

华商价值精选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：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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更新。

本报告中财务资料经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	14
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56

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	56
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	56
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
8.12 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息.....	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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的情况	58
§10 开放式基金份额变动.....	58
§ 11 重大事件揭示.....	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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	65
§13 备查文件目录.....	65
13.1 备查文件目录	65
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华商价值精选混合型证券投资基金
基金简称	华商价值精选混合
基金主代码	630010
交易代码	630010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 31 日
基金管理人	华商基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	267,939,530.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过深入的基本面研究，精选价值相对被低估、成长性受经济周期波动影响较小的优势企业。在构建和管理投资组合的过程中，从国计民生的长期发展角度，重点布局具有长期发展前景的产业和行业以及经济区域，并根据市场节奏动态优化配置资产组合。具体投资策略详见基金合同。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和风险水平介于股票型基金和债券型基金之间，是属于中高风险、中高收益的基金产品。

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		华商基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	高敏	李申
	联系电话	010-58573600	021-60637102
	电子邮箱	gaom@hsfund.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4007008880	021-60637111
传真		010-58573520	021-60635778
注册地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100035	100033
法定代表人		陈牧原	田国立

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	http://www.hsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	华商基金管理有限公司	北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 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
本期已实现收益	195,332,458.29	314,615,155.58	100,684,032.50
本期利润	78,163,372.08	373,235,143.49	266,327,571.74
加权平均基金份额本期利润	0.2555	0.7446	0.3593
本期加权平均净值利润率	11.85%	46.37%	31.48%
本期基金份额净值增长率	10.83%	56.26%	37.37%
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	325,915,881.76	234,808,776.32	-13,323,643.35
期末可供分配基金份额利润	1.2164	0.6031	-0.0197
期末基金资产净值	600,351,324.84	787,337,107.74	874,837,076.19
期末基金份额净值	2.241	2.022	1.294
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	275.56%	238.85%	116.85%

注：1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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余额的孰低数。

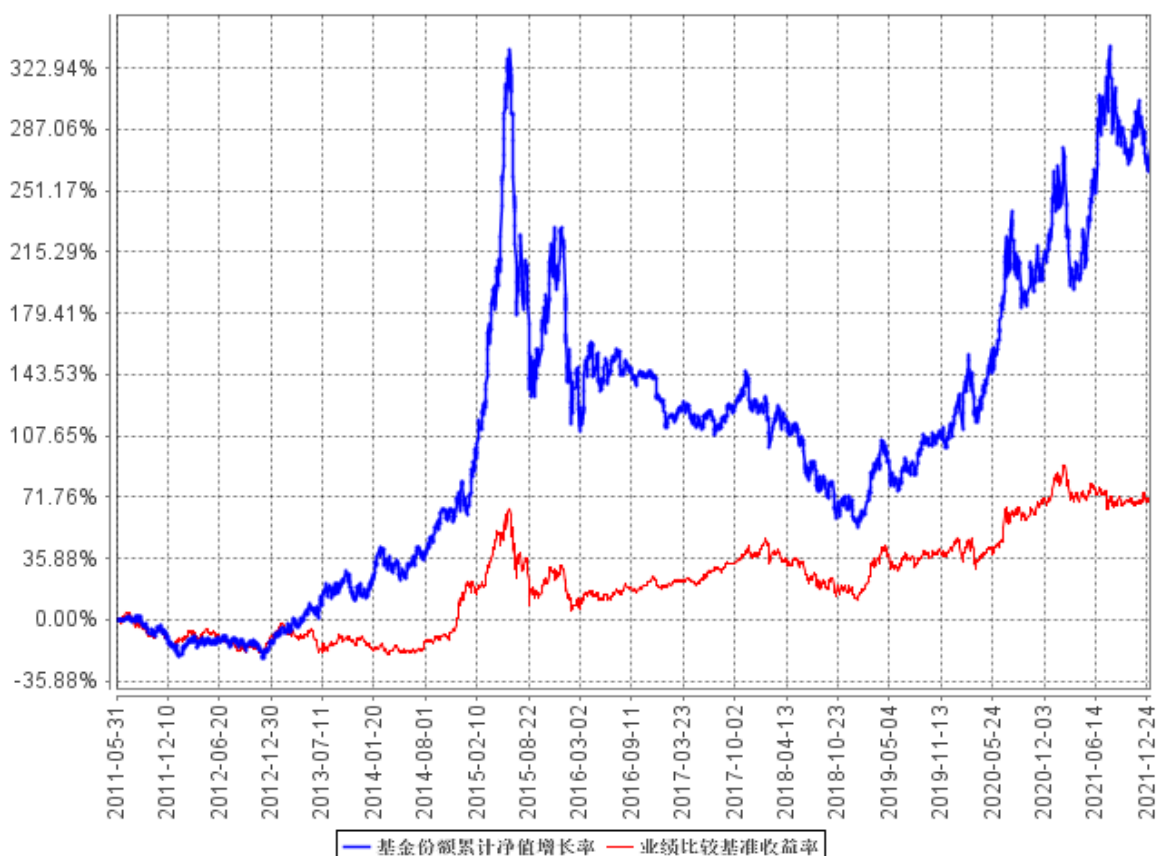
3.2 基金净值表现

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.19%	1.23%	1.43%	0.60%	-2.62%	0.63%
过去六个月	-7.82%	1.61%	-3.38%	0.77%	-4.44%	0.84%
过去一年	10.83%	1.74%	-2.62%	0.88%	13.45%	0.86%
过去三年	137.90%	1.57%	51.14%	0.97%	86.76%	0.60%
过去五年	65.20%	1.40%	43.68%	0.90%	21.52%	0.50%
自基金合同生效起至今	275.56%	1.55%	70.82%	1.07%	204.74%	0.48%

