华融新锐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：华融基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 2 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 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 6
§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 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 **10**
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 **16**
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16
§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 17
§7 年度财务报表 **20**
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 **51**
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 51
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 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 58
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 58

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.....58
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.....58
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.....58
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....58
8.12 投资组合报告附注.....58
§9 基金份额持有人信息.....60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....60
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....60
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.....60
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....60
§10 开放式基金份额变动.....61
§11 重大事件揭示.....62
11.1 基金份额持有人大会决议.....62
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.....62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....62
11.4 基金投资策略的改变.....62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....62
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.....62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....63
11.8 其他重大事件.....64
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....67
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.....67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....67
§13 备查文件目录.....68
13.1 备查文件目录.....68
13.2 存放地点.....68
13.3 查阅方式.....68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	华融新锐
基金主代码	001068
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 15 日
基金管理人	华融基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,609,504.23 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过灵活运用多种投资策略，把握市场机会，分享中国经济转型和增长的红利，在有效控制风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益
投资策略	本基金将采取积极主动的资产配置策略，注重风险与收益的平衡，选择适应经济转型升级、能够为股东持续创造价值的优质标的，运用多样化的投资策略实行组合管理，实现基金资产的长期增值。 1、资产配置策略 从全球经济格局和中国经济发展方式的变化，分析经济的驱动力和阶段性特征，结合宏观政策、产业政策、结构变迁、市场情绪等对比分析大类资产风险收益比，合理分配各大类资产配置比例，以实现基金资产的稳健增值。 2、股票投资策略 本基金的股票投资秉承价值投资理念，采取定量和定性相结合的方法，深挖符合经济升级转型、发展潜力巨大的行业与公司，通过上下游产业链的实地调研对研究逻辑和结论进行验证，灵活运用多种低风险投资策略，把握市场投资机会。 3、债券投资策略 本基金将自上而下地在利率走势分析、债券供求分析基础上，灵活采用类属配置、个券选择、套利等投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

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		华融基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	谢超	秦一楠
	联系电话	010-59315649	010-66060069
	电子邮箱	xiechao@hr-fund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-819-0789	95599
传真		010-59315600	010-68121816
注册地址		中国（河北）自由贸易试验区雄安片区容城县雄安市民服务中心企业办公区 A 栋一层 108 单元	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100020	100031
法定代表人		杨铭海	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hr-fund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层
注册登记机构	华融基金管理有限公司	北京市朝阳区朝阳门北大街 18 号中国人保寿险大厦 11 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	3,210,080.59	6,346,592.84	15,460,752.07
本期利润	-131,914.90	7,341,186.05	24,922,882.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0063	0.1524	0.2088
本期加权平均净值利润率	-0.54%	14.32%	21.62%
本期基金份额净值增长率	-1.91%	16.33%	25.00%
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	3,900,572.67	5,480,943.53	2,011,261.20
期末可供分配基金份额利润	0.1805	0.1899	0.0244
期末基金资产净值	25,510,076.90	34,734,257.57	85,293,794.54
期末基金份额净值	1.181	1.204	1.035
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	18.10%	20.40%	3.50%

注：1.所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。

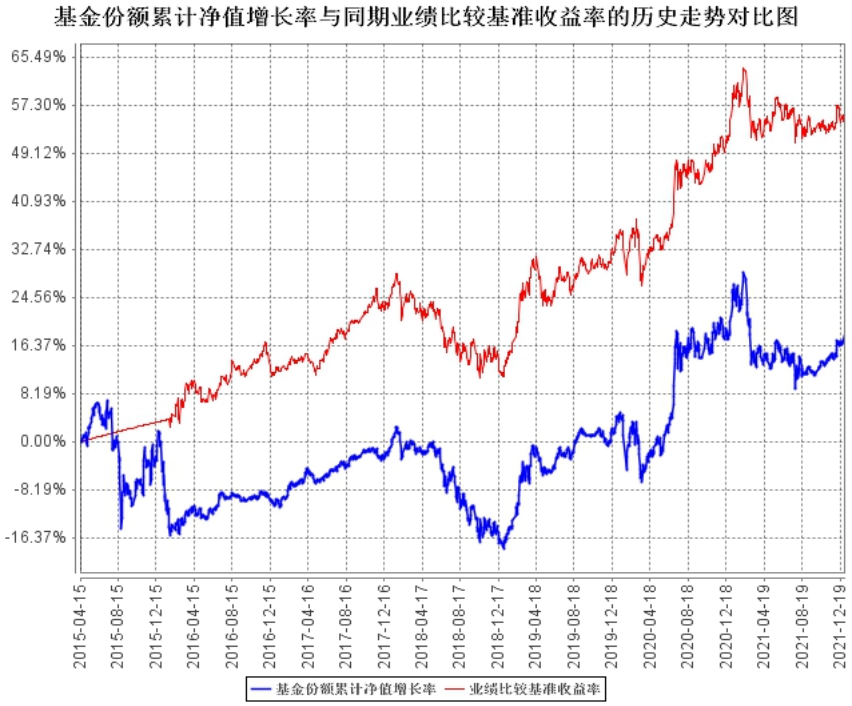
3.期末可供分配利润，为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分孰低数。

