

# 淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:淳厚基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了2021年度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01月01日起至2021年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	66
8.1 期末基金资产组合情况	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	67
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	68
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	82
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	82
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	82
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	82

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	82
§9 基金份额持有人信息.....	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	84
§10 开放式基金份额变动.....	84
§11 重大事件揭示.....	85
11.1 基金份额持有人大会决议.....	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	86
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	92
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.....	92
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	92
§13 备查文件目录.....	92
13.1 备查文件目录.....	92
13.2 存放地点.....	93
13.3 查阅方式.....	93

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	淳厚信泽	
基金主代码	007811	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年08月21日	
基金管理人	淳厚基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	226,889,151.00份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	淳厚信泽A	淳厚信泽C
下属分级基金的交易代码	007811	007812
报告期末下属分级基金的份额总额	172,125,917.46份	54,763,233.54份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<ol style="list-style-type: none"> <li>1、资产配置策略</li> <li>2、股票投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 行业分析与配置</li> <li>(2) 公司财务状况评估</li> <li>(3) 价值评估</li> <li>(4) 股票选择与组合优化</li> <li>(5) 港股投资策略</li> </ol> </li> <li>3、债券投资策略 <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 利率策略</li> <li>(2) 信用策略</li> <li>(3) 债券选择与组合优化</li> <li>(4) 可转换债券、可交换债券投资</li> </ol> </li> <li>4、资产支持证券投资策略</li> <li>5、衍生品投资策略</li> </ol>

	<p>(1) 股指期货投资策略</p> <p>(2) 国债期货投资策略</p> <p>6、融资业务的投资策略。</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率×40%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价（总值）指数收益率×40%</p>
风险收益特征	<p>本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险收益水平低于股票型证券投资基金、高于债券型证券投资基金、货币市场基金。</p> <p>本基金将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

### 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	淳厚基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢芳
	联系电话	021-60607066
	电子邮箱	xiefang@purekindfund.com
客户服务电话	4000009738	010-60836588
传真	021-60607060	010-60834004
注册地址	上海市虹口区临潼路170号607室	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座
办公地址	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F	北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层
邮政编码	200135	100125
法定代表人	邢媛	张佑君

### 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	<a href="http://www.purekindfund.com/">http://www.purekindfund.com/</a>

址	
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市威海路755号上海报业集团大厦25层
注册登记机构	淳厚基金管理有限公司	上海市浦东新区丁香路778号丁香国际大厦西塔7F

## § 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08月21日(基金合同生效日)-2019年12月31日	
	淳厚信泽A	淳厚信泽C	淳厚信泽A	淳厚信泽C	淳厚信泽A	淳厚信泽C
本期已实现收益	41,614,435.76	14,822,287.03	46,373,733.50	28,574,735.79	3,443,652.30	2,261,179.91
本期利润	47,126,886.49	17,883,198.74	42,288,590.73	24,598,786.94	16,224,984.13	8,760,774.21
加权平均基金份额本期利润	0.3513	0.3730	0.4058	0.3806	0.0743	0.0380
本期加权平均净值利润率	20.51%	22.00%	31.60%	29.28%	7.38%	3.79%
本期基金份额净值增长	22.76%	22.40%	40.93%	40.14%	8.58%	8.28%

率						
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可供分配利润	135,535,448.45	41,990,765.30	44,367,681.19	19,809,126.93	2,938,990.82	1,267,979.46
期末可供分配基金份额利润	0.7874	0.7668	0.4751	0.4624	0.0182	0.0154
期末基金资产净值	323,344,975.51	101,712,267.00	142,905,536.85	65,002,143.06	175,397,143.41	89,324,675.76
期末基金份额净值	1.8785	1.8573	1.5302	1.5174	1.0858	1.0828
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	87.85%	85.73%	53.02%	51.74%	8.58%	8.28%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、期末可供分配利润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(为期末余额，不是当期发生数)。

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

### 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

淳厚信泽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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	10.99%	0.72%	-0.45%	0.45%	11.44%	0.27%
过去六个月	8.20%	1.01%	-5.53%	0.62%	13.73%	0.39%
过去一年	22.76%	1.03%	-3.90%	0.67%	26.66%	0.36%
自基金合同生效起至今	87.85%	1.10%	13.36%	0.70%	74.49%	0.40%

淳厚信泽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	10.85%	0.72%	-0.45%	0.45%	11.30%	0.27%
过去六个月	8.01%	1.01%	-5.53%	0.62%	13.54%	0.39%
过去一年	22.40%	1.03%	-3.90%	0.67%	26.30%	0.36%
自基金合同生效起至今	85.73%	1.10%	13.36%	0.70%	72.37%	0.40%

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

淳厚信泽A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年08月21日-2021年12月31日)



注：本基金基金合同生效日为 2019 年 8 月 21 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例均符合基金合同约定。

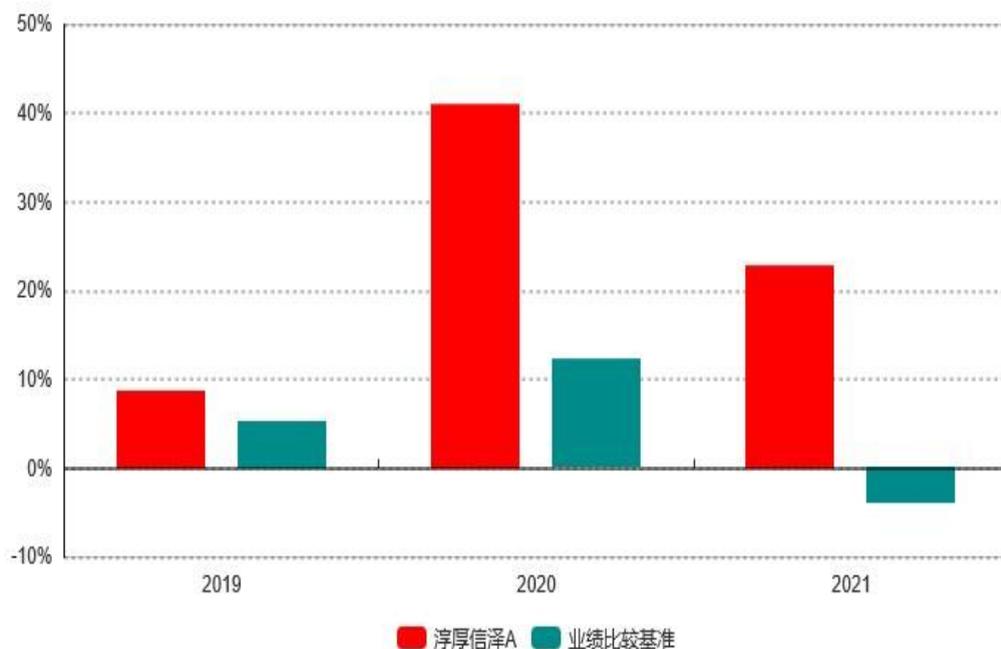
淳厚信泽C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年08月21日-2021年12月31日)

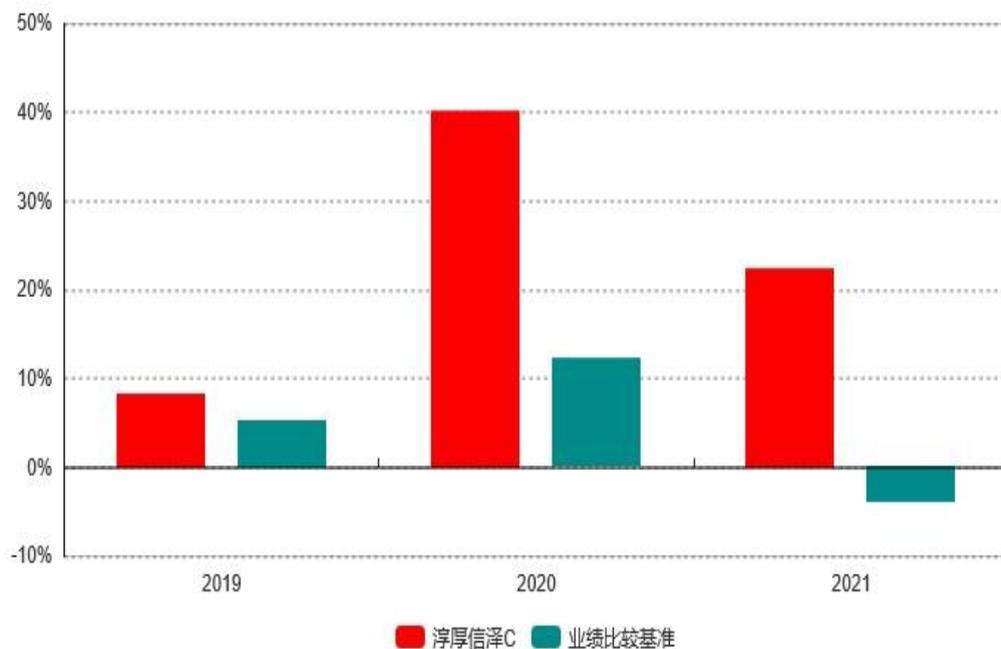


注：本基金基金合同生效日为 2019 年 8 月 21 日。按基金合同约定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例均符合基金合同约定。

