇汽车	2,206,444.00	6.59
118	603688	石英股份	2,204,882.00	6.58
119	603127	昭衍新药	2,200,374.00	6.57
120	300171	东富龙	2,199,797.00	6.57
121	601211	国泰君安	2,174,876.00	6.49
122	300223	北京君正	2,170,142.00	6.48
123	002677	浙江美大	2,146,950.02	6.41
124	600753	东方银星	2,119,423.60	6.33
125	300146	汤臣倍健	2,113,927.00	6.31
126	002493	荣盛石化	2,113,057.00	6.31
127	002706	良信股份	2,111,967.00	6.31
128	603877	太平鸟	2,108,180.00	6.29
129	300358	楚天科技	2,102,848.00	6.28
130	002192	融捷股份	2,092,580.00	6.25
131	300294	博雅生物	2,088,895.34	6.24
132	603220	中贝通信	2,078,745.00	6.21
133	002850	科达利	2,070,457.00	6.18
134	601577	长沙银行	2,057,870.00	6.14
135	000671	阳光城	2,057,721.00	6.14
136	688188	柏楚电子	2,054,169.96	6.13
137	600705	中航产融	2,047,747.00	6.11
138	600586	金晶科技	2,044,134.00	6.10
139	000301	东方盛虹	1,997,803.00	5.96
140	000657	中钨高新	1,994,399.80	5.95
141	000063	中兴通讯	1,988,315.80	5.94
142	688002	睿创微纳	1,980,579.58	5.91
143	601225	陕西煤业	1,971,468.00	5.89
144	600169	太原重工	1,966,117.50	5.87
145	002270	华明装备	1,964,889.00	5.87
146	603993	洛阳钼业	1,960,908.00	5.85
147	603179	新泉股份	1,952,683.00	5.83
148	601598	中国外运	1,931,429.00	5.77
149	300751	迈为股份	1,925,223.00	5.75
150	600219	南山铝业	1,920,351.25	5.73
151	600426	华鲁恒升	1,910,448.00	5.70
152	300413	芒果超媒	1,899,106.00	5.67
153	603486	科沃斯	1,895,158.00	5.66
154	601339	百隆东方	1,892,831.16	5.65
155	300073	当升科技	1,890,988.00	5.65

156	300702	天宇股份	1,881,212.00	5.62
157	600233	圆通速递	1,880,889.00	5.62
158	600114	东睦股份	1,876,001.00	5.60
159	600782	新钢股份	1,874,125.00	5.60
160	002832	比音勒芬	1,869,718.29	5.58
161	603755	日辰股份	1,860,832.00	5.56
162	603678	火炬电子	1,845,918.00	5.51
163	000545	金浦钛业	1,843,958.60	5.51
164	300408	三环集团	1,843,854.52	5.50
165	002352	顺丰控股	1,843,336.00	5.50
166	002230	科大讯飞	1,839,500.00	5.49
167	002008	大族激光	1,828,572.00	5.46
168	002044	美年健康	1,824,446.00	5.45
169	600926	杭州银行	1,808,745.97	5.40
170	002372	伟星新材	1,805,151.00	5.39
171	603801	志邦家居	1,795,384.40	5.36
172	601677	明泰铝业	1,787,555.00	5.34
173	601233	桐昆股份	1,784,167.00	5.33
174	601633	长城汽车	1,769,799.00	5.28
175	600315	上海家化	1,767,979.00	5.28
176	688388	嘉元科技	1,761,729.95	5.26
177	601377	兴业证券	1,757,877.00	5.25
178	603613	国联股份	1,737,621.00	5.19
179	601699	潞安环能	1,730,449.00	5.17
180	601169	北京银行	1,724,452.00	5.15
181	688036	传音控股	1,708,555.15	5.10
182	000510	新金路	1,703,005.00	5.08
183	600497	驰宏锌锗	1,664,842.00	4.97
184	600466	蓝光发展	1,653,620.00	4.94
185	600160	巨化股份	1,644,840.00	4.91
186	000961	中南建设	1,640,087.00	4.90
187	603260	合盛硅业	1,627,784.00	4.86
188	600966	博汇纸业	1,622,048.00	4.84
189	601117	中国化学	1,620,471.00	4.84
190	600176	中国巨石	1,617,882.87	4.83
191	603727	博迈科	1,611,793.00	4.81
192	300119	瑞普生物	1,607,951.00	4.80
193	000823	超声电子	1,598,414.00	4.77
194	002304	洋河股份	1,595,646.00	4.76
195	300082	奥克股份	1,594,053.76	4.76
196	002614	奥佳华	1,576,094.72	4.71
197	002456	欧菲光	1,571,116.00	4.69