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

基金份额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



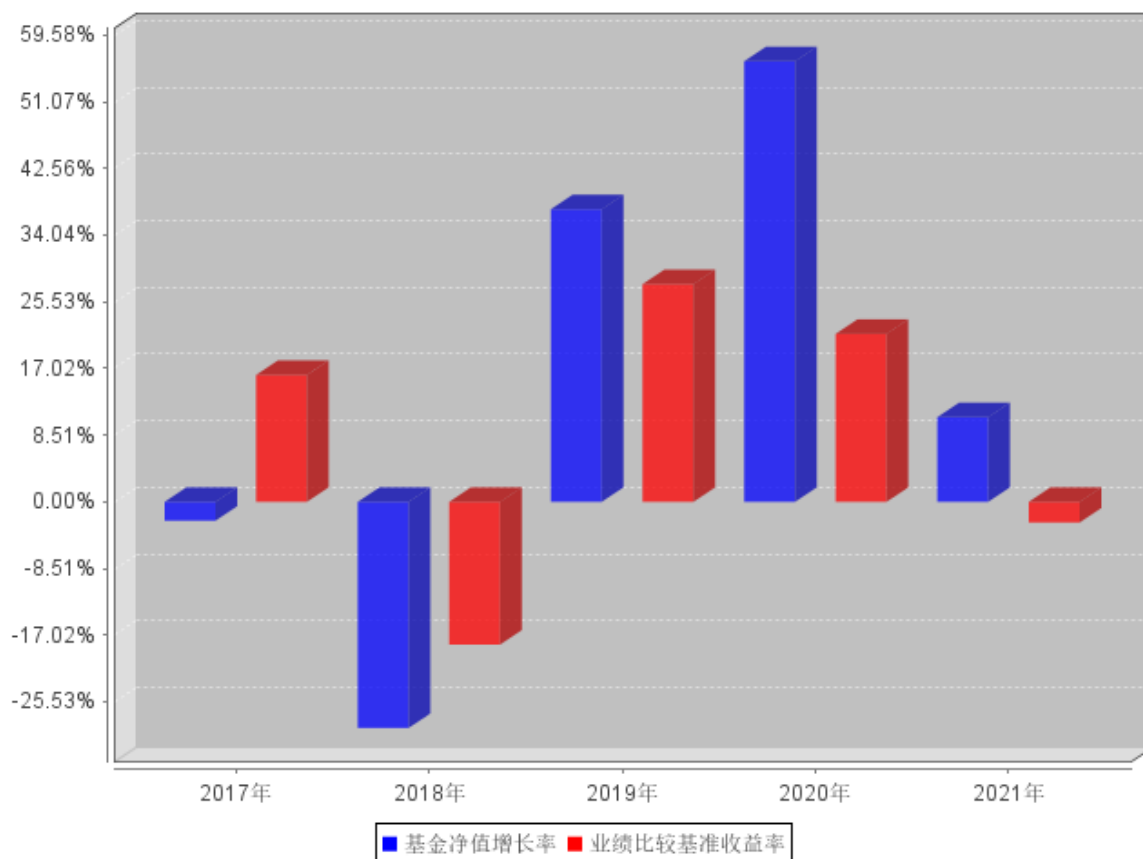
注：①本基金合同生效日为 2011 年 5 月 31 日。

②根据《华商价值精选混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的 A 股股票（包含中小板、创业板、存托凭证及其他

经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金的投资组合比例为:股票(包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的 60%-95%,其中符合本基金定义的价值型股票类资产投资比例不低于股票类资产的 80%;债券投资比例为基金资产的 0%-35%;权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%;并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。根据基金合同的规定,自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时,各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注:本基金合同生效日为 2011 年 5 月 31 日。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

本基金过去三年均未进行利润分配。

§ 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

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160 号文批准设立，成立于 2005 年 12 月 20 日，注册资本为 10000 万元人民币，注册地为北京市，是一家为客户提供专业理财服务的资产管理机构。

本基金管理人拥有公募基金管理业务、私募资产管理业务、受托管理保险资金业务等业务资格，在主动权益、固定收益、量化投资、FOF 投资等领域全面布局，为客户提供专业理财服务。

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		
彭欣杨	基金经理	2017 年 12 月 21 日	-	11.3	男，中国籍，理学硕士，具有基金从业资格。2010 年 9 月至 2012 年 3 月，就职于广发证券有限责任公司，任研究员；2012 年 3 月加入华商基金管理有限公司，曾任行业研究员；2015 年 7 月 21 日至 2016 年 4 月 11 日担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金的基金经理助理；2016 年 4 月 12 日至 2019 年 8 月 23 日担任华商领先企业混合型开放式证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 5 日起至今担任华商产业升级混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 12 月 21 日起至今担任华商价值精选混合型证券投资基金的基金经理。

注：①“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地

为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

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》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在利益输送的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内严格执行公司相关制度，未发现本基金存在异常交易行为。公司严格控制旗下非指数型投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易，按照有关指数的构成比例进行的投资导致出现的同日反向交易中，成交较少的单边交易量均未超过该证券当日成交量的 5%。

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 年是疫情常态化的一年，疫情的常态化也带来了许多意想不到的改变。依靠严格执行疫情动态清零政策，中国卓有成效的保证了生产活动的顺利进行，在全球鹤立鸡群，从而使得出口

大超预期，拉动了整个国内经济的增长。而从流动性来看，以美国为首的海外国家，为了应对疫情，均释放了大量流动性，推升了全球通胀水平。因此国内市场面临的是流动性推升和经济活动增长的双击局面，整体市场取得了不错的表现。上半年经历了短暂调整之后，先是医药、科技等高估值板块率先启动，是上半场的主旋律。下半年则是新能源与周期齐飞，尤其是周期板块中涉及及新能源的品种录得了业绩与估值双击带来的巨大的涨幅，而上半年领涨的医药科技则开始大幅回落。

组合策略方面，本基金配置的是医药加科技的组合，上半年取得了较好的表现。但三季度没有大比例切换到新能源与周期板块，错过了下半年轰轰烈烈的行情，并造成了一定的回撤。对于坚守的品种，我们会仔细检视其成色，相信市场终究会体现其价值。对于周期和新能源板块行情的错失，我们也在反思，从认知到操作上，都有可以改进的地方。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2021 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.241 元，份额累计净值为 3.151 元。本年度基金份额净值增长率为 10.83%，同期基金业绩比较基准的收益率为-2.62%，本基金份额净值增长率高于业绩比较基准收益率 13.45 个百分点。

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，局面更加复杂。从海外来看：第一、海外通胀高企，货币政策变化的时间点在临近，这可能带来外需和流动性的双杀。第二，疫情对海外的影响在消退。在自然感染和疫苗结合作用下，海外将进入群体免疫阶段，海外生产活动也逐步在恢复，带来我们出口竞争的加剧。从国内来看，内需有可能不足，一方面，地产依旧被政策严格的管控着，另一方面，消费也受到防疫政策影响。综合而言，从内外部来看，2022 都是动荡加大的一年，也因此，稳增长、稳预期也是目前国内政策的最大的着力点。我们对市场并不悲观，因为目前我们内需的政策储备还是很多的；另外，经济结构也在潜移默化的改变着，许多新兴产业也逐渐成气候了。一如既往我们需要找到好的行业和公司，但 2022 年可能要更加注重估值和业绩的匹配度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人从合法、合规、保障基金持有人利益出发，由督察长领导独立于各业务部门的监察稽核部对基金投资运作、公司经营管理及员工行为的合法、合规性等进行了监察稽核，通过开展合规审查、合规咨询、合规宣导与培训、合规检查、合规报告等工作流程，及时发现情况、提出整改意见、督促有关业务部门整改并跟踪改进落实情况，并通过各类报告、报表及时向公司管理层、董事会以及监管机构进行汇报，实现了对合规风险的有效识别和主动管理，提高了业务部门及人员的合规意识和自我约束能力。

内部监察稽核的重点是：国家法律法规及行业监管规则的执行情况；基金合同的遵守情况；公司内部规章制度的执行情况；信息隔离管理机制建设和执行情况；信息系统安全建设和运行情况与员工职业操守规范情况等。

(1) 进一步完善制度建设，构建适时、全面、严谨的内部控制体系。本基金管理人根据法律法规变动及公司业务发展的需要，及时制定及修订了相关管理制度，对原有制度体系进行了持续的更新和完善，对现有的制度体系进行了进一步梳理，同时，根据公司实际业务情况不断细化制度流程，进一步强化内部控制。

(2) 全面加强风险监控，不断提高风险管理水平。本基金管理人在原有基础上进一步提升内控管理水平，确保内部控制的独立性和权威性，事前、事中、事后风险控制有效结合，通过多种形式提高内控管理质量、优化风险管理水平。

