

信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金

8.1 累计次买入金额超过当期净资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	600633	福耀玻璃	67,617,873.40	2.72			
2	600230	杭华集团	54,068,155.06	2.17			
3	600104	上汽集团	36,375,329.40	1.46			
4	600676	东方电气	36,321,097.24	1.42			
5	600016	民生银行	35,109,255.62	1.42			
6	000083	西山煤电	30,199,176.19	1.24			
7	000831	五矿稀土	30,246,157.48	1.22			
8	002742	宁波银行	30,231,929.56	1.22			
9	002739	中航光电	29,868,356.23	1.20			
10	000000	中金岭南	29,423,513.57	1.18			
11	601919	国投新集	20,051,047.26	0.81			
12	600005	宝钢股份	18,969,549.59	0.76			
13	600006	上海机场	16,463,322.27	0.66			
14	000051	格力电器	10,388,194.02	0.42			
15	603019	中科曙光	9,796,389.10	0.39			
16	600547	山东黄金	7,428,117.00	0.30			
17	002262	惠华药业	7,233,446.00	0.29			
18	601092	金隅股份	6,381,352.66	0.26			
19	600029	中国神华	6,710,580.84	0.28			
20	600436	中航高科	4,609,364.08	0.19			
注：买入金额按照成交金额或成交净资产净值及成交数量填列，不考虑相关交易费用。							
8.2 累计卖出金额超过当期净资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	600633	福耀玻璃	87,303,826.26	2.31			
2	600230	杭华集团	48,352,216.36	1.24			
3	600104	上汽集团	33,567,675.27	1.06			
4	600016	民生银行	31,351,277.38	1.26			
5	600676	东方电气	20,717,180.08	1.24			
6	000083	西山煤电	20,061,242.78	1.17			
7	002742	宁波银行	27,792,572.92	1.12			
8	002739	中航光电	27,441,401.88	1.10			
9	000000	中金岭南	25,354,085.40	1.02			
10	000831	五矿稀土	19,110,388.11	0.77			
11	600006	上海机场	17,557,702.49	0.67			
12	600005	宝钢股份	14,064,732.59	0.51			
13	601919	国投新集	11,156,801.66	0.44			
14	602019	中国神华	10,953,443.70	0.45			
15	000051	格力电器	9,942,800.30	0.40			
16	600547	山东黄金	7,326,292.06	0.29			
17	002262	惠华药业	7,196,219.06	0.28			
18	601092	金隅股份	6,156,716.06	0.26			
19	600027	江苏舜天	5,846,670.70	0.24			
20	600329	中国铝业	5,669,235.00	0.23			
注：卖出金额按照成交金额或成交净资产净值及成交数量填列，不考虑相关交易费用。							
8.3 买入股票成本及卖出股票收入产生的投资收益					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	占期末基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	600633	福耀玻璃	67,617,873.40	2.72			
2	600230	杭华集团	54,068,155.06	2.17			
3	600104	上汽集团	36,375,329.40	1.46			
4	600676	东方电气	36,321,097.24	1.42			
5	600016	民生银行	35,109,255.62	1.42			
6	000083	西山煤电	30,199,176.19	1.24			
7	000831	五矿稀土	30,246,157.48	1.22			
8	002742	宁波银行	30,231,929.56	1.22			
9	002739	中航光电	29,868,356.23	1.20			
10	000000	中金岭南	29,423,513.57	1.18			
11	601919	国投新集	20,051,047.26	0.81			
12	600005	宝钢股份	18,969,549.59	0.76			
13	600006	上海机场	16,463,322.27	0.66			
14	000051	格力电器	10,388,194.02	0.42			
15	603019	中科曙光	9,796,389.10	0.39			
16	600547	山东黄金	7,428,117.00	0.30			
17	002262	惠华药业	7,233,446.00	0.29			
18	601092	金隅股份	6,381,352.66	0.26			
19	600029	中国神华	6,710,580.84	0.28			
20	600436	中航高科	4,609,364.08	0.19			
注：买入金额按照成交金额或成交净资产净值及成交数量填列，不考虑相关交易费用。							
8.4 卖出股票成本及卖出股票收入产生的投资收益					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	占期末基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	600633	福耀玻璃	87,303,826.26	2.31			
2	600230	杭华集团	48,352,216.36	1.24			
3	600104	上汽集团	33,567,675.27	1.06			
4	600016	民生银行	31,351,277.38	1.26			
5	600676	东方电气	20,717,180.08	1.24			
6	000083	西山煤电	20,061,242.78	1.17			
7	002742	宁波银行	27,792,572.92	1.12			
8	002739	中航光电	27,441,401.88	1.10			
9	000000	中金岭南	25,354,085.40	1.02			
10	000831	五矿稀土	19,110,388.11	0.77			
11	600006	上海机场	17,557,702.49	0.67			
12	600005	宝钢股份	14,064,732.59	0.51			
13	601919	国投新集	11,156,801.66	0.44			
14	602019	中国神华	10,953,443.70	0.45			
15	000051	格力电器	9,942,800.30	0.40			
16	600547	山东黄金	7,326,292.06	0.29			
17	002262	惠华药业	7,196,219.06	0.28			
18	601092	金隅股份	6,156,716.06	0.26			
19	600027	江苏舜天	5,846,670.70	0.24			
20	600329	中国铝业	5,669,235.00	0.23			
注：卖出金额按照成交金额或成交净资产净值及成交数量填列，不考虑相关交易费用。							
8.5 期末按品种分类的股票投资组合					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（%）	2022年12月31日	2022年12月31日		
1	国家债券	130,021,000.00	5.23				
2	央行票据	-	-				
3	金融债券	-	-				
4	其中：政策性金融债	-	-				
5	企业债券	17,402,379.00	0.70				
6	企业短期融资券	40,136,000.00	1.61				
7	中期票据	-	-				
8	可转债	2,660,001.80	0.11				
9	其他	-	-				
10	合计	190,301,380.10	7.65				
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（%）	2022年12月31日	2022年12月31日
1	150027	15晋财债02	700,000	70,063,000.00	2.82		
2	150018	15晋财债01	600,000	59,568,000.00	2.41		
3	1514589042	15中安债1	100,000	10,055,000.00	0.40		
4	011599747	15广石02	100,000	10,041,000.00	0.40		
5	011599602	15广石01	100,000	10,038,000.00	0.40		
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名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 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投资情况说明							
8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细							
本基金本报告期末未持有股指期货。							