198	600325	华发股份	1,570,443.00	4.69
199	000983	山西焦煤	1,569,981.00	4.69
200	603979	金诚信	1,566,122.80	4.68
201	300662	科锐国际	1,565,311.00	4.67
202	000776	广发证券	1,561,174.00	4.66
203	601137	博威合金	1,556,808.26	4.65
204	603517	绝味食品	1,553,521.00	4.64
205	600307	酒钢宏兴	1,551,080.00	4.63
206	002254	泰和新材	1,548,931.00	4.62
207	603612	索通发展	1,535,317.00	4.58
208	600022	山东钢铁	1,528,371.00	4.56
209	000887	中鼎股份	1,519,717.00	4.54
210	300655	晶瑞电材	1,517,408.00	4.53
211	300458	全志科技	1,516,642.00	4.53
212	603987	康德莱	1,516,012.00	4.53
213	001979	招商蛇口	1,511,466.00	4.51
214	601328	交通银行	1,500,131.00	4.48
215	600346	恒力石化	1,494,130.00	4.46
216	002709	天赐材料	1,485,779.00	4.44
217	600779	水井坊	1,482,637.00	4.43
218	002585	双星新材	1,466,524.00	4.38
219	688056	莱伯泰科	1,464,072.06	4.37
220	600594	益佰制药	1,453,672.00	4.34
221	600559	老白干酒	1,449,728.00	4.33
222	002543	万和电气	1,435,923.00	4.29
223	300454	深信服	1,434,410.88	4.28
224	002206	海利得	1,428,038.00	4.26
225	300661	圣邦股份	1,422,872.00	4.25
226	603185	上机数控	1,397,587.00	4.17
227	002738	中矿资源	1,393,797.50	4.16
228	600123	兰花科创	1,393,505.00	4.16
229	000822	山东海化	1,390,940.00	4.15
230	600293	三峡新材	1,389,559.00	4.15
231	002536	飞龙股份	1,384,412.00	4.13
232	002145	中核钛白	1,380,501.00	4.12
233	600584	长电科技	1,358,416.42	4.06
234	300639	凯普生物	1,355,299.00	4.05
235	002918	蒙娜丽莎	1,351,165.00	4.03
236	601515	东风股份	1,346,481.00	4.02
237	000902	新洋丰	1,337,168.00	3.99
238	300593	新雷能	1,332,096.20	3.98
239	600908	无锡银行	1,331,534.00	3.98

240	600885	宏发股份	1,316,647.00	3.93
241	002258	利尔化学	1,314,364.48	3.92
242	600428	中远海特	1,313,351.00	3.92
243	600429	三元股份	1,313,218.00	3.92
244	688366	昊海生科	1,311,107.53	3.91
245	600027	华电国际	1,310,283.00	3.91
246	688519	南亚新材	1,307,137.19	3.90
247	300750	宁德时代	1,305,246.00	3.90
248	300595	欧普康视	1,304,453.00	3.89
249	000959	首钢股份	1,287,670.00	3.84
250	603225	新凤鸣	1,284,766.12	3.84
251	000002	万科A	1,284,538.00	3.83
252	000581	威孚高科	1,265,291.99	3.78
253	300767	震安科技	1,256,971.00	3.75
254	000778	新兴铸管	1,248,725.50	3.73
255	000615	奥园美谷	1,231,776.80	3.68
256	300003	乐普医疗	1,219,954.00	3.64
257	600803	新奥股份	1,217,241.00	3.63
258	002036	联创电子	1,217,063.00	3.63
259	603444	吉比特	1,214,079.00	3.62
260	600741	华域汽车	1,213,586.00	3.62
261	601998	中信银行	1,211,363.00	3.62
262	603300	华铁应急	1,206,580.80	3.60
263	300390	天华超净	1,204,511.00	3.60
264	600839	四川长虹	1,192,086.00	3.56
265	603392	万泰生物	1,190,211.00	3.55
266	601390	中国中铁	1,187,445.00	3.55
267	300143	盈康生命	1,186,628.00	3.54
268	000709	河钢股份	1,175,462.00	3.51
269	603707	健友股份	1,168,489.00	3.49
270	600166	福田汽车	1,167,328.00	3.49
271	688357	建龙微纳	1,163,707.43	3.47
272	688356	键凯科技	1,157,225.28	3.45
273	600062	华润双鹤	1,156,092.22	3.45
274	601985	中国核电	1,154,856.00	3.45
275	002120	韵达股份	1,152,838.00	3.44
276	688516	奥特维	1,144,555.88	3.42
277	603180	金牌厨柜	1,139,629.60	3.40
278	600141	兴发集团	1,136,474.00	3.39
279	600332	白云山	1,136,333.00	3.39
280	000060	中金岭南	1,122,690.00	3.35
281	002839	张家港行	1,118,112.12	3.34