3.2 基金净值表现

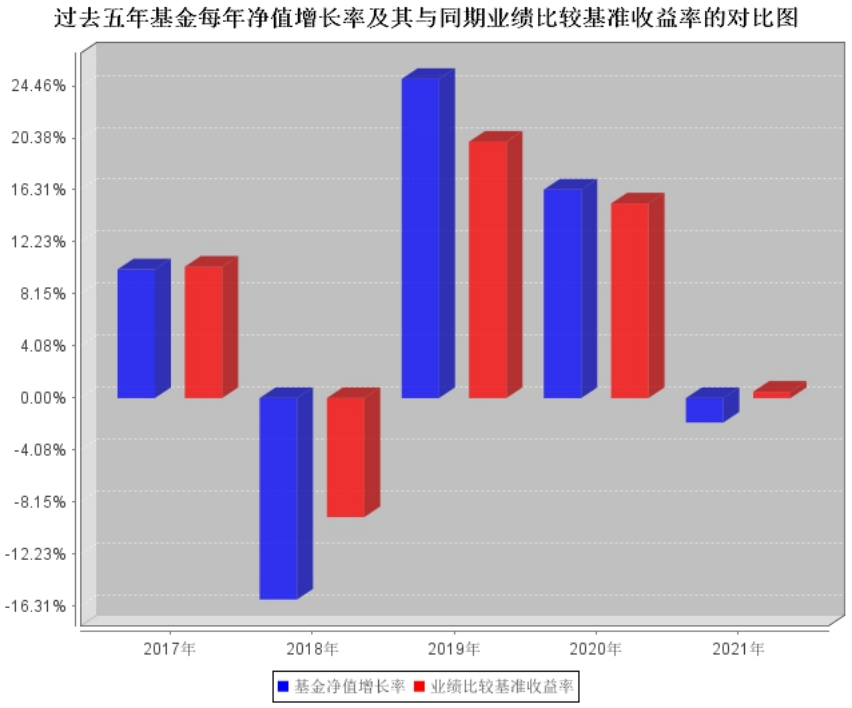
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	5.73%	0.34%	1.49%	0.39%	4.24%	-0.05%
过去六个月	2.34%	0.67%	-1.02%	0.51%	3.36%	0.16%
过去一年	-1.91%	0.79%	0.50%	0.59%	-2.41%	0.20%
过去三年	42.63%	0.84%	39.10%	0.64%	3.53%	0.20%
过去五年	32.25%	0.75%	39.13%	0.59%	-6.88%	0.16%
自基金合同生效起至今	18.10%	0.82%	55.50%	0.55%	-37.40%	0.27%

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



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



注：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。为

提高本基金业绩与业绩比较基准的可比性，公司自 2016 年 1 月 28 日起将本基金的业绩比较基准由原先的“1 年期人民币定期存款基准利率+3.00%”变更为“沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%”。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立至今未进行利润分配活动。

§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

华融基金管理有限公司（以下简称“华融基金”）成立于 2019 年 3 月 1 日，是经中国证监会批准设立的首家及目前唯一一家落户雄安新区的公募基金管理公司及全国性证券类法人机构。公司股东为华融证券股份有限公司，持股比例 100%，公司注册资本人民币 2 亿元。 华融基金以“深植雄安、服务雄安”为己任，秉承“诚信、尽责、专业、奋进”的企业精神，致力于通过创新公募基金产品设计开发，引导社会资源配置，切实服务于供给侧结构性改革、产业结构转型升级与创新引领以及雄安新区建设发展等国家战略，推进创新科技和经济社会融合发展，努力为机构和个人投资者提供长期稳健的投资回报，打造雄安特色优秀公募基金管理公司。 截至报告期末，华融基金旗下管理 7 只公募基金产品，为华融现金增利货币市场基金、华融新锐灵活配置混合型证券投资基金、华融新利灵活配置混合型证券投资基金、华融雄安建设发展三年定期开放债券型证券投资基金、华融荣赢 63 个月定期开放债券型证券投资基金，华融融泽 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金，华融融兴 6 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张洪磊	本基金的基金经理	2021 年 9 月 7 日	-	9	张洪磊先生，对外经济贸易大学金融学硕士，9 年证券从业经验。2021 年 7 月加入华融基金管理有限公司，2021 年 9 月 7 日起担任华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。历任福田汽车股份有限公司董事会办公室员工、天相投资顾问有限公司汽车行业分析师、东兴证券股份有限公司研究所大机械组组长、建信基金管理有限责任公司研究部研究员、建信基金管理有限责任公司专户投资部投资经理