### 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



注：1) 本基金合同于 2019 年 8 月 21 日生效。  
 2) 2019 年是合同生效当年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：1) 本基金合同于 2019 年 8 月 21 日生效。  
2) 2019 年是合同生效当年，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

淳厚基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2018】1618号文批准，于2018年11月3日成立，是由六位资深专业人士发起设立的公募基金管理公司。公司注册地上海，注册资本为1亿元人民币。公司于2019年2月1日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。

#### 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		
薛莉丽	基金经理	2019-08-21	-	14年	上海财经大学经济学硕士。曾任兴业证券证券投资部（权益自营部）投资经理、总经理助理、部门副总监。2019年加入淳厚基金，现任淳厚基金权益投资部总监、淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、淳厚信睿核心精选混合型证券投资基金基金经理、淳厚欣颐一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚益加增强债券型证券投资基金基金经理、淳厚鑫淳一年持有期混合型证券投资基

					金基金经理、淳厚现代服务业股票型证券投资基金基金经理、淳厚鑫悦商业模式优选混合型证券投资基金基金经理。
廖辰轩	基金经理	2021-03-18	-	11年	上海交通大学金融学本科、硕士。曾任兴业证券股份有限公司研究员、投资经理。2020年加入淳厚基金管理有限公司，曾任专户投资部投资经理。现任淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理、淳厚鑫淳一年持有期混合型证券投资基金基金经理、淳厚鑫悦商业模式优选混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；  
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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、本基金《基金合同》等法律文件和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定，无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

基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的规定，制定了《淳厚基金管理有限公司公平交易制度》和《淳厚基金管理有限公司异常交易监控与报告制

度》，对投资决策的内部控制、交易执行的内部控制、公平交易实施情况的监控与检查稽核、异常交易的监控等进行了规定。为保证各投资组合在投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，基金管理人合理设置了各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，建立了科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循“价格优先、比例分配”的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司交易部和监察稽核部进行日常投资交易行为监控，监察稽核部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合未发生参与交易所公开竞价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形，未发现异常交易行为。

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

2021年新冠疫情在全球范围内持续肆虐，各国通过接种疫苗和研发新冠药品等方式来构建抗疫屏障，全球经济秩序逐步恢复中。由于疫情期间海外的持续宽松政策导致大宗商品原材料价格高企、通胀压力不断增加，全球逐步开始退出过度宽松的货币政策。

中国保持了行之有效的疫情防控政策，上半年经济增长恢复势头良好，下半年经济下行压力加大，央行进行了两次降准，货币政策稳中有松。权益市场方面，2021年欧美市场整体表现强于亚洲市场，A股在2月创年内新高后进入宽幅震荡行情，全年小幅收涨；港股则受到多重因素压制，领跌全球。

本基金始终坚持“自下而上选择优质股票，以合理估值买入并持有”的投资策略，在2021年度取得了较为良好的业绩。回顾业绩归因，今年最大超额收益来自于对专精特新类优秀个股的挖掘，我们一直希望发挥自身优势提升个股挖掘的能力，长期坚持做难而正确的事。

分阶段来看，本基金下半年业绩表现优于上半年，这正是我们2021年初挖掘的个股在下半年得到了更好的市场检验。

在组合层面，我们一直坚持行业均衡、估值均衡的配置思路，在我们看好的智能制造、科技创新、医药医疗、大消费等多个板块进行了均衡配置。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末淳厚信泽A基金份额净值为1.8785元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.76%，同期业绩比较基准收益率为-3.90%；截至报告期末淳厚信泽C基金份额净值为1.8573元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为22.40%，同期业绩比较基准收益率为-3.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年中国GDP增速呈现前高后低的走势，上半年疫情防控较为平稳，国内外需求恢复良好，出口保持快速增长，消费回暖，投资活跃，GDP实现双位数增长。下半年开始经济增长动能减弱，疫情呈不断散发状态，大宗原材料价格高企逐步向下游传导，CPI在四季度呈现抬头趋势，同时能源革命向深层次推进，政策层面强化部分行业的规范和监管，使得下半年经济呈现“类滞胀”情况，GDP增速逐季回落。

展望2022年，全球新冠疫情何时结束尚无定论，海外经济和政治形势错综复杂，但全球货币政策边际收紧已成定势。国内在经济下行压力较大的背景下，“稳增长”或成为上半年主基调，政策层面或将更加积极，持续增强经济增长动能。A股整体估值仍然较为合理，展望后市，我们并不悲观，权益市场仍是可为的，但相比过去三年把握结构性机会的难度有所加大。

我们认为机会将来自于前期受损于疫情的行业盈利能力逐步恢复，后疫情时代下企业顺势而为带来的护城河提升，以及能源革命深入推进方向、专精特新类成长型标的。港股市场在经历了大幅调整后，市场处在底部区域，我们考虑择机适当增加港股配置比例。我们相信，在注册制持续推进以及资本市场不断开放的背景下，A股及港股长期依

然具备较好的结构性机会。我们将一如既往以兢兢业业、满怀责任的态度做好投资研究工作，为投资人创造更好的投资回报。

#### 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，基金管理人有序进行监察稽核工作，主要采取了如下监察稽核措施：定期对本基金投研交易、销售和后台运营等各项业务开展情况、内部规章制度执行情况、合规控制和风险控制情况进行系统全面的检查和评价，跟进后续改进情况，完成监察稽核季报。同时，按照监管机构下发的各项通知，开展有针对性的专项稽核工作。持续完善制度流程和监控模型，采用有效手段，日常监控投资管理人员的个人行为，利用公平交易分析投资人员的投资行为，防范出现违规行为。关注内部控制的健全性和有效性，全面梳理各项业务的工作流程，对其中的各项风险进行识别、评估，并对现有的控制手段提出改进性建议。同时，结合出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和完善业务流程。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，应参照协会通知执行。

报告期内，本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会主任委员由分管运营的副总经理担任，常务副主任委员由运营保障部负责人担任，专业委员若干名，由权益投资部、固定收益投资部、研究中心、监察稽核部、运营保障部、市场综合部等部门负责人或其指定人员组成。

估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经验，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理可列席公司估值委员会，不介入基金日常估值业务，但可参加估值小组会议，可以提议测算某一投资品种的估值调整影响，但不能参与表决，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。

日常估值由本基金管理人会同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：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除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基

金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

报告期内，本基金未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，淳厚基金管理有限公司在淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由淳厚基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字（2022）第2364号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金全体份额持有人
审计意见	我们审计了淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“淳厚信泽”)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,后附淳厚信泽的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了淳厚信泽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,我们独立于淳厚信泽,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系淳厚信泽管理人(以下简称“管理人”)根据《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定为其基金份额持有人编制的,因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供淳厚信泽份额持有人和向中国证券投资基金业协会及其派出机构报送使用,不得用于其他目的。
其他信息	管理人对其他信息负责。其他信息包括淳厚信泽2021年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表

	<p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，管理人负责评估淳厚信泽的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非基金进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，</p>

	<p>作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对淳厚信泽持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致淳厚信泽不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与管理人就淳厚信泽的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	胡治华、江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市威海路755号上海报业集团大厦25层
审计报告日期	2022-03-25

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	69,930,777.57	39,433,403.60
结算备付金		3,554.53	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	355,368,806.54	169,815,583.77
其中：股票投资		324,936,306.54	158,185,239.77
基金投资		-	-
债券投资		30,432,500.00	11,630,344.00
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		-	-
应收利息	7.4.7.5	537,705.72	18,541.42
应收股利		-	-
应收申购款		-	32,561.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		425,840,844.36	209,300,089.85
<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		-	-
应付赎回款		-	875,432.54
应付管理人报酬		521,615.92	285,135.37

应付托管费		69,548.79	38,018.04
应付销售服务费		43,620.94	34,885.02
应付交易费用	7.4.7.7	800.00	-
应交税费		16.20	168.95
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	148,000.00	158,770.02
负债合计		783,601.85	1,392,409.94
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	226,889,151.00	136,229,347.93
未分配利润	7.4.7.10	198,168,091.51	71,678,331.98
所有者权益合计		425,057,242.51	207,907,679.91
负债和所有者权益总计		425,840,844.36	209,300,089.85