(3) 有计划地开展合规检查工作，保障公司的经营管理和全体员工的执业行为符合法律法规和准则。本年度内，本基金管理人通过日常监察与专项稽核相结合的方式，深入开展各项监察稽核工作，对证券库管理、信用研究支持、场外网下交易业务、交易对手管理、移动通讯工具管理与信息监控、内幕交易防控、员工投资行为管理、关联交易管理、基金运营、信息技术、宣传推介、销售适用性管理、客户服务、反洗钱工作等方面进行专项稽核，对全体员工守法合规行为进行监督，从而较好地防范合规风险。

(4) 强化合规宣导和培训。本基金管理人及时向全体员工宣导最新法律法规及监管动态，通过组织各类合规培训持续向全体员工传达监管政策要点及监管会议精神，通报行业风险事件及监管通报案例情况，督促全体员工规范执业，从而推动公司合规文化建设，形成公司合规共识。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和独立第三方机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

本基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、定期审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高管、分管投研部门的高管、固定收益部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人或上述部门负责人指定人员，由总经理任估值小组负责人，由基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组关于调整投资品种估值方法的决策，需经 1/2 以上的小组成员同意。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任

能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，本基金托管人有义务要求本基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。本基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期间基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《华商价值精选混合型证券投资基金基金合同》约定，本基金收益每年最多分配四次，每次基金收益分配比例不低于收益分配基准日可供分配利润的 80%。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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。本报告期内，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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 22643 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	华商价值精选混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华商价值精选混合型证券投资基金(以下简称“华商价值精选混合基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华商价值精选混合基金 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华商价值精选混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
其他信息	<p>华商价值精选混合基金的基金管理人华商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括华商价值精选混合基金 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>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。</p> <p>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。基于我们已经执行的工作,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。</p>

	在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估华商价值精选混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算华商价值精选混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华商价值精选混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 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>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华商价值精选混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华商价值精选混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	陈熹 崔泽宇
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼

审计报告日期	2022 年 3 月 30 日
--------	-----------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华商价值精选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
资产：			
银行存款	7.4.7.1	98,493,474.27	62,819,084.47
结算备付金		5,275,608.68	2,585,284.49
存出保证金		489,722.61	412,097.70
交易性金融资产	7.4.7.2	521,659,388.49	730,543,728.03
其中：股票投资		521,659,388.49	726,391,146.85
基金投资		-	-
债券投资		-	4,152,581.18
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	11,230.21	9,903.91
应收股利		-	-
应收申购款		66,147.77	120,301.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		625,995,572.03	796,490,399.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		21,024,221.48	-
应付赎回款		840,816.05	5,990,507.42
应付管理人报酬		775,403.01	966,731.81
应付托管费		129,233.86	161,121.97
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	2,664,778.85	1,801,080.89
应交税费		-	14.02
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	209,793.94	233,836.04
负债合计		25,644,247.19	9,153,292.15
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	267,939,530.77	389,360,701.65
未分配利润	7.4.7.10	332,411,794.07	397,976,406.09
所有者权益合计		600,351,324.84	787,337,107.74
负债和所有者权益总计		625,995,572.03	796,490,399.89

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.241 元，基金份额总额 267,939,530.77 份。

7.2 利润表

会计主体：华商价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		105,457,156.86	400,671,661.27
1. 利息收入		333,001.62	624,868.55
其中：存款利息收入	7.4.7.11	330,595.20	600,649.21
债券利息收入		2,406.42	1,620.65
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	22,598.69
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		222,198,071.43	341,294,420.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	219,456,203.25	337,870,370.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,746,162.53	6,844.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	995,705.65	3,417,206.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-117,169,086.21	58,619,987.91
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	95,170.02	132,384.33
减：二、费用		27,293,784.78	27,436,517.78

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	9,912,792.92	12,075,559.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,652,132.14	2,012,593.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	15,468,631.30	13,062,685.33
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8.81	5.79
7. 其他费用	7.4.7.20	260,219.61	285,674.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		78,163,372.08	373,235,143.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		78,163,372.08	373,235,143.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华商价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	389,360,701.65	397,976,406.09	787,337,107.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	78,163,372.08	78,163,372.08
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）	-121,421,170.88	-143,727,984.10	-265,149,154.98
其中：1. 基金申购款	39,908,046.06	47,390,332.45	87,298,378.51
2. 基金赎回款	-161,329,216.94	-191,118,316.55	-352,447,533.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	267,939,530.77	332,411,794.07	600,351,324.84
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	676,101,615.50	198,735,460.69	874,837,076.19

票(包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券等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。基金的投资组合比例为:股票(包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的 60%-95%,其中符合本基金定义的价值型股票类资产投资比例不低于股票类资产的 80%;债券投资比例为基金资产的 0-35%;权证投资比例为基金资产净值的 0-3%;并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×75%+上证国债指数收益率×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人华商基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 日批准报出

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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华商价值精选混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券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)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)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(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明

确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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	98,493,474.27	62,819,084.47
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：	98,493,474.27	62,819,084.47

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	501,414,730.30	521,659,388.49	20,244,658.19
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	501,414,730.30	521,659,388.49	20,244,658.19
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	590,435,383.63	726,391,146.85	135,955,763.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,694,600.00	4,152,581.18
	银行间市场	-	-
	合计	2,694,600.00	4,152,581.18
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	593,129,983.63	730,543,728.03	137,413,744.40

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均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均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均未持有从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	8,376.23	6,751.32
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	2,611.40	1,279.74
应收债券利息	-	1,668.44
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	0.25	0.36
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	242.33	204.05
合计	11,230.21	9,903.91

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

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	2,664,778.85	1,800,665.89
银行间市场应付交易费用	-	415.00
合计	2,664,778.85	1,801,080.89

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	493.94	4,536.04
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	209,300.00	229,300.00
合计	209,793.94	233,836.04

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	389,360,701.65	389,360,701.65
本期申购	39,908,046.06	39,908,046.06
本期赎回（以“-”号填列）	-161,329,216.94	-161,329,216.94
本期末	267,939,530.77	267,939,530.77

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	234,808,776.32	163,167,629.77	397,976,406.09
本期利润	195,332,458.29	-117,169,086.21	78,163,372.08
本期基金份额交易产生的变动数	-104,225,352.85	-39,502,631.25	-143,727,984.10
其中：基金申购款	37,513,080.86	9,877,251.59	47,390,332.45
基金赎回款	-141,738,433.71	-49,379,882.84	-191,118,316.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	325,915,881.76	6,495,912.31	332,411,794.07

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	264,426.48
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	23.33	40.81
结算备付金利息收入	58,979.79	49,736.30
其他	7,165.60	7,713.27

合计	330,595.20	600,649.21
----	------------	------------

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	5,179,672,232.88	4,422,580,096.97
减：卖出股票成本总额	4,960,216,029.63	4,084,709,726.81
买卖股票差价收入	219,456,203.25	337,870,370.16

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	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
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,746,162.53	6,844.00
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,746,162.53	6,844.00

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	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	16,241,461.06	40,851.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	14,484,952.69	34,000.00
减：应收利息总额	10,345.84	7.00
买卖债券差价收入	1,746,162.53	6,844.00