282	000598	兴蓉环境	1,108,593.00	3.31
283	002064	华峰化学	1,108,400.00	3.31
284	002714	牧原股份	1,095,258.00	3.27
285	600989	宝丰能源	1,089,576.00	3.25
286	601009	南京银行	1,089,495.00	3.25
287	300037	新宙邦	1,088,268.11	3.25
288	601658	邮储银行	1,084,534.00	3.24
289	688518	联赢激光	1,083,988.45	3.24
290	002312	川发龙蟒	1,077,707.00	3.22
291	603233	大参林	1,074,464.00	3.21
292	000999	华润三九	1,073,527.00	3.20
293	002727	一心堂	1,072,839.00	3.20
294	000888	峨眉山 A	1,065,755.00	3.18
295	002859	洁美科技	1,064,765.00	3.18
296	600348	华阳股份	1,064,552.00	3.18
297	002167	东方锆业	1,061,494.00	3.17
298	300006	莱美药业	1,059,760.00	3.16
299	002283	天润工业	1,057,325.00	3.16
300	300568	星源材质	1,056,303.00	3.15
301	000898	鞍钢股份	1,054,415.00	3.15
302	002176	江特电机	1,052,125.00	3.14
303	600420	国药现代	1,049,212.00	3.13
304	601179	中国西电	1,041,793.00	3.11
305	600104	上汽集团	1,040,973.00	3.11
306	688122	西部超导	1,038,614.09	3.10
307	002594	比亚迪	1,037,928.00	3.10
308	603038	华立股份	1,037,824.00	3.10
309	002335	科华数据	1,028,623.40	3.07
310	002612	朗姿股份	1,027,819.00	3.07
311	603506	南都物业	1,024,255.52	3.06
312	603195	公牛集团	1,023,829.00	3.06
313	300681	英搏尔	1,012,950.00	3.02
314	601678	滨化股份	1,008,933.00	3.01
315	600039	四川路桥	1,007,426.00	3.01
316	300243	瑞丰高材	1,005,138.00	3.00
317	601882	海天精工	1,003,746.00	3.00
318	601128	常熟银行	1,002,823.00	2.99
319	600696	岩石股份	1,000,171.00	2.99
320	688396	华润微	999,656.00	2.98
321	600507	方大特钢	998,798.00	2.98
322	600577	精达股份	998,572.00	2.98
323	000883	湖北能源	997,988.00	2.98

324	688007	光峰科技	997,632.83	2.98
325	600308	华泰股份	994,402.00	2.97
326	601388	怡球资源	993,469.00	2.97
327	603906	龙蟠科技	990,576.00	2.96
328	002241	歌尔股份	984,484.00	2.94
329	600997	开滦股份	980,553.00	2.93
330	000733	振华科技	976,346.00	2.91
331	002101	广东鸿图	970,261.00	2.90
332	002985	北摩高科	970,075.00	2.90
333	603379	三美股份	966,787.00	2.89
334	002318	久立特材	962,431.36	2.87
335	600103	青山纸业	961,915.00	2.87
336	600496	精工钢构	960,685.00	2.87
337	603816	顾家家居	954,078.00	2.85
338	000987	越秀金控	951,989.00	2.84
339	603208	江山欧派	945,407.00	2.82
340	002588	史丹利	944,777.00	2.82
341	000666	经纬纺机	942,929.00	2.82
342	300179	四方达	942,083.00	2.81
343	603505	金石资源	935,181.00	2.79
344	605399	晨光新材	934,303.00	2.79
345	000807	云铝股份	932,380.00	2.78
346	600499	科达制造	920,221.00	2.75
347	600189	泉阳泉	919,450.00	2.74
348	601168	西部矿业	919,086.00	2.74
349	000989	九芝堂	918,350.00	2.74
350	601818	光大银行	918,337.00	2.74
351	002371	北方华创	917,112.00	2.74
352	601877	正泰电器	915,009.00	2.73
353	000425	徐工机械	910,588.00	2.72
354	603267	鸿远电子	903,887.00	2.70
355	000852	石化机械	899,418.50	2.69
356	603380	易德龙	897,903.00	2.68
357	002867	周大生	895,253.00	2.67
358	600872	中炬高新	895,166.00	2.67
359	002507	涪陵榨菜	889,684.00	2.66
360	002182	云海金属	884,276.00	2.64
361	601808	中海油服	877,762.00	2.62
362	002328	新朋股份	875,959.00	2.62
363	300721	怡达股份	872,558.00	2.60
364	600282	南钢股份	870,273.00	2.60
365	603345	安井食品	869,863.00	2.60