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额总额226,889,151.00份，其中A类基金份额的份额总额为172,125,917.46份，份额净值1.8785元；C类基金份额的份额总额为54,763,233.54份，份额净值1.8573元。

## 7.2 利润表

会计主体：淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
<b>一、收入</b>		74,462,090.56	73,961,064.62
1. 利息收入		1,065,355.68	417,528.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	498,679.96	326,292.30
债券利息收入		442,967.57	88,920.06
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		123,708.15	2,316.16

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		64,273,899.99	81,412,696.52
其中：股票投资收益	7.4.7.12	61,731,268.08	70,660,378.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	174,662.58	8,723,564.74
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	2,367,969.33	2,028,753.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	8,573,362.44	-8,061,091.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	549,472.45	191,931.20
<b>减：二、费用</b>		9,452,005.33	7,073,686.95
1. 管理人报酬		4,632,645.51	3,269,012.02
2. 托管费		617,686.06	435,868.23
3. 销售服务费		402,744.82	419,665.79
4. 交易费用	7.4.7.18	3,622,918.44	2,671,383.82
5. 利息支出		-	373.94
其中：卖出回购金融资产支出		-	373.94
6. 税金及附加		10.50	238.71
7. 其他费用	7.4.7.19	176,000.00	277,144.44
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		65,010,085.23	66,887,377.67
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		65,010,085.23	66,887,377.67
-------------------	--	---------------	---------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01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)	136,229,347.93	71,678,331.98	207,907,679.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	65,010,085.23	65,010,085.23
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)	90,659,803.07	61,479,674.30	152,139,477.37
其中：1. 基金申购款	247,041,091.54	172,670,914.28	419,712,005.82
2. 基金赎回款	-156,381,288.47	-111,191,239.98	-267,572,528.45
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)	226,889,151.00	198,168,091.51	425,057,242.51
项 目	上年度可比期间 2020年01月01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)	244,035,320.36	20,686,498.81	264,721,819.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	66,887,377.67	66,887,377.67
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)	-107,805,972.43	-15,895,544.50	-123,701,516.93
其中：1. 基金申购款	106,634,436.12	37,503,436.06	144,137,872.18
2. 基金赎回款	-214,440,408.55	-53,398,980.56	-267,839,389.11
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)	136,229,347.93	71,678,331.98	207,907,679.91

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：

邢媛

董卫军

刘远新

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

淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1368号《关于准予淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由淳厚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

负责公开募集。本基金的基金管理人为淳厚基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。本基金于2019年8月21日募集成立，募集期为自2019年8月8日至2019年8月16日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，本基金共募集有效净认购资金501,289,419.20元，折合501,289,419.20份淳厚信泽基金份额(其中：A类基金份额为228,271,079.64份；C类基金份额为273,018,339.56份)。有效认购资金在募集期间产生的利息为人民币76,909.57元，折合76,909.57份淳厚信泽基金份额(其中：A类基金份额为47,803.17份；C类基金份额为29,106.40份)，以上收到的实收基金共计人民币501,366,328.77元，折合501,366,328.77份淳厚信泽基金份额(其中：A类基金份额为228,318,882.81份；C类基金份额为273,047,445.96份)，有效认购户数为6039户。按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经上会会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为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或注册上市的股票)及存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、银行存款、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率×40%+中证港股通综合指数收益率×20%+中债综合全价(总值)指数收益率×40%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时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发布的若干基金行业实务操作。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账本位币单位为元。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时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和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等，其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报，衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：

(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

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

(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

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 利息收入

① 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

② 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

③ 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### (2) 投资收益

① 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

② 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

③ 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

④ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

### (3) 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的基金托管费按《基金合同》约定的方法进行计提。

本基金的C类基金份额的销售服务费按《基金合同》约定的方法进行计提。

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。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按除权后的基金份额净值自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润可能有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 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

根据财政部、国家税务总局国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号文《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》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2、对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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

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

6、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	34,604,013.84	980,668.14
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	35,326,763.73	38,452,735.46
合计	69,930,777.57	39,433,403.60

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

##### 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	305,337,449.49	324,936,306.54	19,598,857.05	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	30,238,160.10	30,432,500.00	194,339.90
	银行间市场	-	-	-
	合计	30,238,160.10	30,432,500.00	194,339.90

资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	335,575,609.59	355,368,806.54	19,793,196.95	
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	146,349,518.07	158,185,239.77	11,835,721.70	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	12,246,231.19	11,630,344.00	-615,887.19
	银行间市场	-	-	-
	合计	12,246,231.19	11,630,344.00	-615,887.19
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	158,595,749.26	169,815,583.77	11,219,834.51	

#### 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未持有衍生金融资产/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未持有买入返售金融资产。

##### 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未持有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	12,436.61	618.50
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	8,043.06	8,265.62
应收结算备付金利息	2.48	3,588.30
应收债券利息	517,223.57	6,069.00
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	-	-
合计	537,705.72	18,541.42

注：应收其他存款利息为应收券商保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 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	-	-
银行间市场应付交易费用	800.00	-
合计	800.00	-

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	425.58
应付证券出借违约金	-	-

预提费用-审计费	28,000.00	38,344.44
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
合计	148,000.00	158,770.02

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 淳厚信泽A

金额单位：人民币元

项目 (淳厚信泽A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	93,391,770.35	93,391,770.35
本期申购	151,808,791.70	151,808,791.70
本期赎回(以“-”号填列)	-73,074,644.59	-73,074,644.59
本期末	172,125,917.46	172,125,917.46

##### 7.4.7.9.2 淳厚信泽C

金额单位：人民币元

项目 (淳厚信泽C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	42,837,577.58	42,837,577.58
本期申购	95,232,299.84	95,232,299.84
本期赎回(以“-”号填列)	-83,306,643.88	-83,306,643.88
本期末	54,763,233.54	54,763,233.54

注：申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 淳厚信泽A

单位：人民币元

项目 (淳厚信泽A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,367,681.19	5,146,085.31	49,513,766.50

本期利润	41,614,435.76	5,512,450.73	47,126,886.49
本期基金份额交易产生的变动数	49,553,331.50	5,025,073.56	54,578,405.06
其中：基金申购款	97,672,707.38	10,157,877.68	107,830,585.06
基金赎回款	-48,119,375.88	-5,132,804.12	-53,252,180.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	135,535,448.45	15,683,609.60	151,219,058.05

#### 7.4.7.10.2 淳厚信泽C

单位：人民币元

项目 (淳厚信泽C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	19,809,126.93	2,355,438.55	22,164,565.48
本期利润	14,822,287.03	3,060,911.71	17,883,198.74
本期基金份额交易产生的变动数	7,359,351.34	-458,082.10	6,901,269.24
其中：基金申购款	58,726,701.06	6,113,628.16	64,840,329.22
基金赎回款	-51,367,349.72	-6,571,710.26	-57,939,059.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	41,990,765.30	4,958,268.16	46,949,033.46

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	222,513.16	43,546.50
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	276,188.67	183,908.44
结算备付金利息收入	-21.87	98,837.36
其他	-	-
合计	498,679.96	326,292.30

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	1,276,159,743.26	978,487,647.52
减：卖出股票成本总额	1,214,428,475.18	907,827,269.24
买卖股票差价收入	61,731,268.08	70,660,378.28

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	174,662.58	8,723,564.74
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	174,662.58	8,723,564.74

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑	127,002,161.62	188,390,599.81

付) 成交总额		
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	126,252,369.96	179,400,120.46
减: 应收利息总额	575,129.08	266,914.61
买卖债券差价收入	174,662.58	8,723,564.74

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 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。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,367,969.33	2,028,753.50
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	2,367,969.33	2,028,753.50

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日
1. 交易性金融资产	8,573,362.44	-8,061,091.62
——股票投资	7,763,135.35	-6,957,032.44
——债券投资	810,227.09	-1,104,059.18
——资产支持证券投资	-	-
——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	8,573,362.44	-8,061,091.62

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	549,472.45	191,931.20
合计	549,472.45	191,931.20

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	3,621,718.44	2,671,383.82
银行间市场交易费用	1,200.00	-
合计	3,622,918.44	2,671,383.82

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	28,000.00	38,344.44

信息披露费	120,000.00	220,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	27,400.00	18,000.00
其他	600.00	-
开户费	-	800.00
合计	176,000.00	277,144.44

#### 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，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
邢媛	基金管理人股东
柳志伟	基金管理人股东
李雄厚	基金管理人股东
李文忠	基金管理人股东
董卫军	基金管理人股东
聂日明	基金管理人股东
淳厚基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信证券股份有限公司	基金托管人、证券经纪服务商、基金销售机构