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生权证投资收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未发生衍生工具其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	995,705.65	3,417,206.32
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	995,705.65	3,417,206.32

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-117,169,086.21	58,619,987.91
——股票投资	-115,711,105.03	57,168,527.93
——债券投资	-1,457,981.18	1,451,459.98
——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	-117,169,086.21	58,619,987.91

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	95,170.02	132,384.33
合计	95,170.02	132,384.33

注：1. 基金赎回费收入含转换费收入。

2. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

3. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	15,468,631.30	13,062,685.33
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	15,468,631.30	13,062,685.33

7.4.7.20 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	80,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,200.00	37,200.00
银行费用	23,019.61	28,474.48
合计	260,219.61	285,674.48

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作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
华商基金管理有限公司（“华商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
华龙证券股份有限公司（“华龙证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
深圳市五洲协和投资有限公司	基金管理人的股东
济钢集团有限公司（“济钢集团”）	基金管理人的股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
华龙证券	-	-	1,169,238,495.79	13.99%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华龙证券	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华龙证券	1,088,908.60	13.99%	-	-

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	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	9,912,792.92	12,075,559.00
其中：支付销售机构的客户维护费	4,294,358.17	5,248,305.94

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,652,132.14	2,012,593.18

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生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。

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金合同生效日（2011年5月31日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	18,896,069.54
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	-	18,896,069.54
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	98,493,474.27	264,426.48	62,819,084.47	543,158.83

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

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
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年1月7日	新股流通受限	22.98	22.98	13,568	311,792.64	311,792.64	-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	3,965	166,450.70	166,450.70	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股流通受限	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股锁定	4.53	4.27	394,011	1,784,869.83	1,682,426.97	-
688303	大全能源	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	21.49	60.51	13,468	289,427.32	814,948.68	-
688110	东芯股份	2021年12月3日	2022年6月10日	新股锁定	30.18	40.37	5,852	176,613.36	236,245.24	-
688670	金迪克	2021年7月23日	2022年2月7日	新股锁定	55.18	74.11	2,310	127,465.80	171,194.10	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	225	26,298.00	26,118.00	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定	10.45	11.22	1,730	18,078.50	19,410.60	-
300994	久祺股份	2021年8月2日	2022年2月14日	新股锁定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	212	14,816.68	18,808.64	-
301060	兰卫医学	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	325	12,701.00	16,942.25	-
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	31.14	535	14,878.35	16,659.90	-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	169	14,544.14	15,970.50	-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	558	15,540.30	15,322.68	-
301091	深城交	2021年10月20日	2022年4月29日	新股锁定	36.50	31.31	481	17,556.50	15,060.11	-
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股锁定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	261	17,272.98	14,777.82	-
301046	能辉科技	2021年8月10日	2022年2月17日	新股锁定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301179	泽宇智能	2021年12月1日	2022年6月8日	新股锁定	43.99	50.77	265	11,657.35	13,454.05	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	58.08	49.85	266	15,449.28	13,260.10	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股锁定	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定	79.60	78.53	163	12,974.80	12,800.39	-

301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股锁定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月28日	新股锁定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301088	戎美股份	2021年10月19日	2022年4月28日	新股锁定	33.16	24.67	423	14,026.68	10,435.41	-
301108	洁雅股份	2021年11月25日	2022年6月6日	新股锁定	57.27	53.71	194	11,110.38	10,419.74	-
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股锁定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月16日	新股锁定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月7日	新股锁定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股锁定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301062	上海艾录	2021年9月7日	2022年3月14日	新股锁定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股锁定	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月24日	新股锁定	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股锁定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股锁定	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月7日	新股锁定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021年7月21日	2022年2月7日	新股锁定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股锁定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：1. 本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《深圳

证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2. 上述流通受限证券可流通日系基金根据上市公司公告暂估确定，最终日期以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告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

本基金为进行主动投资的混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效管理投资风险的前提下，追求超过基准的投资回报及基金资产的长期稳定增值。

本基金的基金管理人内部控制组织体系包括四个层次：(1) 公司一级风险防范由董事会构成。董事会根据公司章程和《华商基金管理有限公司风险管理制度》的规定履行风险管理职责。董事会下设专业委员会，各专业委员会根据董事会授权和相关议事规则履行相应风险管理和监督职责。(2) 公司二级风险防范由公司管理层构成。公司管理层负责在决策和执行过程中全面把控各类风险，并根据董事会的决议和《华商基金管理有限公司风险管理制度》的规定履行风险管理职责。各高级管理人员负责监督分管业务条线的风险控制质量和执行情况，评价分管业务条线的风险管理水平和效果。(3) 公司的三级风险防范由风险管理小组等职能机构构成。风险管理小组对公司经

营过程和基金运作过程中的重大风险进行分析、评估，防范和化解公司在经营过程和基金运作过程中面临的各种风险；其他职能机构(如各级投资决策委员会等)在职能范围内依据各职能机构的议事规则对相关业务进行集体决策和风险控制。(4)公司四级风险防范由公司各部门及公司员工构成。公司各部门及公司员工对自身业务工作中的风险进行自我检查和控制，并根据公司经营计划、部门或岗位职责以及《华商基金管理有限公司风险管理制度》的规定承担相应风险管理责任。各部门、岗位之间相互监督、制衡。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2020 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.53%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.69%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：

根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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受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对于未来现金流影响的风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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	98,493,474.27	-	-	-	98,493,474.27
结算备付金	5,275,608.68	-	-	-	5,275,608.68
存出保证金	489,722.61	-	-	-	489,722.61
交易性金融资产	-	-	-	521,659,388.49	521,659,388.49
应收利息	-	-	-	11,230.21	11,230.21
应收申购款	298.21	-	-	65,849.56	66,147.77
资产总计	104,259,103.77	-	-	521,736,468.26	625,995,572.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	21,024,221.48	21,024,221.48
应付赎回款	-	-	-	840,816.05	840,816.05
应付管理人报酬	-	-	-	775,403.01	775,403.01
应付托管费	-	-	-	129,233.86	129,233.86
应付交易费用	-	-	-	2,664,778.85	2,664,778.85
其他负债	-	-	-	209,793.94	209,793.94

负债总计	-	-	-	25,644,247.19	25,644,247.19
利率敏感度缺口	104,259,103.77	-	-	-496,092,221.07	600,351,324.84
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	62,819,084.47	-	-	-	62,819,084.47
结算备付金	2,585,284.49	-	-	-	2,585,284.49
存出保证金	412,097.70	-	-	-	412,097.70
交易性金融资产	-	1,491,986.50	2,660,594.68	726,391,146.85	730,543,728.03
应收利息	-	-	-	9,903.91	9,903.91
应收申购款	198.81	-	-	120,102.48	120,301.29
资产总计	65,816,665.47	1,491,986.50	2,660,594.68	726,521,153.24	796,490,399.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	5,990,507.42	5,990,507.42
应付管理人报酬	-	-	-	966,731.81	966,731.81
应付托管费	-	-	-	161,121.97	161,121.97
应付交易费用	-	-	-	1,801,080.89	1,801,080.89
应交税费	-	-	-	14.02	14.02
其他负债	-	-	-	233,836.04	233,836.04
负债总计	-	-	-	9,153,292.15	9,153,292.15
利率敏感度缺口	65,816,665.47	1,491,986.50	2,660,594.68	717,367,861.09	787,337,107.74