					助理、投资经理。
范贵龙	本基金的基金经理、FOF 投资部负责人	2015 年 4 月 15 日	2021 年 9 月 16 日	12	范贵龙,武汉大学金融学硕士,特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM),12 年证券从业经验。2009 年 6 月加入华融证券股份有限公司,2020 年 3 月加入华融基金管理有限公司,现任 FOF 投资部负责人。历任中国建设银行股份有限公司西安新城支行客户经理、国务院发展研究中心信息网金融部研究员、华融证券股份有限公司市场研究部研究员、资产管理二部投资经理助理、基金业务部基金经理、华融基金管理有限公司权益投资部负责人、华融新利灵活配置混合型证券投资基金和华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和离职日期均指公司相关公告中披露的日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截止本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规规定及《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定,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,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

本基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《华融基金管理有限公司公平交易管理制度》，并建立了健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

本基金管理人从工作制度、工作流程和技术手段等方面来保证公平交易的实现，并通过监察稽核、事后分析和信息披露等手段来加强对于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

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《华融基金管理有限公司公平交易管理制度》。

在投资决策环节，本基金管理人构建了统一的研究平台，为旗下所有投资组合公平地提供研究支持。同时，在投资决策过程中，各基金经理严格遵守本基金管理人的各项投资管理制度和投资授权制度，保证各投资组合的独立投资决策机制。

在交易执行环节，本基金管理人实行集中交易制度，按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

在事后监控环节，本基金管理人定期对证券交易情况进行分析，并出具公平交易执行情况分析报告；本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

综上所述，本基金管理人在本报告期内严格执行了公平交易制度的相关规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量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 年年初市场受美债收益率上行的影响波动较大，之后随着高景气赛道龙头的复苏市场整体震荡走高。风格延续 2019 年以来成长股占优的特征，全年创业板涨幅约 12%，上证 50 涨幅收跌约 10%，红利指数涨幅 7.62%。个股分化较 2020 年有所收敛，全部 A 股涨跌幅中位数约 8.60%，全年约有 61%的个股收涨，涨幅超过 50%的个股占比约有 20%。

本基金始终坚持持有人利益优先的原则，坚持价值投资的理念。本基金积极应对市场变化，

2021 年一季度对低估值的金融配置较多，二季度后加仓了新能源等成长类股票，此后维持相对分散和均衡状态，并维持中低仓位，四季度之后主要配置低估值价值股。同时由于四季度多次出现新股破发的情况，四季度之后很少参与新股申购。

报告期内，本基金在控制总体风险的同时，通过优化低估值价值股和绩优成长股组合配置提高产品收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.181 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.91%，业绩比较基准收益率为 0.50%。

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，我们认为，疫情仍难彻底结束，将继续呈现“多轮反复、总体趋缓”的特点，对经济运行的负面影响还将存在，但边际递减。伴随疫情继续在全球持续扩散、供应链修复缓慢以及国际政经博弈加剧，中国经济面临的外部环境依然复杂多变。全球货币政策趋紧态势已经明确，美联储将在 2022 年上半年开启加息周期。

经济基本面方面，美国经济已经进入过热阶段，通胀压力较大，中国经济基本恢复到疫情前，但 2021 年下半年由于房地产投资下降较快，又出现一定下行风险，不过四季度新的稳增长的政策已经开始逐渐发力，预计 2022 年基建和地产投资将会企稳。

宏观政策方面，各项稳增长政策在逐步落地，经济环境有望改善。首先，2022 年 1 月份的社融和贷款超出市场预期，实现开门红。其次，各地基建项目落地的节奏有所加快，房地产政策也出现松动，多地开始降低房地产首付比例。稳增长政策将持续推出，经济预期有望进一步好转。财政政策将延续积极的基调，“提升效能，更加注重精准、可持续”，保证支出的强度，发力适当靠前。财政支出重点投向逐步回归常态，农林水、交通运输、节能环保、债务付息等领域仍将有所扩大。减税降费、扩大内需和风险防控或为重点方向。货币政策方面，稳字当头，完整、准确、全面贯彻新发展理念，深化供给侧结构性改革，加快构建新发展格局，坚持扩大内需战略，扎实做好“六稳”工作，全面落实“六保”任务，灵活精准实施货币政策，加强与财政、产业、监管政策之间的协调，统筹金融支持实体经济与防风险，保持经济运行在合理区间，推动经济高质量发展。