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券股份有限公司	1,005,122,870.34	38.21%	1,766,224,415.22	99.33%

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券股份有限公司	66,002,993.42	77.34%	312,895,742.75	100.00%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

中信证券 股份有限 公司	446,800,000.00	47.70%	25,200,000.00	100.00%
--------------------	----------------	--------	---------------	---------

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信证券 股份有限 公司	737,303.84	39.11%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信证券 股份有限 公司	1,319,016.88	99.31%	-	-

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,632,645.51	3,269,012.02
其中：支付销售机构的客户维护费	885,463.20	515,119.62

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数；

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目；

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	617,686.06	435,868.23

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计提，按月支付。其计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	淳厚信泽A	淳厚信泽C	合计
淳厚基金管理有限公司	0.00	146,784.61	146,784.61
中信证券股份有限公司	0.00	210,033.40	210,033.40
合计	0.00	356,818.01	356,818.01
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	淳厚信泽A	淳厚信泽C	合计
淳厚基金管理有限公司	0.00	282,929.71	282,929.71
中信证券股份有限公司	0.00	103,495.54	103,495.54
合计	0.00	386,425.25	386,425.25

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金资产净值0.50%的年费率计提，每日计提，按月支付给注册登记机构，再由注册登记机构代付给销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。C类基金销售服务费的计算公式为：C类基金份额的每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生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 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

淳厚信泽A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	10,002,600.00	10,002,600.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	3,282,600.00	0.00
报告期末持有的基金份额	6,720,000.00	10,002,600.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.90%	10.71%

淳厚信泽C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
----	-----------------------------------	--

报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

- 注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。  
 2、本基金管理人运用固有资金申赎（包含转换）本基金所适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。  
 3、报告期末持有的基金份额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。

#### 7.4.10.4.2 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

份额单位：份

##### 淳厚信泽A

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
李雄厚	1,067,992.67	0.62%	1,476,667.06	1.58%
邢媛	1,001,125.51	0.58%	1,057,050.66	1.13%
董卫军	9,690.76	0.01%	21,275.60	0.02%

##### 淳厚信泽C

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
邢媛	0.00	0.00%	50,018.00	0.12%
董卫军	90.94	0.00%	90.94	0.00%

注：1、上表展示的比例系四舍五入后的结果。

2、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合基金合同、招募说明书及相关公告的规定。

3、报告期末持有的基金份额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。

#### 7.4.10.5 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01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券股份有限公司	34,604,013.84	222,513.16	980,668.14	43,546.50

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中信证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、中信证券股份有限公司为本基金的证券经纪商。截至2021年12月31日本基金存放于中信证券股份有限公司基金专用证券资金账户的余额为21,332,916.97元，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信证券股份有限公司	300930.SZ	屹通新材	首次公开发行股票	3,220	42,214.20
中信证券股份有限公司	688607.SH	康众医疗	首次公开发行股票	1,890	43,866.90
中信证券股份有限公司	600916.SH	中国黄金	首次公开发行股票	3,371	16,821.29

中信证券股份有限公司	605060. SH	联德股份	首次公开发行股票	883	13,765.97
中信证券股份有限公司	688079. SH	美迪凯	首次公开发行股票	3,319	33,820.61
中信证券股份有限公司	003040. SZ	楚天龙	首次公开发行股票	1,101	5,086.62
中信证券股份有限公司	601279. SH	英利汽车	首次公开发行股票	2,004	4,148.28
中信证券股份有限公司	605488. SH	福莱新材	首次公开发行股票	416	8,498.88
中信证券股份有限公司	603529. SH	爱玛科技	首次公开发行股票	793	22,092.98
中信证券股份有限公司	688690. SH	纳微科技	首次公开发行股票	3,477	28,059.39
中信证券股份有限公司	688276. SH	百克生物	首次公开发行股票	1,474	53,579.90
中信证券股份有限公司	001208. SZ	华菱线缆	首次公开发行股票	1,754	6,437.18
中信证券股份有限公司	688425. SH	铁建重工	首次公开发行股票	17,393	49,917.91
中信证券股份有限公司	688226. SH	威腾电气	首次公开发行股票	2,693	17,289.06
中信证券股份有限公司	605020. SH	永和股份	首次公开发行股票	850	5,890.50
中信证券股份有限公司	688305. SH	科德数控	首次公开发行股票	1,496	16,500.88
中信证券股份有限公司	301028. SZ	东亚机械	首次公开发行股票	7,329	38,916.99
中信证券股份有限公司	601825. SH	沪农商行	首次公开发行股票	15,480	137,772.00
中信证券股份有限公司	688071. SH	华依科技	首次公开发行股票	1,101	15,116.73
中信证券股份有限公司	688509. SH	正元地信	首次公开发	15,433	30,403.01

限公司			行股票		
中信证券股份有限公司	688670.SH	金迪克	首次公开发行股票	1,724	95,130.32
中信证券股份有限公司	688779.SH	长远锂科	首次公开发行股票	12,310	69,551.50
中信证券股份有限公司	688766.SH	普冉股份	首次公开发行股票	469	69,834.10
中信证券股份有限公司	301049.SZ	超越科技	首次公开发行股票	1,954	37,790.36
中信证券股份有限公司	688776.SH	国光电气	首次公开发行股票	1,447	74,433.68
中信证券股份有限公司	301053.SZ	远信工业	首次公开发行股票	1,544	18,327.28
中信证券股份有限公司	301055.SZ	张小泉	首次公开发行股票	3,541	24,432.90
中信证券股份有限公司	605599.SH	莱百股份	首次公开发行股票	980	9,800.00
中信证券股份有限公司	688187.SH	时代电气	首次公开发行股票	4,515	141,680.70
中信证券股份有限公司	301059.SZ	金三江	首次公开发行股票	2,581	20,880.29
中信证券股份有限公司	600955.SH	维远股份	首次公开发行股票	1,694	50,074.64
中信证券股份有限公司	301062.SZ	上海艾录	首次公开发行股票	5,225	17,294.75
中信证券股份有限公司	001219.SZ	青岛食品	首次公开发行股票	272	4,678.40
中信证券股份有限公司	605555.SH	德昌股份	首次公开发行股票	655	21,189.25
中信证券股份有限公司	605566.SH	福莱蒾特	首次公开发行股票	435	14,011.35
中信证券股份有限公司	605138.SH	盛泰集团	首次公开发行股票	723	7,208.31

中信证券股份有限公司	688739.SH	成大生物	首次公开发行股票	2,100	231,000.00
中信证券股份有限公司	600935.SH	华塑股份	首次公开发行股票	4,811	18,955.34
中信证券股份有限公司	603071.SH	物产环能	首次公开发行股票	1,627	25,088.34
中信证券股份有限公司	688176.SH	亚虹医药	首次公开发行股票	10,854	249,424.92
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信证券股份有限公司	688500.SH	慧辰资讯	首次公开发行股票	2,784	95,240.64
中信证券股份有限公司	688256.SH	寒武纪	首次公开发行股票	1,999	128,715.61
中信证券股份有限公司	688336.SH	三生国健	首次公开发行股票	3,969	111,846.42
中信证券股份有限公司	688418.SH	震有科技	首次公开发行股票	4,854	78,877.50
中信证券股份有限公司	688586.SH	江航装备	首次公开发行股票	9,708	99,701.16
中信证券股份有限公司	605366.SH	宏柏新材	首次公开发行股票	1,588	15,848.24
中信证券股份有限公司	688356.SH	键凯科技	首次公开发行股票	2,190	90,184.20
中信证券股份有限公司	688289.SH	圣湘生物	首次公开发行股票	1,985	100,202.80
中信证券股份有限公司	688513.SH	苑东生物	首次公开发行股票	1,693	75,101.48
中信证券股份有限公司	688559.SH	海目星	首次公开发	4,344	63,248.64

限公司			行股票		
中信证券股份有限公司	688595.SH	芯海科技	首次公开发行股票	3,190	72,795.80
中信证券股份有限公司	300896.SZ	爱美客	首次公开发行股票	804	95,089.08
中信证券股份有限公司	605099.SH	共创草坪	首次公开发行股票	624	9,634.56
中信证券股份有限公司	300898.SZ	熊猫乳品	首次公开发行股票	4,953	53,393.34
中信证券股份有限公司	003015.SZ	日久光电	首次公开发行股票	1,128	7,410.96
中信证券股份有限公司	003018.SZ	金富科技	首次公开发行股票	1,027	9,171.11
中信证券股份有限公司	688777.SH	中控技术	首次公开发行股票	2,172	77,605.56
中信证券股份有限公司	688578.SH	艾力斯	首次公开发行股票	3,168	72,008.64
中信证券股份有限公司	605299.SH	舒华体育	首次公开发行股票	738	5,365.26
中信证券股份有限公司	605179.SH	一鸣食品	首次公开发行股票	939	8,648.19