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.53%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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的股票，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。

本基金通过深入的基本面研究，精选价值相对被低估、成长性受经济周期波动影响较小的优

势企业。在构建和管理投资组合的过程中，从国计民生的长期发展角度，重点布局具有长期发展前景的产业和行业以及经济区域，并根据市场节奏动态优化配置资产组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票(包含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)投资比例为基金资产的 60%-95%，其中符合本基金定义的价值型股票类资产投资比例不低于股票类资产的 80%；债券投资比例为基金资产的 0-35%；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；并保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中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(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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	521,659,388.49	86.89	726,391,146.85	92.26
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	521,659,388.49	86.89	726,391,146.85	92.26

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%		30,012,078.27
2. 沪深 300 指数下降 5%		-30,012,078.27	-36,931,440.59

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

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 517,490,877.23 元，属于第二层次的余额为 4,168,511.26 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 725,837,360.66 元，第二层次 4,706,367.37 元，无第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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)、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、交易不活跃期间及限售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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募

证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，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	521,659,388.49	83.33
	其中：股票	521,659,388.49	83.33
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	103,769,082.95	16.58
8	其他各项资产	567,100.59	0.09
9	合计	625,995,572.03	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,091,598.00	1.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	474,569,518.77	79.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,270,433.00	1.21
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	19,341,278.61	3.22

G	交通运输、仓储和邮政业	25,722.00	0.00
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	14,149,390.06	2.36
J	金融业	69,749.68	0.01
K	房地产业	2,745.96	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	52,210.68	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	21,351.71	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	37,906.44	0.01
S	综合	-	-
	合计	521,659,388.49	86.89

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	占基金资产净值比例（%）
1	688180	君实生物	367,606	24,622,249.88	4.10
2	688276	百克生物	353,153	24,226,295.80	4.04
3	600460	士兰微	418,300	22,671,860.00	3.78
4	603916	苏博特	873,200	22,493,632.00	3.75
5	002371	北方华创	64,610	22,420,962.20	3.73
6	000423	东阿阿胶	444,800	21,684,000.00	3.61
7	600976	健民集团	241,900	19,083,491.00	3.18
8	603986	兆易创新	106,700	18,763,195.00	3.13
9	000738	航发控制	616,800	18,676,704.00	3.11
10	600577	精达股份	2,461,700	18,315,048.00	3.05
11	600216	浙江医药	1,065,800	18,203,864.00	3.03
12	000534	万泽股份	962,446	17,266,281.24	2.88
13	300181	佐力药业	1,207,600	14,080,616.00	2.35
14	600765	中航重机	273,400	13,803,966.00	2.30
15	688239	航宇科技	193,073	13,161,786.41	2.19
16	300573	兴齐眼药	94,800	12,968,640.00	2.16
17	300026	红日药业	1,616,100	12,654,063.00	2.11

18	605118	力鼎光电	758,500	12,591,100.00	2.10
19	000778	新兴铸管	2,858,000	12,375,140.00	2.06
20	002777	久远银海	443,698	12,268,249.70	2.04
21	002918	蒙娜丽莎	415,300	11,890,039.00	1.98
22	600132	重庆啤酒	77,800	11,772,696.00	1.96
23	688798	艾为电子	54,446	11,760,336.00	1.96
24	002594	比亚迪	43,600	11,690,032.00	1.95
25	002572	索菲亚	514,400	11,419,680.00	1.90
26	600779	水井坊	94,500	11,339,055.00	1.89
27	300919	中伟股份	74,500	11,287,495.00	1.88
28	300587	天铁股份	544,600	10,875,662.00	1.81
29	603290	斯达半导	26,700	10,172,700.00	1.69
30	600995	文山电力	365,900	7,270,433.00	1.21
31	688680	海优新材	22,169	6,768,195.70	1.13
32	000860	顺鑫农业	161,900	6,181,342.00	1.03
33	601567	三星医疗	377,500	6,157,025.00	1.03
34	002850	科达利	38,000	6,092,920.00	1.01
35	002041	登海种业	236,200	6,091,598.00	1.01
36	688301	奕瑞科技	11,983	5,954,352.70	0.99
37	603208	江山欧派	94,200	5,942,136.00	0.99
38	000661	长春高新	21,300	5,780,820.00	0.96
39	300077	国民技术	218,200	5,450,636.00	0.91
40	601728	中国电信	394,011	1,682,426.97	0.28
41	688303	大全能源	13,468	814,948.68	0.14
42	688235	百济神州	4,564	659,543.64	0.11
43	688176	亚虹医药	13,568	311,792.64	0.05
44	688110	东芯股份	5,852	236,245.24	0.04
45	301166	优宁维	1,685	172,118.50	0.03
46	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.03
47	688262	国芯科技	3,965	166,450.70	0.03
48	301138	华研精机	2,849	163,804.70	0.03
49	688236	春立医疗	4,052	110,984.28	0.02
50	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.01
51	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.01
52	301029	怡合达	462	41,519.94	0.01
53	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.01
54	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
55	301177	迪阿股份	225	26,118.00	0.00
56	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00

57	001317	三羊马	300	25,722.00	0.00
58	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
59	301090	华润材料	1,730	19,410.60	0.00
60	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
61	301221	光庭信息	212	18,808.64	0.00
62	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
63	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
64	301168	通灵股份	325	16,942.25	0.00
65	301100	风光股份	535	16,659.90	0.00
66	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
67	301190	善水科技	558	15,322.68	0.00
68	301091	深城交	481	15,060.11	0.00
69	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
70	301189	奥尼电子	261	14,777.82	0.00
71	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
72	301015	百洋医药	462	13,998.60	0.00
73	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
74	301179	泽宇智能	265	13,454.05	0.00
75	301093	华兰股份	266	13,260.10	0.00
76	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
77	605319	无锡振华	764	12,957.44	0.00
78	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
79	301096	百诚医药	163	12,800.39	0.00
80	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
81	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
82	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
83	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
84	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
85	301088	戎美股份	423	10,435.41	0.00
86	301108	洁雅股份	194	10,419.74	0.00
87	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
88	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
89	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
90	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
91	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
92	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
93	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
94	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
95	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00

96	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
97	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
98	301016	雷尔伟	275	7,128.00	0.00
99	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
100	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
101	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
102	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
103	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
104	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
105	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
106	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
107	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
108	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
109	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
110	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
111	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
112	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
113	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
114	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
115	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
116	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
117	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
118	300917	特发服务	84	2,745.96	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	688185	康希诺	119,938,236.05	15.23
2	600132	重庆啤酒	101,892,900.98	12.94
3	603986	兆易创新	86,060,033.27	10.93
4	002821	凯莱英	84,549,823.28	10.74
5	300014	亿纬锂能	81,315,343.29	10.33
6	603127	昭衍新药	74,796,808.90	9.50
7	002371	北方华创	68,915,578.67	8.75
8	605358	立昂微	68,545,858.00	8.71
9	600519	贵州茅台	66,772,168.20	8.48