366	000825	太钢不锈	868,850.00	2.59
367	688310	迈得医疗	867,505.94	2.59
368	601319	中国人保	867,179.00	2.59
369	002497	雅化集团	865,843.00	2.58
370	600016	民生银行	859,042.00	2.56
371	600481	双良节能	857,735.00	2.56
372	600031	三一重工	856,720.00	2.56
373	603489	八方股份	856,279.00	2.56
374	002001	新和成	856,010.00	2.56
375	601928	凤凰传媒	853,834.00	2.55
376	601666	平煤股份	853,219.00	2.55
377	600161	天坛生物	849,189.00	2.54
378	601001	晋控煤业	847,245.00	2.53
379	000700	模塑科技	846,699.00	2.53
380	000039	中集集团	840,972.00	2.51
381	300406	九强生物	840,264.00	2.51
382	600901	江苏租赁	831,215.00	2.48
383	002067	景兴纸业	830,813.00	2.48
384	600549	厦门钨业	823,852.00	2.46
385	300394	天孚通信	822,558.60	2.46
386	300861	美畅股份	822,138.00	2.45
387	601019	山东出版	821,312.00	2.45
388	688015	交控科技	820,599.02	2.45
389	688398	赛特新材	819,282.39	2.45
390	300158	振东制药	819,065.00	2.45
391	300502	新易盛	817,995.00	2.44
392	000407	胜利股份	817,351.00	2.44
393	002123	梦网科技	815,233.00	2.43
394	600399	抚顺特钢	814,196.00	2.43
395	300718	长盛轴承	813,967.00	2.43
396	002966	苏州银行	813,669.00	2.43
397	002572	索菲亚	813,376.00	2.43
398	002216	三全食品	811,484.00	2.42
399	603948	建业股份	810,735.00	2.42
400	002080	中材科技	808,619.00	2.41
401	002681	奋达科技	808,224.00	2.41
402	600829	人民同泰	807,981.99	2.41
403	688556	高测股份	805,018.25	2.40
404	300788	中信出版	804,922.00	2.40
405	002142	宁波银行	804,189.00	2.40
406	600836	上海易连	803,481.00	2.40
407	002301	齐心集团	800,921.00	2.39

408	601018	宁波港	797,252.00	2.38
409	002345	潮宏基	797,246.00	2.38
410	600691	阳煤化工	792,006.00	2.36
411	300017	网宿科技	790,699.00	2.36
412	600010	包钢股份	785,959.00	2.35
413	600660	福耀玻璃	783,993.00	2.34
414	600717	天津港	783,126.09	2.34
415	002127	南极电商	776,923.00	2.32
416	002409	雅克科技	776,776.00	2.32
417	600703	三安光电	775,304.00	2.31
418	688020	方邦股份	775,186.45	2.31
419	300775	三角防务	771,818.00	2.30
420	603668	天马科技	771,773.00	2.30
421	300369	绿盟科技	771,490.00	2.30
422	600569	安阳钢铁	769,037.00	2.30
423	603156	养元饮品	766,336.00	2.29
424	601865	福莱特	766,158.00	2.29
425	601077	渝农商行	766,062.00	2.29
426	002511	中顺洁柔	765,794.00	2.29
427	600567	山鹰国际	764,390.00	2.28
428	601618	中国中冶	762,016.00	2.27
429	601002	晋亿实业	760,699.00	2.27
430	000612	焦作万方	757,821.00	2.26
431	600664	哈药股份	753,164.00	2.25
432	600256	广汇能源	751,040.00	2.24
433	000012	南玻A	748,819.00	2.24
434	601311	骆驼股份	748,505.00	2.23
435	000761	本钢板材	747,351.00	2.23
436	002268	卫士通	747,191.00	2.23
437	688202	美迪西	746,579.50	2.23
438	300327	中颖电子	745,039.70	2.22
439	600406	国电南瑞	743,284.00	2.22
440	603033	三维股份	743,073.00	2.22
441	600713	南京医药	742,898.00	2.22
442	603416	信捷电气	742,725.00	2.22
443	600546	山煤国际	741,501.00	2.21
444	600231	凌钢股份	738,611.00	2.21
445	600276	恒瑞医药	737,185.00	2.20
446	000833	粤桂股份	737,069.00	2.20
447	603595	东尼电子	736,910.00	2.20
448	600372	中航电子	735,687.47	2.20
449	603568	伟明环保	733,086.00	2.19