#### 7.4.10.7 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其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

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	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额	估值总额	
688707	振华新材	2021-09-06	2022-03-14	科创板打新限售	11.75	47.16	8,130	95,527.50	383,410.80	-
688789	宏华数科	2021-07-01	2022-01-10	科创板打新限售	30.28	258.86	1,400	42,392.00	362,404.00	-
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新股未上市	22.98	22.98	10,854	249,424.92	249,424.92	-
688049	炬芯科技	2021-11-22	2022-05-30	科创板打新限售	42.98	51.71	2,898	124,556.04	149,855.58	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301058	中粮工科	2021-09-01	2022-03-09	创业板打新限售	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301127	天源环保	2021-12-23	2022-06-30	创业板打新限售	12.03	17.12	1,348	16,216.44	23,077.76	-
3010	申菱	2021	2022	创业	8.29	26.0	782	6,48	20,3	-

18	环境	-06-28	-01-07	板打 新限 售		6		2.78	78.9 2	
3011 49	隆华 新材	2021 -11- 03	2022 -05- 10	创业 板打 新限 售	10.0 7	16.7 6	1,214	12,2 24.9 8	20,3 46.6 4	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- 02	2022 -02- 14	创业 板打 新限 售	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0 0	-
3010 60	兰卫 医学	2021 -09- 06	2022 -03- 14	创业 板打 新限 售	4.17	30.9 4	587	2,44 7.79	18,1 61.7 8	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业 板打 新限 售	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,9 44.6 0	-
3010 87	可孚 医疗	2021 -10- 15	2022 -04- 25	创业 板打 新限 售	93.0 9	75.3 4	196	18,2 45.6 4	14,7 66.6 4	-
3011 68	通灵 股份	2021 -12- 02	2022 -06- 10	创业 板打 新限 售	39.0 8	52.1 3	279	10,9 03.3 2	14,5 44.2 7	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板打 新限 售	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,2 07.1 0	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限	10.4 8	36.6 8	379	3,97 1.92	13,9 01.7 2	-

				售						
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	创业板打新限售	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	创业板打新限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	66.18	56.62	218	14,427.24	12,343.16	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	86.06	94.50	127	10,929.62	12,001.50	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	创业板打新限售	29.28	32.00	347	10,160.16	11,104.00	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	创业板打新限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
3011	泽宇	2021	2022	创业	43.9	50.7	208	9,14	10,5	-

79	智能	-12-01	-06-08	板打新限售	9	7		9.92	60.16	
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	58.08	49.85	205	11,906.40	10,219.25	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	创业板打新限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	创业板打新限售	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	36.31	35.52	265	9,622.15	9,412.80	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	创业板打新限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	创业板打新限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	创业板打新限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-

				售						
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-03-01	创业板打新限售	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	创业板打新限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板打新限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	创业板打新限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	创业板打新限售	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	创业板打新限售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板打新限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
3010	新柴	2021	2022	创业	4.97	12.5	513	2,54	6,41	-

32	股份	-07-15	-01-24	板打新限售		1		9.61	7.63	
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板打新限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板打新限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业板打新限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板打新限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板打新限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板打新限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	创业板打新限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-

3010 27	华蓝 集团	2021 -07- 08	2022 -01- 19	创业 板打 新限 售	11.4 5	16.6 5	286	3,27 4.70	4,76 1.90	-
3010 37	保立 佳	2021 -07- 21	2022 -02- 07	创业 板打 新限 售	14.8 2	24.2 6	193	2,86 0.26	4,68 2.18	-
3010 73	君亭 酒店	2021 -09- 22	2022 -03- 30	创业 板打 新限 售	12.2 4	32.0 0	144	1,76 2.56	4,60 8.00	-
3010 53	远信 工业	2021 -08- 25	2022 -03- 01	创业 板打 新限 售	11.8 7	28.7 8	155	1,83 9.85	4,46 0.90	-
3010 57	汇隆 新材	2021 -08- 31	2022 -03- 09	创业 板打 新限 售	8.03	19.0 2	218	1,75 0.54	4,14 6.36	-
3010 68	大地 海洋	2021 -09- 16	2022 -03- 28	创业 板打 新限 售	13.9 8	28.3 8	144	2,01 3.12	4,08 6.72	-

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 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2021年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的托管行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2021年12月31日	2020年12月31日
AAA	4,223,600.00	8,196,500.00
AAA以下	4,204,500.00	3,433,844.00
未评级	-	-
合计	8,428,100.00	11,630,344.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、地方政府债、政策性金融债、央行票据。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时关于未来现金流的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2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	69,930,777.57	-	-	-	69,930,777.57
结算备付金	3,554.53	-	-	-	3,554.53
交易性金融资产	22,004,400.00	-	8,428,100.00	324,936,306.54	355,368,806.54
应收利息	-	-	-	537,705.72	537,705.72
资产总计	91,938,732.10	-	8,428,100.00	325,474,012.26	425,840,844.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	521,615.92	521,615.92
应付托管费	-	-	-	69,548.79	69,548.79
应付销售服务费	-	-	-	43,620.94	43,620.94
应付交易费用	-	-	-	800.00	800.00
应交税费	-	-	-	16.20	16.20
其他负债	-	-	-	148,000.00	148,000.00
负债总计	-	-	-	783,601.85	783,601.85
利率敏感	91,938,732.10	-	8,428,100.00	324,690,410.41	425,057,242.51

度缺口					
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	39,433,403.60	-	-	-	39,433,403.60
交易性金融资产	-	8,196,500.00	3,433,844.00	158,185,239.77	169,815,583.77
应收利息	-	-	-	18,541.42	18,541.42
应收申购款	-	-	-	32,561.06	32,561.06
资产总计	39,433,403.60	8,196,500.00	3,433,844.00	158,236,342.25	209,300,089.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	875,432.54	875,432.54
应付管理人报酬	-	-	-	285,135.37	285,135.37
应付托管费	-	-	-	38,018.04	38,018.04
应付销售服务费	-	-	-	34,885.02	34,885.02
应交税费	-	-	-	168.95	168.95
其他负债	-	-	-	158,770.02	158,770.02
负债总计	-	-	-	1,392,409.94	1,392,409.94
利率敏感度缺口	39,433,403.60	8,196,500.00	3,433,844.00	156,843,932.31	207,907,679.91

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的情况下，利率发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值可参考的公允价值产生的影响。本基金于本报告期末未持有债券投资或持有的债券投资占比并不重大，因而市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	31,568,729.70	-	31,568,729.70
资产合计	-	31,568,729.70	-	31,568,729.70
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	31,568,729.70	-	31,568,729.70
项目	上年度末 2020年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	33,233,838.68	-	33,233,838.68
资产合计	-	33,233,838.68	-	33,233,838.68
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	33,233,838.68	-	33,233,838.68

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有港币均相对人民币升值5%	1,578,436.49	1,661,691.93
	所有港币均相对人民币贬值5%	-1,578,436.49	-1,661,691.93

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

##### 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	324,936,306.54	76.45	158,185,239.77	76.08
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	30,432,500.00	7.16	11,630,344.00	5.59
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	355,368,806.54	83.60	169,815,583.77	81.68

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、估测组合市场价格风险的敏感性为考察业绩比较基准变动时，因股票资产变动导致对基金资产净值的影响金额；		
	2、假定业绩比较基准变化5%，其他市场变量不变；		
	3、Beta系数是根据组合在过去一个年度的净值数据和业绩比较基准数据回归得出，对于成立不足一年的组合，取自成立以来的数据计算。		
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
	业绩比较基准上升5%	25,123,379.49	15,009,157.85
	业绩比较基准下降5%	-25,123,379.49	-15,009,157.85

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

##### ① 金融工具公允价值计量的方法

本基金以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债，其公允价值计量基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，被划分为三个层次：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

② 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币331,632,748.86元，属于第二层次的余额为人民币23,736,057.68元，无第三层次余额(2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币167,792,464.50元，属于第二层次的余额为人民币2,023,119.27元，无第三层次余额)。

③ 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转换。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	324,936,306.54	76.30
	其中：股票	324,936,306.54	76.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,432,500.00	7.15
	其中：债券	30,432,500.00	7.15
	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	69,934,332.10	16.42
8	其他各项资产	537,705.72	0.13
9	合计	425,840,844.36	100.00