10	002594	比亚迪	66,609,195.60	8.46
11	603392	万泰生物	64,626,548.80	8.21
12	688133	泰坦科技	62,719,844.81	7.97
13	600893	航发动力	59,962,237.46	7.62
14	688510	航亚科技	55,209,692.40	7.01
15	300772	运达股份	53,305,284.49	6.77
16	600760	中航沈飞	53,284,289.50	6.77
17	600460	士兰微	49,172,313.51	6.25
18	600048	保利发展	45,450,285.30	5.77
19	688002	睿创微纳	44,876,940.65	5.70
20	300274	阳光电源	44,181,255.29	5.61
21	300573	兴齐眼药	43,860,493.22	5.57
22	002777	久远银海	43,531,799.42	5.53
23	603799	华友钴业	42,825,606.00	5.44
24	600438	通威股份	41,936,279.29	5.33
25	300122	智飞生物	41,224,329.12	5.24
26	300699	光威复材	40,163,158.00	5.10
27	600011	华能国际	39,941,974.00	5.07
28	601225	陕西煤业	39,751,931.12	5.05
29	601636	旗滨集团	39,710,570.37	5.04
30	603882	金域医学	38,797,587.00	4.93
31	300015	爱尔眼科	37,153,551.49	4.72
32	002409	雅克科技	36,501,246.00	4.64
33	300171	东富龙	36,330,479.00	4.61
34	300003	乐普医疗	36,033,364.17	4.58
35	600036	招商银行	34,917,535.82	4.43
36	600111	北方稀土	34,723,072.00	4.41
37	002171	楚江新材	33,946,427.08	4.31
38	002709	天赐材料	32,500,231.57	4.13
39	688276	百克生物	32,419,914.02	4.12
40	300373	扬杰科技	31,726,947.50	4.03
41	688180	君实生物	31,699,680.76	4.03
42	300661	圣邦股份	30,749,182.90	3.91
43	603345	安井食品	30,433,012.50	3.87
44	002985	北摩高科	30,429,022.50	3.86
45	002812	恩捷股份	30,211,900.00	3.84

46	601899	紫金矿业	30,131,973.00	3.83
47	601966	玲珑轮胎	29,668,854.80	3.77
48	301029	怡合达	29,107,764.25	3.70
49	600176	中国巨石	28,930,901.82	3.67
50	600399	抚顺特钢	28,921,462.00	3.67
51	000661	长春高新	28,884,980.00	3.67
52	688131	皓元医药	28,797,467.51	3.66
53	600196	复星医药	28,557,851.62	3.63
54	601615	明阳智能	28,435,953.26	3.61
55	300769	德方纳米	27,892,289.00	3.54
56	300633	开立医疗	27,774,781.00	3.53
57	688186	广大特材	27,646,433.45	3.51
58	601318	中国平安	27,421,638.50	3.48
59	300850	新强联	27,289,389.10	3.47
60	600765	中航重机	26,952,327.76	3.42
61	300759	康龙化成	26,947,614.50	3.42
62	000002	万科 A	26,386,537.98	3.35
63	600276	恒瑞医药	26,342,387.00	3.35
64	688319	欧林生物	26,193,738.53	3.33
65	600577	精达股份	26,092,208.00	3.31
66	603606	东方电缆	25,703,075.97	3.26
67	600585	海螺水泥	25,428,260.55	3.23
68	688518	联赢激光	25,223,020.45	3.20
69	603288	海天味业	25,194,532.24	3.20
70	300482	万孚生物	25,050,144.90	3.18
71	600673	东阳光	24,064,944.00	3.06
72	688005	容百科技	23,892,127.18	3.03
73	600660	福耀玻璃	23,811,170.30	3.02
74	300347	泰格医药	23,796,142.08	3.02
75	603005	晶方科技	23,776,438.07	3.02
76	603290	斯达半导	23,584,747.00	3.00
77	605111	新洁能	23,487,773.00	2.98
78	688536	思瑞浦	23,130,552.15	2.94
79	688670	金迪克	22,710,523.28	2.88
80	002459	晶澳科技	22,690,929.00	2.88
81	000725	京东方 A	22,668,460.00	2.88

82	002001	新和成	22,504,970.20	2.86
83	600031	三一重工	22,343,337.90	2.84
84	600019	宝钢股份	22,226,946.54	2.82
85	000568	泸州老窖	22,124,153.85	2.81
86	000596	古井贡酒	22,071,035.20	2.80
87	688981	中芯国际	21,873,148.23	2.78
88	600346	恒力石化	21,421,255.52	2.72
89	603517	绝味食品	21,390,709.01	2.72
90	688016	心脉医疗	21,270,716.30	2.70
91	000423	东阿阿胶	21,113,973.00	2.68
92	300855	图南股份	20,289,598.00	2.58
93	300666	江丰电子	19,873,078.00	2.52
94	688239	航宇科技	19,836,040.78	2.52
95	601398	工商银行	19,752,049.00	2.51
96	002241	歌尔股份	19,664,924.14	2.50
97	688661	和林微纳	19,644,662.73	2.50
98	603993	洛阳钼业	19,580,806.70	2.49
99	000534	万泽股份	19,422,338.00	2.47
100	601988	中国银行	19,387,072.00	2.46
101	603115	海星股份	19,384,105.00	2.46
102	603982	泉峰汽车	19,354,817.12	2.46
103	600801	华新水泥	19,242,699.00	2.44
104	688122	西部超导	19,159,507.00	2.43
105	300124	汇川技术	19,115,193.69	2.43
106	300009	安科生物	19,107,215.53	2.43
107	603916	苏博特	19,043,514.00	2.42
108	300648	星云股份	18,937,475.00	2.41
109	688161	威高骨科	18,909,097.71	2.40
110	300142	沃森生物	18,902,339.00	2.40
111	688012	中微公司	18,887,714.41	2.40
112	300770	新媒股份	18,775,472.00	2.38
113	300012	华测检测	18,734,796.00	2.38
114	000738	航发控制	18,672,226.82	2.37
115	688559	海目星	18,530,605.01	2.35
116	688680	海优新材	18,510,836.04	2.35
117	300750	宁德时代	18,508,353.00	2.35

118	002850	科达利	18,435,166.00	2.34
119	002487	大金重工	18,382,435.00	2.33
120	603218	日月股份	18,341,145.31	2.33
121	300316	晶盛机电	18,319,754.00	2.33
122	688068	热景生物	18,190,900.05	2.31
123	300896	爱美客	18,125,327.00	2.30
124	600967	内蒙一机	17,897,489.52	2.27
125	600976	健民集团	17,796,591.00	2.26
126	600216	浙江医药	17,690,727.12	2.25
127	300587	天铁股份	17,680,221.16	2.25
128	300115	长盈精密	16,864,584.34	2.14
129	002414	高德红外	15,823,577.47	2.01
130	002444	巨星科技	15,798,396.85	2.01