450	600025	华能水电	732,955.00	2.19
451	002266	浙富控股	728,465.00	2.17
452	300181	佐力药业	726,565.00	2.17
453	002948	青岛银行	721,814.57	2.15
454	600971	恒源煤电	721,477.00	2.15
455	600261	阳光照明	719,484.00	2.15
456	603650	彤程新材	719,255.00	2.15
457	000768	中航西飞	718,005.00	2.14
458	000949	新乡化纤	717,034.00	2.14
459	002785	万里石	713,891.00	2.13
460	000963	华东医药	710,023.00	2.12
461	002833	弘亚数控	709,538.00	2.12
462	601800	中国交建	704,744.00	2.10
463	002110	三钢闽光	703,272.00	2.10
464	601880	辽港股份	701,734.00	2.09
465	603308	应流股份	701,402.40	2.09
466	000990	诚志股份	700,834.00	2.09
467	603712	七一二	696,401.00	2.08
468	002225	濮耐股份	693,833.00	2.07
469	603938	三孚股份	692,998.00	2.07
470	000933	神火股份	686,926.00	2.05
471	002299	圣农发展	686,652.00	2.05
472	300790	宇瞳光学	686,610.17	2.05
473	600008	首创环保	683,208.00	2.04
474	600422	昆药集团	679,500.00	2.03
475	600120	浙江东方	678,468.81	2.03
476	300792	壹网壹创	677,169.00	2.02
477	601126	四方股份	674,445.00	2.01
478	300373	扬杰科技	672,381.00	2.01
479	002236	大华股份	670,741.00	2.00
480	600057	厦门象屿	670,508.00	2.00
481	603881	数据港	670,365.00	2.00

注：本项的“累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,219,698,157.92
卖出股票收入（成交）总额	1,136,804,659.43

注：“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”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

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	6,929,492.00	5.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,215.00	0.04
	其中：政策性金融债	50,215.00	0.04
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,979,707.00	5.24

## 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	019658	21 国债 10	47,000	4,692,950.00	3.53
2	019654	21 国债 06	17,500	1,750,525.00	1.32
3	019641	20 国债 11	4,000	401,000.00	0.30
4	019649	21 国债 01	850	85,017.00	0.06
5	018006	国开 1702	500	50,215.00	0.04

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货合约。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券博雅生物（股票代码：300294 SZ）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2021年3月3日，博雅生物制药集团股份有限公司因未及时披露公司重大事件，重大事项未履行审议程序被江西证监局通知整改【江西证监局[2021]2号、3号】。

2021年11月25日，博雅生物制药集团股份有限公司因未依法履行职责被深圳证券交易所通报批评。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本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，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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	51,236.24
2	应收证券清算款	660,492.00
3	应收股利	-
4	应收利息	79,648.08
5	应收申购款	109,442.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	900,818.93
---	----	------------

#### 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。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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 (%)
安信量化优选股票 A	270	41,090.98	10,000,000.00	90.13	1,094,563.95	9.87
安信量化优选股票 C	3,103	15,045.63	42,706,401.49	91.47	3,980,192.43	8.53
合计	3,332	17,341.28	52,706,401.49	91.22	5,074,756.38	8.78

注：机构/个人投资者持有份额占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）。

#### 9.2 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	安信量化优选股票 A	30,337.42	0.27
	安信量化优选股票 C	-	-
	合计	30,337.42	0.05

注：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	安信量化优选股票 A	0
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	安信量化优选股票 A	0~10
	安信量化优选股票 C	0
	合计	0~10

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	17.31	10,000,000.00	17.31	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	17.31	10,000,000.00	17.31	-