注：权益投资中通过港股机制的公允价值为31,568,729.70元，占基金总资产比例为7.41%。

## 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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	219,131,124.63	51.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,802,500.00	4.89
E	建筑业	8,488,713.80	2.00
F	批发和零售业	21,179.34	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,984,760.16	2.35
J	金融业	24,220,040.00	5.70
K	房地产业	10,459,000.00	2.46
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	146,650.07	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	44,429.47	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.01
S	综合	-	-
	合计	293,367,576.84	69.02

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例 (%)
日常消费品	15,518,048.00	3.65
地产业	16,050,681.70	3.78
合计	31,568,729.70	7.43

注:以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 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	H00168	青岛啤酒股份	260,000	15,518,048.00	3.65
2	000921	海信家电	950,000	14,392,500.00	3.39
3	688300	联瑞新材	125,000	13,858,750.00	3.26
4	600887	伊利股份	300,000	12,438,000.00	2.93
5	000623	吉林敖东	650,000	12,005,500.00	2.82
6	300033	同花顺	78,000	11,277,240.00	2.65
7	600885	宏发股份	150,000	11,196,000.00	2.63
8	600886	国投电力	950,000	10,896,500.00	2.56
9	600036	招商银行	220,000	10,716,200.00	2.52
10	300286	安科瑞	319,300	10,594,374.00	2.49
11	300358	楚天科技	400,000	10,428,000.00	2.45
12	601877	正泰电器	160,000	8,622,400.00	2.03
13	002879	长缆科技	364,500	8,602,200.00	2.02
14	601669	中国电建	1,050,000	8,484,000.00	2.00
15	600587	新华医疗	262,500	8,452,500.00	1.99
16	002223	鱼跃医疗	220,000	8,316,000.00	1.96

17	002026	山东威达	420,000	7,732,200.00	1.82
18	300360	炬华科技	620,000	7,650,800.00	1.80
19	000733	振华科技	60,000	7,456,800.00	1.75
20	001914	招商积余	350,000	7,091,000.00	1.67
21	603369	今世缘	130,000	7,072,000.00	1.66
22	600580	卧龙电驱	380,000	6,950,200.00	1.64
23	600171	上海贝岭	250,000	6,415,000.00	1.51
24	000791	甘肃电投	900,000	6,156,000.00	1.45
25	H01755	新城悦服务	672,000	6,142,596.10	1.45
26	600406	国电南瑞	140,000	5,604,200.00	1.32
27	H06049	保利物业	110,000	5,513,076.80	1.30
28	600521	华海药业	251,100	5,438,826.00	1.28
29	603158	腾龙股份	310,000	5,115,000.00	1.20
30	002080	中材科技	150,002	5,103,068.04	1.20
31	600459	贵研铂业	200,000	5,090,000.00	1.20
32	000792	盐湖股份	140,000	4,954,600.00	1.17
33	002028	思源电气	100,000	4,921,000.00	1.16
34	002415	海康威视	90,000	4,708,800.00	1.11
35	H02669	中海物业	650,000	4,395,008.80	1.03
36	600131	国网信通	200,000	4,370,000.00	1.03
37	603279	景津装备	90,000	4,174,200.00	0.98
38	002384	东山精密	150,000	4,065,000.00	0.96
39	600674	川投能源	300,000	3,750,000.00	0.88
40	688093	世华科技	100,000	3,730,000.00	0.88
41	600750	江中药业	250,000	3,612,500.00	0.85
42	603506	南都物业	200,000	3,368,000.00	0.79
43	600660	福耀玻璃	60,000	2,828,400.00	0.67
44	300059	东方财富	60,000	2,226,600.00	0.52
45	688308	欧科亿	20,000	1,413,600.00	0.33
46	688707	振华新材	8,130	383,410.80	0.09
47	688789	宏华数科	1,400	362,404.00	0.09

48	688176	亚虹医药	10,854	249,424.92	0.06
49	688700	东威科技	3,049	207,636.90	0.05
50	688049	炬芯科技	2,898	149,855.58	0.04
51	688265	南模生物	1,385	97,019.25	0.02
52	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
53	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
54	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
55	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
56	301127	天源环保	1,348	23,077.76	0.01
57	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
58	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
59	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
60	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
61	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
62	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
63	301087	可孚医疗	196	14,766.64	0.00
64	301168	通灵股份	279	14,544.27	0.00
65	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
66	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
67	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
68	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
69	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
70	301189	奥尼电子	218	12,343.16	0.00
71	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
72	301166	优宁维	127	12,001.50	0.00
73	301199	迈赫股份	347	11,104.00	0.00
74	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
75	301179	泽宇智能	208	10,560.16	0.00
76	301093	华兰股份	205	10,219.25	0.00
77	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
78	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00

79	301092	争光股份	265	9,412.80	0.00
80	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
81	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
82	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
83	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
84	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
85	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
86	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
87	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
88	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
89	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
90	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
91	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
92	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
93	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
94	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
95	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
96	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
97	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
98	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
99	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
100	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
101	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
102	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
103	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
104	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
105	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
106	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
107	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
108	688103	国力股份	10	696.70	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	000623	吉林敖东	23,724,393.20	11.41
2	300358	楚天科技	22,880,845.00	11.01
3	600036	招商银行	20,246,530.00	9.74
4	H01755	新城悦服务	16,390,046.21	7.88
5	000733	振华科技	15,182,584.00	7.30
6	002585	双星新材	14,509,064.70	6.98
7	688596	正帆科技	14,375,750.88	6.91
8	600171	上海贝岭	14,037,470.00	6.75
9	002466	天齐锂业	13,619,965.25	6.55
10	600587	新华医疗	13,542,454.29	6.51
11	603155	新亚强	13,257,678.60	6.38
12	002415	海康威视	13,237,268.88	6.37
13	688300	联瑞新材	13,187,316.66	6.34
14	688093	世华科技	13,184,006.40	6.34
15	002080	中材科技	12,482,440.05	6.00
16	600886	国投电力	12,479,406.00	6.00
17	000791	甘肃电投	12,418,230.20	5.97
18	300395	菲利华	11,949,971.00	5.75
19	H00168	青岛啤酒股份	11,836,965.32	5.69
20	603444	吉比特	11,780,549.00	5.67
21	H06098	碧桂园服务	11,720,979.00	5.64
22	688006	杭可科技	11,586,760.85	5.57
23	600885	宏发股份	11,479,402.00	5.52

24	300033	同花顺	11,360,264.31	5.46
25	002241	歌尔股份	10,733,664.63	5.16
26	000333	美的集团	10,715,992.00	5.15
27	600887	伊利股份	10,715,190.60	5.15
28	603369	今世缘	10,522,811.00	5.06
29	600674	川投能源	10,520,011.00	5.06
30	600048	保利发展	10,024,938.00	4.82
31	600519	贵州茅台	10,021,600.73	4.82
32	688007	光峰科技	9,960,169.26	4.79
33	688516	奥特维	9,850,104.61	4.74
34	603606	东方电缆	9,740,420.00	4.68
35	300286	安科瑞	9,663,734.00	4.65
36	003012	东鹏控股	9,598,546.10	4.62
37	000921	海信家电	9,314,122.00	4.48
38	002382	蓝帆医疗	9,252,634.02	4.45
39	300142	沃森生物	9,209,140.00	4.43
40	000519	中兵红箭	9,116,964.00	4.39
41	H06049	保利物业	9,012,646.53	4.33
42	002825	纳尔股份	9,001,076.80	4.33
43	002879	长缆科技	8,946,497.60	4.30
44	002402	和而泰	8,924,808.00	4.29
45	601877	正泰电器	8,902,749.00	4.28
46	002286	保龄宝	8,719,711.00	4.19
47	603259	药明康德	8,685,531.00	4.18
48	600116	三峡水利	8,616,260.00	4.14
49	002026	山东威达	8,425,043.00	4.05
50	300360	炬华科技	8,329,274.00	4.01
51	002046	国机精工	8,326,679.00	4.00
52	601669	中国电建	8,070,681.00	3.88
53	002025	航天电器	8,063,471.00	3.88
54	000739	普洛药业	7,875,643.67	3.79