注：买入股票成本、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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	688185	康希诺	103,984,754.12	13.21
2	300015	爱尔眼科	87,726,907.89	11.14
3	300122	智飞生物	86,363,038.36	10.97
4	002821	凯莱英	85,837,090.00	10.90
5	300014	亿纬锂能	84,901,432.34	10.78
6	603986	兆易创新	84,262,083.60	10.70
7	605358	立昂微	83,353,592.87	10.59
8	603127	昭衍新药	82,288,573.78	10.45
9	600132	重庆啤酒	80,556,307.60	10.23
10	002371	北方华创	75,296,746.80	9.56
11	688510	航亚科技	72,165,836.79	9.17
12	300750	宁德时代	71,896,401.19	9.13
13	002777	久远银海	70,723,597.64	8.98
14	300124	汇川技术	68,148,166.33	8.66
15	688002	睿创微纳	64,778,901.22	8.23
16	603882	金域医学	63,797,819.00	8.10
17	600519	贵州茅台	63,281,978.00	8.04
18	002594	比亚迪	62,017,175.00	7.88

19	603288	海天味业	61,257,103.70	7.78
20	603392	万泰生物	59,070,945.00	7.50
21	600893	航发动力	56,107,979.19	7.13
22	688133	泰坦科技	54,741,586.90	6.95
23	603799	华友钴业	53,235,145.31	6.76
24	300772	运达股份	52,890,035.88	6.72
25	600276	恒瑞医药	50,390,692.64	6.40
26	300782	卓胜微	49,473,492.36	6.28
27	600760	中航沈飞	48,818,995.16	6.20
28	603606	东方电缆	47,682,161.02	6.06
29	600011	华能国际	47,315,510.61	6.01
30	300661	圣邦股份	46,534,590.50	5.91
31	603259	药明康德	44,529,646.99	5.66
32	601012	隆基股份	44,451,608.90	5.65
33	300274	阳光电源	43,988,490.20	5.59
34	002409	雅克科技	43,504,555.00	5.53
35	601636	旗滨集团	43,366,258.09	5.51
36	002410	广联达	42,778,132.12	5.43
37	600048	保利发展	41,894,662.19	5.32
38	300171	东富龙	41,696,925.00	5.30
39	300699	光威复材	40,593,380.11	5.16
40	600438	通威股份	40,061,548.34	5.09
41	600460	士兰微	39,453,566.00	5.01
42	688012	中微公司	38,898,827.05	4.94
43	000661	长春高新	38,701,921.89	4.92
44	601225	陕西煤业	38,360,627.07	4.87
45	002171	楚江新材	37,217,167.00	4.73
46	600316	洪都航空	34,421,589.92	4.37
47	300373	扬杰科技	34,068,679.86	4.33
48	300573	兴齐眼药	33,427,686.00	4.25
49	300003	乐普医疗	33,106,975.00	4.20
50	600036	招商银行	32,883,469.00	4.18
51	600111	北方稀土	32,699,155.64	4.15
52	600399	抚顺特钢	32,487,486.00	4.13
53	601899	紫金矿业	31,840,713.00	4.04
54	688016	心脉医疗	31,645,630.82	4.02
55	601966	玲珑轮胎	31,248,645.57	3.97
56	002812	恩捷股份	31,208,257.00	3.96

57	600196	复星医药	31,156,118.00	3.96
58	300769	德方纳米	31,110,784.98	3.95
59	605111	新洁能	31,040,022.77	3.94
60	300059	东方财富	30,922,236.83	3.93
61	002709	天赐材料	30,886,807.64	3.92
62	601615	明阳智能	29,689,117.36	3.77
63	002985	北摩高科	28,451,721.00	3.61
64	600809	山西汾酒	28,099,983.05	3.57
65	601100	恒立液压	27,900,026.84	3.54
66	688186	广大特材	27,675,670.51	3.52
67	300850	新强联	27,628,013.30	3.51
68	603345	安井食品	27,561,633.00	3.50
69	600765	中航重机	26,669,058.99	3.39
70	300759	康龙化成	26,573,725.94	3.38
71	300633	开立医疗	26,333,917.00	3.34
72	688536	思瑞浦	26,306,749.54	3.34
73	688131	皓元医药	26,142,002.89	3.32
74	600176	中国巨石	25,537,726.64	3.24
75	301029	怡合达	24,870,082.55	3.16
76	601318	中国平安	24,788,317.00	3.15
77	000002	万科 A	24,492,265.50	3.11
78	600585	海螺水泥	24,334,747.00	3.09
79	600673	东阳光	24,090,897.00	3.06
80	000725	京东方 A	23,771,365.00	3.02
81	688319	欧林生物	23,643,783.04	3.00
82	688518	联赢激光	23,163,246.72	2.94
83	300142	沃森生物	23,142,339.00	2.94
84	002001	新和成	22,966,262.96	2.92
85	603005	晶方科技	22,824,514.40	2.90
86	002475	立讯精密	22,812,232.12	2.90
87	688005	容百科技	22,765,823.02	2.89
88	300482	万孚生物	22,583,975.00	2.87
89	002487	大金重工	22,366,855.00	2.84
90	002459	晶澳科技	22,259,865.84	2.83
91	603517	绝味食品	22,016,444.89	2.80
92	300347	泰格医药	21,955,993.30	2.79
93	300009	安科生物	21,954,448.92	2.79
94	600031	三一重工	21,848,855.84	2.78

95	300666	江丰电子	21,376,835.63	2.72
96	688122	西部超导	21,360,828.81	2.71
97	000596	古井贡酒	21,084,959.00	2.68
98	600346	恒力石化	20,821,454.50	2.64
99	688670	金迪克	20,626,690.91	2.62
100	688981	中芯国际	20,490,917.34	2.60
101	600019	宝钢股份	20,377,729.04	2.59
102	601398	工商银行	19,680,451.00	2.50
103	601988	中国银行	19,663,343.00	2.50
104	600660	福耀玻璃	19,322,087.13	2.45
105	603218	日月股份	19,259,547.00	2.45
106	600801	华新水泥	19,223,850.00	2.44
107	603982	泉峰汽车	18,789,579.00	2.39
108	688559	海目星	18,544,334.37	2.36
109	300855	图南股份	18,391,038.00	2.34
110	300316	晶盛机电	18,301,243.40	2.32
111	600967	内蒙一机	18,167,336.15	2.31
112	603993	洛阳钼业	18,077,457.10	2.30
113	688161	威高骨科	17,995,256.89	2.29
114	002241	歌尔股份	17,782,345.00	2.26
115	300012	华测检测	17,757,441.00	2.26
116	601699	潞安环能	17,600,979.40	2.24
117	300648	星云股份	17,417,485.00	2.21
118	300770	新媒股份	17,215,442.00	2.19
119	688661	和林微纳	17,196,523.51	2.18
120	000568	泸州老窖	17,178,034.44	2.18
121	300896	爱美客	16,861,469.00	2.14
122	300115	长盈精密	16,584,503.00	2.11
123	603115	海星股份	16,492,916.00	2.09
124	000915	华特达因	16,212,905.30	2.06
125	688068	热景生物	16,185,837.55	2.06
126	002414	高德红外	16,013,155.00	2.03
127	603707	健友股份	15,936,200.12	2.02
128	688187	时代电气	15,749,703.38	2.00

注：买入股票成本、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。

8.4.3 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	4,871,195,376.30
卖出股票收入（成交）总额	5,179,672,232.88