8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策							
本基金管理人将按照相关法律法规的要求，结合本基金的投资目标、投资策略、风险承受能力，审慎选择投资品种，并制定相应的投资策略。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。							
8.11 报告期末本基金投资的国债期货投资情况说明							
8.11.1 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。							
8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货投资政策							
本基金管理人将按照相关法律法规的要求，结合本基金的投资目标、投资策略、风险承受能力，审慎选择投资品种，并制定相应的投资策略。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。							
8.12 报告期末本基金投资的期权投资情况说明							
8.12.1 报告期末本基金投资的期权持仓和损益明细							
本基金本报告期末未持有期权。							
8.12.2 报告期末本基金投资的期权投资政策							
本基金管理人将按照相关法律法规的要求，结合本基金的投资目标、投资策略、风险承受能力，审慎选择投资品种，并制定相应的投资策略。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。							
8.13 报告期末本基金投资的资产支持证券投资情况说明							
8.13.1 报告期末本基金投资的资产支持证券持仓和损益明细							
本基金本报告期末未持有资产支持证券。							
8.13.2 报告期末本基金投资的资产支持证券投资政策							
本基金管理人将按照相关法律法规的要求，结合本基金的投资目标、投资策略、风险承受能力，审慎选择投资品种，并制定相应的投资策略。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。本基金管理人将根据市场情况，适时调整投资策略，以实现对投资组合的长期增值。							
9. 基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日		
1	存出保证金	4,237,260.04	1.72				
2	应收证券清算款	262,360.00	0.11				
3	应收股利	-	-				
4	应收利息	-	-				
5	应收申购款	2,322,188.30	0.94				
6	其他应收款	-	-				
7	待摊费用	-	-				
8	其他	-	-				
9	合计	4,521,808.34	1.77				
8.12.3 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.4 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.5 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.1 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.6 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.7 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.8 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.2 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.9 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.10 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.11 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.3 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.12 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.13 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.14 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.4 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.15 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.16 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.17 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.5 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.18 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.19 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.20 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.6 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.21 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.22 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.23 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.7 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.24 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.25 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.26 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.8 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.27 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.28 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.29 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.9 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.30 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.31 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.32 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.10 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.33 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.34 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.35 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.11 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.36 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.37 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.38 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.12 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.39 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.40 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.41 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							
本基金本报告期末未持有期权合约。							
9.13 期末基金资产组合情况					单位：人民币元		
序号	股票名称	股票数量	公允价值	占基金资产净值比例（%）	2022年12月31日	2022年12月31日	
1	000002	万科A	750,000.00	0.03			
8.12.42 报告期末本基金持有的股指期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有股指期货合约。							
8.12.43 报告期末本基金持有的国债期货合约投资明细							
本基金本报告期末未持有国债期货合约。							
8.12.44 报告期末本基金持有的期权合约投资明细							