55	002223	鱼跃医疗	7,805,493.00	3.75
56	603877	太平鸟	7,767,611.00	3.74
57	002270	华明装备	7,544,285.00	3.63
58	600580	卧龙电驱	7,418,527.00	3.57
59	605117	德业股份	7,415,312.98	3.57
60	688005	容百科技	7,321,904.65	3.52
61	002237	恒邦股份	7,310,919.00	3.52
62	H02020	安踏体育	7,213,985.80	3.47
63	300705	九典制药	7,198,747.00	3.46
64	601233	桐昆股份	7,045,155.00	3.39
65	300059	东方财富	7,008,672.56	3.37
66	688388	嘉元科技	6,992,338.78	3.36
67	000792	盐湖股份	6,946,237.00	3.34
68	688026	洁特生物	6,922,351.10	3.33
69	002508	老板电器	6,890,469.00	3.31
70	002129	中环股份	6,855,886.00	3.30
71	H03888	金山软件	6,799,904.11	3.27
72	603158	腾龙股份	6,675,399.00	3.21
73	600486	扬农化工	6,631,459.00	3.19
74	688301	奕瑞科技	6,625,110.76	3.19
75	603501	韦尔股份	6,605,406.96	3.18
76	300171	东富龙	6,553,429.00	3.15
77	000157	中联重科	6,517,070.40	3.13
78	603993	洛阳钼业	6,475,350.61	3.11
79	002230	科大讯飞	6,467,385.20	3.11
80	600298	安琪酵母	6,452,773.00	3.10
81	000301	东方盛虹	6,414,380.04	3.09
82	003028	振邦智能	6,377,056.80	3.07
83	600010	包钢股份	6,351,339.00	3.05
84	300143	盈康生命	6,236,076.62	3.00
85	001914	招商积余	6,153,474.00	2.96

86	600380	健康元	6,080,862.00	2.92
87	601398	工商银行	6,061,892.00	2.92
88	000568	泸州老窖	5,975,750.00	2.87
89	300633	开立医疗	5,965,130.00	2.87
90	002939	长城证券	5,934,946.00	2.85
91	601615	明阳智能	5,925,805.00	2.85
92	600406	国电南瑞	5,912,329.34	2.84
93	002384	东山精密	5,879,740.50	2.83
94	688508	芯朋微	5,876,007.26	2.83
95	H06969	思摩尔国际	5,689,092.33	2.74
96	H01368	特步国际	5,614,112.03	2.70
97	300014	亿纬锂能	5,574,377.00	2.68
98	002028	思源电气	5,555,460.00	2.67
99	600409	三友化工	5,508,721.00	2.65
100	603995	甬金股份	5,470,757.00	2.63
101	000683	远兴能源	5,467,650.00	2.63
102	603298	杭叉集团	5,333,111.35	2.57
103	002311	海大集团	5,326,432.00	2.56
104	600392	盛和资源	5,303,703.00	2.55
105	600459	贵研铂业	5,237,327.00	2.52
106	H00700	腾讯控股	5,225,063.31	2.51
107	H00038	第一拖拉机股份	5,215,550.81	2.51
108	H01347	华虹半导体	5,204,275.39	2.50
109	000049	德赛电池	5,075,344.00	2.44
110	600577	精达股份	5,063,357.58	2.44
111	002088	鲁阳节能	5,040,614.50	2.42
112	002049	紫光国微	4,955,994.00	2.38
113	601636	旗滨集团	4,949,979.00	2.38

114	002594	比亚迪	4,947,760.00	2.38
115	603279	景津装备	4,902,215.00	2.36
116	300850	新强联	4,887,626.20	2.35
117	601618	中国中冶	4,825,763.00	2.32
118	603728	鸣志电器	4,806,316.00	2.31
119	600801	华新水泥	4,736,784.00	2.28
120	002056	横店东磁	4,735,187.80	2.28
121	600660	福耀玻璃	4,699,769.00	2.26
122	H01066	威高股份	4,671,753.61	2.25
123	600690	海尔智家	4,657,147.67	2.24
124	000915	华特达因	4,619,312.00	2.22
125	600131	国网信通	4,578,821.00	2.20
126	002756	永兴材料	4,513,139.34	2.17
127	300354	东华测试	4,470,844.00	2.15
128	H01209	华润万象生活	4,396,260.38	2.11
129	000002	万科A	4,356,360.00	2.10
130	H00981	中芯国际	4,352,708.62	2.09
131	H02669	中海物业	4,337,400.56	2.09
132	601318	中国平安	4,327,219.00	2.08
133	600976	健民集团	4,306,837.48	2.07
134	603639	海利尔	4,274,251.00	2.06
135	603806	福斯特	4,189,170.00	2.01
136	002258	利尔化学	4,188,689.00	2.01
137	002372	伟星新材	4,181,216.00	2.01
138	H02869	绿城服务	4,168,840.02	2.01

注：“本期累计买入金额”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	300171	东富龙	23,037,308.00	11.08
2	002585	双星新材	20,071,811.90	9.65
3	603155	新亚强	17,402,238.60	8.37
4	002466	天齐锂业	15,347,948.00	7.38
5	H06098	碧桂园服务	14,373,698.15	6.91
6	002508	老板电器	14,262,577.00	6.86
7	H03888	金山软件	14,178,607.74	6.82
8	000733	振华科技	14,165,982.00	6.81
9	688596	正帆科技	14,049,164.59	6.76
10	000519	中兵红箭	13,574,603.82	6.53
11	300358	楚天科技	13,553,398.64	6.52
12	002056	横店东磁	13,161,512.80	6.33
13	603444	吉比特	12,614,464.00	6.07
14	600486	扬农化工	12,404,820.00	5.97
15	688516	奥特维	12,252,435.16	5.89
16	688093	世华科技	11,747,984.93	5.65
17	603606	东方电缆	11,682,343.00	5.62
18	300395	菲利华	11,611,710.00	5.59
19	600298	安琪酵母	11,597,526.00	5.58
20	000623	吉林敖东	11,396,849.00	5.48
21	600048	保利发展	10,649,823.00	5.12
22	601818	光大银行	10,618,000.00	5.11
23	688007	光峰科技	10,558,108.24	5.08
24	688006	杭可科技	10,502,395.09	5.05
25	603915	国茂股份	10,323,879.00	4.97
26	600519	贵州茅台	10,259,070.00	4.93
27	003012	东鹏控股	10,239,103.69	4.92
28	002241	歌尔股份	9,916,495.00	4.77

29	688300	联瑞新材	9,673,420.26	4.65
30	688508	芯朋微	9,509,987.98	4.57
31	002025	航天电器	9,462,444.50	4.55
32	000333	美的集团	9,416,881.23	4.53
33	002046	国机精工	9,362,218.00	4.50
34	600741	华域汽车	9,340,218.00	4.49
35	002402	和而泰	9,263,153.00	4.46
36	300142	沃森生物	9,157,177.00	4.40
37	002270	华明装备	8,963,009.00	4.31
38	002382	蓝帆医疗	8,924,453.23	4.29
39	002080	中材科技	8,845,217.99	4.25
40	600036	招商银行	8,795,804.00	4.23
41	000739	普洛药业	8,742,229.00	4.20
42	603259	药明康德	8,608,381.00	4.14
43	002286	保龄宝	8,600,819.00	4.14
44	002825	纳尔股份	8,341,169.00	4.01
45	688301	奕瑞科技	8,258,793.73	3.97
46	600887	伊利股份	8,252,979.00	3.97
47	000683	远兴能源	8,234,673.00	3.96
48	600116	三峡水利	7,777,062.00	3.74
49	600587	新华医疗	7,682,024.36	3.69
50	605117	德业股份	7,389,968.17	3.55
51	002661	克明食品	7,253,382.45	3.49
52	601233	桐昆股份	7,169,697.00	3.45
53	000581	威孚高科	7,106,190.00	3.42
54	600409	三友化工	7,068,964.80	3.40
55	H02020	安踏体育	6,949,681.07	3.34
56	300014	亿纬锂能	6,872,967.00	3.31
57	300705	九典制药	6,781,014.00	3.26
58	688388	嘉元科技	6,741,957.11	3.24
59	600010	包钢股份	6,706,104.00	3.23

60	002237	恒邦股份	6,700,949.00	3.22
61	603501	韦尔股份	6,641,706.00	3.19
62	688005	容百科技	6,631,173.94	3.19
63	300850	新强联	6,614,725.40	3.18
64	002129	中环股份	6,611,783.00	3.18
65	H00168	青岛啤酒 股份	6,524,058.68	3.14
66	H01368	特步国际	6,478,610.07	3.12
67	000049	德赛电池	6,436,410.30	3.10
68	002415	海康威视	6,412,339.00	3.08
69	000157	中联重科	6,388,288.00	3.07
70	603993	洛阳钼业	6,377,971.00	3.07
71	600171	上海贝岭	6,330,175.24	3.04
72	600674	川投能源	6,300,390.00	3.03
73	603298	杭叉集团	6,238,975.40	3.00
74	002088	鲁阳节能	6,171,741.50	2.97
75	603877	太平鸟	6,158,074.00	2.96
76	601398	工商银行	6,078,450.00	2.92
77	601615	明阳智能	6,054,650.00	2.91
78	688026	洁特生物	6,037,426.98	2.90
79	600380	健康元	5,782,499.00	2.78
80	002939	长城证券	5,735,144.48	2.76
81	000791	甘肃电投	5,730,529.00	2.76
82	601636	旗滨集团	5,726,937.00	2.75
83	603728	鸣志电器	5,708,137.00	2.75
84	003028	振邦智能	5,640,253.77	2.71
85	002340	格林美	5,627,654.73	2.71
86	600577	精达股份	5,611,742.00	2.70
87	002230	科大讯飞	5,567,194.00	2.68
88	300059	东方财富	5,524,040.83	2.66
89	000568	泸州老窖	5,475,367.00	2.63