注：买入股票成本、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

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券投资。

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

本基金本报告期末投资贵金属投资。

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

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

百克生物

于 2021 年 11 月就公司与广州思安信生物技术有限公司关于新型冠状病毒疫苗（PIV-5 载体）的许可合作交易期间项目参与人员及其近亲属买卖公司股票事宜进行自查。经公司自查：公司前董事长安吉祥先生之妻庞小英女士于 2021 年 6 月至 2021 年 10 月期间买卖公司股票，累计买入 15,900 股，累计金额 1,539,684 元，累计卖出 8,900 股，累计金额 813,430 元，上述在买入后六个月内卖出、在卖出后六个月内又买入公司股票的行为构成短线交易，违反了《证券法》第四十四条规定。

精达股份

于 2021 年 5 月 13 日收到中国证监会安徽监管局《关于对铜陵精达特种电磁线股份有限公司采取出具警示函措施的决定》（[2021]10 号），指出公司主要存在：2020 年，上市公司累计向关联法人精达集团非经营性资金拆 44,262 万元，该关联交易未履行董事会、股东大会审批程序及临时信息披露义务。公司整改措施如下：要求财务部、内审部自查并将对相关责任人进行追责，并给予相应处罚；组织制定《防范股东及关联方占用资金专项制度》；完善公司内部审计部门的职能；要求公司及子公司全体管理人员及财务人员认真学习相关法律法规和各项证券监管规则的学习。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查，且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	489,722.61
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,230.21
5	应收申购款	66,147.77
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	567,100.59

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的情况。

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

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
28,239	9,488.28	63,213.66	0.02%	267,876,317.11	99.98%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	408.77	0.0002%

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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年5月31日）基金份额总额	1,277,926,822.08
---------------------------	------------------

本报告期期初基金份额总额	389,360,701.65
本报告期基金总申购份额	39,908,046.06
减:本报告期基金总赎回份额	161,329,216.94
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	267,939,530.77

注:总申购份额包含红利再投、转换入份额,总赎回份额包含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门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

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的重大诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)自2011年5月31日(基金合同生效日)起至今为本基金提供审计服务,本基金本报告期内应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)基金审计费用捌万元。

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

本基金管理人、托管人及其高级管理人员未发生受监管部门稽查或处罚的情形。

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	1	2,201,397,414.69	21.96%	2,050,166.55	21.96%	-
国盛证券	1	2,018,828,809.16	20.13%	1,880,131.97	20.13%	-
中信证券	2	1,899,763,812.25	18.95%	1,769,249.39	18.95%	-

财通证券	1	866,407,761.37	8.64%	806,887.47	8.64%	-
申万宏源证券	2	742,347,087.20	7.40%	691,348.44	7.40%	-
国泰君安证券	2	495,132,611.59	4.94%	461,118.03	4.94%	-
国联证券	1	472,187,447.50	4.71%	439,748.19	4.71%	-
长江证券	1	379,981,337.19	3.79%	353,876.51	3.79%	-
东兴证券	1	322,432,683.01	3.22%	300,284.39	3.22%	-
太平洋证券	1	256,992,047.19	2.56%	239,337.09	2.56%	-
中信建投证券	2	191,766,634.62	1.91%	178,592.01	1.91%	-
川财证券	1	179,308,647.28	1.79%	166,989.99	1.79%	-
华龙证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用席位的标准和程序：

(1) 选择标准

券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与基金管理人具有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

券商经纪人具有较强的研究能力：能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的行业分析能力，能根据基金管理人所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力。

券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠、最合理的佣金率。

(2) 选择程序

基金管理人根据以上标准对不同券商经纪人进行考察、选择和确定，选定的经纪人名单需经风险管理小组审批同意。基金管理人与被选择的证券经营机构签订委托协议。基金管理人与被选择的券商经纪人在签订委托代理协议时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等，经签章有效。委托代理协议一式三份，协议双方及证券主管机关各留存一份，基金管理人留存监察稽核部备案。

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	885,261.86	3.47%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	17,984,545.20	70.41%	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	1,306,185.50	5.11%	-	-	-	-
东兴证券	5,367,882.80	21.01%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
华龙证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

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	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东莞农村商业银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年1月4日
2	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021年1月7日
3	华商基金管理有限公司关于旗下	公司网站、中国证监会基金	2021年1月7日

	部分基金参加腾安基金销售（深圳）有限公司费率优惠活动的公告	电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	
4	华商价值精选混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 22 日
5	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年第四季度报告提示性公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 1 月 22 日
6	华商基金管理有限公司关于开展网上直销系统定投费率优惠的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 2 月 3 日
7	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 9 日
8	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加安信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 15 日
9	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京度小满基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 3 月 30 日
10	华商基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2021 年 3 月 31 日
11	华商价值精选混合型证券投资基金 2020 年年度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
12	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第一季度报告提示性公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 22 日
13	华商价值精选混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 22 日
14	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 4 月 28 日
15	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 5 月 6 日
16	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京汇成基金销售	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、	2021 年 6 月 24 日

	有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报、中国证券报、 证券日报	
17	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 6 月 30 日
18	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海基煜基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 1 日
19	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海挖财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 5 日
20	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京广源达信基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 5 日
21	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 15 日
22	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 16 日
23	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 21 日
24	华商价值精选混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站	2021 年 7 月 21 日
25	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第二季度报告提示性公告	公司网站、证券时报、上海 证券报、中国证券报、证券 日报	2021 年 7 月 21 日
26	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并相应修改法律文件的公告	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站、证券时报、 上海证券报、中国证券报、 证券日报	2021 年 7 月 23 日
27	华商价值精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站	2021 年 7 月 23 日
28	华商价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站、中国证监会基金 电子披露网站	2021 年 7 月 23 日
29	华商价值精选混合型证券投资基	公司网站、中国证监会基金	2021 年 7 月 23 日

	金基金合同	电子披露网站	
30	华商价值精选混合型证券投资基金托管协议	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 23 日
31	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国中金财富证券有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 7 月 26 日
32	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 7 月 30 日
33	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海浦东发展银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 7 月 30 日
34	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加南京证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 8 月 5 日
35	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 8 月 10 日
36	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中天证券股份有限公司定期定额投资费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 8 月 13 日
37	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加玄元保险代理有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 8 月 25 日
38	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 8 月 31 日
39	华商价值精选混合型证券投资基金 2021 年中期报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 31 日
40	华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 9 月 1 日
41	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华龙证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 9 月 6 日

42	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加嘉实财富管理有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 10 月 20 日
43	华商价值精选混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 27 日
44	华商基金管理有限公司旗下基金 2021 年第三季度报告提示性公告	公司网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 10 月 27 日
45	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加华夏银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 11 月 18 日
46	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加国信证券股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 11 月 26 日
47	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 11 月 26 日
48	华商基金管理有限公司关于提请投资者及时更新身份证件或身份证明文件的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 12 月 15 日
49	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海爱建基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 12 月 27 日
50	华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	公司网站、中国证监会基金电子披露网站、证券时报、上海证券报、中国证券报、证券日报	2021 年 12 月 31 日

§ 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

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准华商价值精选混合型证券投资基金设立的文件；

- 2、《华商价值精选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《华商价值精选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《华商价值精选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、报告期内华商价值精选混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880（免长途费），010-58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csrc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日