注：本基金发起资金持有期限已满三年。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	安信量化优选股票 A	安信量化优选股票 C
基金合同生效日（2018 年 9 月 3 日）基金份额总额	10,000,297.54	26,003.05
本报告期期初基金份额总额	12,224,317.46	4,735,995.29
本报告期基金总申购份额	1,397,203.14	74,157,948.72
减：本报告期基金总赎回份额	2,526,956.65	32,207,350.09
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	11,094,563.95	46,686,593.92

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未举行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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 3 月 19 日发布了《2021 年度安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告》，经安信基金管理有限责任公司第四届董事会第五次会议审议通过：自 2021 年 3 月 18 日起，孙晓奇先生担任公司督察长，卸任公司副总经理；乔江晖女士担任公司副总经理，卸任公司督察长。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，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

本报告期内本基金无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本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

本基金聘请的会计师事务所为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 15,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	1,485,862,512.14	63.10%	1,056,895.10	63.07%	-
方正证券	2	513,466,710.39	21.81%	365,224.65	21.79%	-
中泰证券	2	152,463,616.78	6.47%	108,443.52	6.47%	-
华泰证券	1	110,866,706.71	4.71%	78,859.81	4.71%	-
申万宏源	2	47,027,864.75	2.00%	33,451.86	2.00%	-
国泰君安	1	45,056,673.72	1.91%	32,949.97	1.97%	-
东莞证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	新租
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：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）的有关规定，本基金管理人制定了《安信基金管理有限责任公司券商交易单元选择标准及佣金分配办法》，对券商交易单元的选择标准和程序进行了规定。本基金管理人将券商路演数量和质量、提供的信息充分性和及时性、系统支持等作为交易单元的选择标准，由权益投资部、研究部、运营部交易室对券商考评后提出租用及变更方案，最终由公司基金投资决策委员讨论及决定。

### 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
广发证券	5,206,715.21	56.10%	18,200,000.00	71.09%	-	-
方正证券	3,310,543.54	35.67%	1,300,000.00	5.08%	-	-
中泰证券	52,672.50	0.57%	5,000,000.00	19.53%	-	-
华泰证券	703,500.00	7.58%	1,100,000.00	4.30%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国泰君安	7,286.40	0.08%	-	-	-	-

东莞证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

### 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	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-22
2	安信基金管理有限责任公司关于调整适用“养老金客户费率优惠”的养老金客户范围的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-01-27
3	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 57 只基金新增中邮证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-02-04
4	关于安信价值精选股票型证券投资基金等 10 只基金新增华林证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021-03-10
5	2021 年度 安信基金管理有限责任公司高级管理人员变更公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-19
6	关于安信策略精选灵活配置混合型证券投资基金等 52 只基金新增泛华普益基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-23
7	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金年度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-03-29
8	安信基金管理有限责任公司旗下全部基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-21
9	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增爱建证券有限责任公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-04-30
10	安信基金管理有限责任公司关于信息技术突发事件发生时投资者可替代交易方式的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-05-20
11	安信基金管理有限责任公司关于提醒投资者防范不法分子假冒本公司名义从事诈骗活动的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-06-26
12	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增华融证券股份有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-15

13	安信基金管理有限责任公司旗下 66 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-07-20
14	安信基金管理有限责任公司旗下 69 只基中期报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-08-27
15	安信基金管理有限责任公司关于旗下部分开放式基金新增上海利得基金销售有限公司为基金销售服务机构的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-03
16	安信基金管理有限责任公司关于新增基金直销账户信息的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-22
17	安信基金管理有限责任公司关于恢复泰信财富基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-09-22
18	安信基金管理有限责任公司旗下 73 只基金季度报告提示性公告	中国证券报、证券日报、证券时报、上海证券报	2021-10-26

## § 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	20210101-20210901	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	17.31
	2	20210902-20210908	-	29,882,604.06	29,882,604.06	-	-
	3	20210902-202111231	-	42,689,434.36	-	42,689,434.36	73.88

#### 产品特有风险

本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：

(1) 基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

(2) 基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

- (3) 因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；
- (4) 基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；
- (5) 大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

## 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、中国证监会准予安信量化优选股票型发起式证券投资基金募集的文件；
- 2、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、《安信量化优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 5、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

本基金管理人和基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

上述文件可在安信基金管理有限责任公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到安信基金管理有限责任公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人安信基金管理有限责任公司。

客户服务电话：4008-088-088

网址：<http://www.essencefund.com>

安信基金管理有限责任公司

2022年3月31日