90	002049	紫光国微	5,472,670.00	2.63
91	603659	璞泰来	5,331,583.00	2.56
92	H01347	华虹半导体	5,328,023.10	2.56
93	603995	甬金股份	5,270,927.85	2.54
94	002311	海大集团	5,254,558.76	2.53
95	002068	黑猫股份	5,225,332.00	2.51
96	H06969	思摩尔国际	5,210,585.29	2.51
97	000301	东方盛虹	5,133,515.00	2.47
98	300633	开立医疗	5,113,688.00	2.46
99	002756	永兴材料	5,101,726.00	2.45
100	300354	东华测试	4,950,414.00	2.38
101	600703	三安光电	4,866,633.00	2.34
102	600392	盛和资源	4,705,968.00	2.26
103	600690	海尔智家	4,669,098.00	2.25
104	H00038	第一拖拉机股份	4,627,095.48	2.23
105	300450	先导智能	4,553,597.00	2.19
106	000002	万科A	4,544,483.00	2.19
107	300143	盈康生命	4,539,860.00	2.18
108	H00700	腾讯控股	4,533,316.35	2.18
109	600782	新钢股份	4,435,440.00	2.13
110	688580	伟思医疗	4,426,797.83	2.13
111	H06049	保利物业	4,398,925.37	2.12
112	300973	立高食品	4,372,670.00	2.10
113	002594	比亚迪	4,326,441.00	2.08
114	000921	海信家电	4,235,060.00	2.04
115	000915	华特达因	4,195,409.00	2.02

注：“本期累计卖出金额”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	1,373,416,406.60
卖出股票收入（成交）总额	1,276,159,743.26

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”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	22,004,400.00	5.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	8,428,100.00	1.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,432,500.00	7.16

### 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	019649	21国债01	220,000	22,004,400.00	5.18
2	113042	上银转债	40,000	4,223,600.00	0.99

3	123111	东财转3	25,000	4,204,500.00	0.99
---	--------	------	--------	--------------	------

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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收到公开谴责、处罚的情形

本基金投资前十大证券中招商银行的发行人招商银行股份有限公司于2021年5月17日因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则被中国银行保险监督管理委员会处以罚款7170万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 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

基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	537,705.72
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	537,705.72

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113042	上银转债	4,223,600.00	0.99
2	123111	东财转3	4,204,500.00	0.99

#### 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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
淳厚信泽A	2,054	83,800.35	90,731,476.79	52.71%	81,394,440.67	47.29%
淳厚	1,36	40,002.36	21,136,238.56	38.6	33,626,994.98	61.40%

信泽C	9			0%		
合计	3,423	66,283.71	111,867,715.35	49.31%	115,021,435.65	50.69%

注：分级基金机构/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	淳厚信泽A	3,725,726.15	2.16%
	淳厚信泽C	30,037.31	0.05%
	合计	3,755,763.46	1.66%

注：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）。上表展示的比例系四舍五入后的结果。

## 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	淳厚信泽A	>100
	淳厚信泽C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	淳厚信泽A	>100
	淳厚信泽C	0
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	淳厚信泽A	淳厚信泽C
基金合同生效日(2019年08月21日)基金份额总额	228,318,882.81	273,047,445.96
本报告期期初基金份额总额	93,391,770.35	42,837,577.58

本报告期基金总申购份额	151,808,791.70	95,232,299.84
减：本报告期基金总赎回份额	73,074,644.59	83,306,643.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	172,125,917.46	54,763,233.54

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：

本基金管理人本报告期内未发生重大人事变动；

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响公司经营或基金运营业务的诉讼。本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

本基金自合同生效日起聘请上会会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本报告期内应付未付的审计费用为人民币 28,000.00 元整。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	142,047,792.62	5.40%	106,408.04	5.64%	-
广发证券	2	1,483,396,150.15	56.39%	1,041,428.19	55.24%	-
中信证券	2	1,005,122,870.34	38.21%	737,303.84	39.11%	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	13,252,290.52	15.53%	51,900,000.00	5.54%	-	-	-	-
广发证券	6,089,532.25	7.14%	438,000,000.00	46.76%	-	-	-	-
中信证券	66,002,993.42	77.34%	446,800,000.00	47.70%	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位。

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

### 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	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金2020年第四季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-21
2	淳厚基金管理有限公司旗下部分基金季度报告提示性公告	《上海证券报》	2021-01-21
3	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-22
4	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-26
5	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-30
6	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-02-24
7	淳厚基金管理有限公司关于在销售机构开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-10
8	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-12
9	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-03-18
10	淳厚信泽灵活配置混合型证	基金管理人网站及中国证监	2021-03-20

	券投资基金招募说明书更新 (2021年第1期)	会基金电子披露网站	
11	淳厚信泽灵活配置混合型证 券投资基金基金产品资料概 要更新	基金管理人网站及中国证监 会基金电子披露网站	2021-03-20
12	淳厚信泽灵活配置混合型证 券投资基金2020年年度报告	基金管理人网站及中国证监 会基金电子披露网站	2021-03-30
13	淳厚基金管理有限公司旗下 部分基金2020年年度报告提 示性公告	《上海证券报》	2021-03-30
14	淳厚基金管理有限公司关于 旗下淳厚信泽灵活配置混合 型证券投资基金重大关联交 易事项的公告	《上海证券报》、基金管理 人网站及中国证监会基金电 子披露网站	2021-04-08
15	淳厚信泽灵活配置混合型证 券投资基金2021年第一季度 报告	基金管理人网站及中国证监 会基金电子披露网站	2021-04-21
16	淳厚基金管理有限公司旗下 基金2021年1季度报告提示 性公告	《上海证券报》	2021-04-21
17	淳厚基金管理有限公司关于 旗下淳厚信泽灵活配置混合 型证券投资基金重大关联交 易事项的公告	《上海证券报》、基金管理 人网站及中国证监会基金电 子披露网站	2021-05-07
18	淳厚基金管理有限公司关于 旗下淳厚信泽灵活配置混合 型证券投资基金重大关联交 易事项的公告	《上海证券报》、基金管理 人网站及中国证监会基金电 子披露网站	2021-06-08
19	淳厚基金管理有限公司关于 旗下淳厚信泽灵活配置混合 型证券投资基金重大关联交 易事项的公告	《上海证券报》、基金管理 人网站及中国证监会基金电 子披露网站	2021-06-16
20	淳厚基金管理有限公司关于	《上海证券报》、基金管理	2021-06-18

	旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
21	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-06-29
22	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-03
23	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-06
24	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-13
25	淳厚基金管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告提示性公告	《上海证券报》	2021-07-20
26	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金2021年第二季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-20
27	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-23
28	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
29	淳厚基金管理有限公司关于	《上海证券报》、基金管理	2021-08-04

	旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
30	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-07
31	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-13
32	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-18
33	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-25
34	淳厚基金管理有限公司关于基金产品风险等级划分结果的更新公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-25
35	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-27
36	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金2021年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-30
37	淳厚基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告提示性公告	《上海证券报》	2021-08-30
38	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-08-31

	易事项的公告		
39	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-04
40	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-08
41	淳厚基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-09-14
42	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-12
43	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-14
44	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-22
45	淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金2021年第三季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-10-27
46	淳厚基金管理有限公司旗下部分基金2021年第三季度报告提示性公告	《上海证券报》	2021-10-27
47	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-11-20

	易事项的公告		
48	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-09
49	淳厚基金关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-28
50	淳厚基金管理有限公司关于旗下部分基金2021年底及2022年非港股通交易日暂停申购、赎回等业务的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-28
51	淳厚基金管理有限公司关于旗下淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金重大关联交易事项的公告	《上海证券报》、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-30

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

无。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立淳厚基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 3、《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4、《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、《淳厚信泽灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

淳厚基金管理有限公司

地址：上海市浦东新区丁香路778号丁香国际西塔7楼

### 13.3 查阅方式

上述文件可在淳厚基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到淳厚基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人淳厚基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-000-9738

网址：<http://www.purekindfund.com/>

淳厚基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日