资金面方面，预计 2022 年融资环境将维持稳健略宽，社融增速有望稳中有升，市场流动性将继续保持合理充裕，DR007、R007 等关键利率品种将维持稳健运行。定性上看，考虑到 2022 年经济或将维持稳健运行，企业生产经营有望逐步回归正规，信贷需求将回暖。其次是信贷结构有望优化，“双碳”目标下金融支持经济转型力度将继续加大，绿色低碳等领域信贷增速将保持较高

水平。

A 股在经历了一段时间的调整之后，部分板块估值过高的情况有所缓解，但之前涨幅较大的成长龙头估值仍不便宜。从中期角度来看，港股估值相对更有优势，机会相对更大，A 股更多的是结构性机会，总体来看低估值板块有望占优。

展望 2022 年，A 股整体将维持震荡趋势，在经济结构转型和稳增长政策支持带动下，结构性行情仍将延续。一是房地产、新基建以及“专精特新”等将是 2022 年重点发展方向，相关板块存在结构性机会。二是资本市场改革红利持续释放。随着科创板、创业板和北交所注册制等顺利实施，沪深主办注册制进程有望加快。这一改革将进一步提高市场的活跃性。

在上述宏观环境下，2022 年市场可能是重心向下的结构市，上半年投资机会大概率会以稳增长低估值和超跌反弹的结构性机会为主，波动有可能加剧。成长股连续三年上涨、总体估值仍处在高位的背景下，2022 年难有大行情，不过需要重视这两年疫情受损潜在估值较低的板块中的优质个股。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人高度重视监察稽核工作，持续推进内部控制体系建设，按照法律法规、监管政策及公司章程要求，完善各项监察稽核及内部控制制度，并实施有效的合规管理、监察稽核、内控审计措施。

在合规管理方面，本基金管理人以严格遵守法律法规、监管政策及内部制度为基本要求，形成守法经营、规范运作的经营思想和理念，重视合规文化建设，并将防范合规风险作为合规管理工作的重要目标。本报告期内，本基金管理人切实落实各项合规管理职责，实现合规审查、合规检查、合规咨询、合规培训等合规管理措施常态化、规范化运作，合规管理覆盖投资、研究、交易、销售、宣传推介、信息披露等业务条线。此外，本基金管理人推进完善合规考核及问责机制，加强员工合规行为管理。本报告期内，本基金管理人有效落实各项合规管理要求，合规管理情况良好。

在监察稽核方面，本基金管理人每季度开展定期内部稽核工作，不定期开展专项稽核工作，按照稽核工作计划，对各业务条线进行监督、检查，排查业务风险隐患。本报告期内，本基金管理人监察稽核工作有序进行，对业务运作情况实现有效监督。

在内控审计方面，本基金管理人由指定部门开展内部控制检查，完善内部控制机制。此外，本基金管理人按照法律法规规定，聘任具备相应业务资格的会计师事务所对内部控制情况进行审计、评价。本报告期内，本基金管理人内控审计工作开展情况良好。

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》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人同基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由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目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会（主任委员由分管基金运营部的公司领导担任，副主任由公司主管基金运营部的部门领导担任，委员由投资、研究、风控、运营等部门负责人或业务骨干组成），负责研究、指导基金估值业务。估值委员会委员和负责基金日常估值业务的基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。基金经理不介入基金日常估值业务；估值委员会决议之前会与涉及基金的基金经理进行充分沟通。基金运营部负责执行估值委员会制定的估值政策及决议。

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；本基金管理人未签约与估值相关的任何定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内依据基金合同的约定和基金运作情况，未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期内，会计师事务所对本基金未出具非标准意见。

4.10 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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

本基金自 2020 年 7 月 16 日起存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况。依据《公开募集证券投资基金运作管理办法》相关规定，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会报告。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华融基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，华融基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，华融基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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	安永华明（2022）审字第 61560047_A02 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	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了华融新锐灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的华融新锐灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华融新锐灵活配置混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，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，管理层负责评估华融新锐灵活配置混合型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督华融新锐灵活配置混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对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，就可能导致对华融新锐灵活配置混合型证券投资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融新锐灵活配置混合型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评

	价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	朱燕
会计师事务所的地址	中国　北京	
审计报告日期	2022 年 3 月 29 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华融新锐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
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	7,396,026.45	2,376,727.31
结算备付金		255,095.96	543,097.77
存出保证金		21,124.95	25,449.35
交易性金融资产	7.4.7.2	15,657,190.00	26,544,584.00
其中：股票投资		15,657,190.00	24,519,784.00
基金投资		-	-
债券投资		-	2,024,800.00
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	6,000,000.00	5,800,000.00
应收证券清算款		-	690,528.81
应收利息	7.4.7.5	1,783.27	34,431.23
应收股利		-	-
应收申购款		99.88	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		29,331,320.51	36,014,818.47
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		3,687,095.72	578,058.26
应付赎回款		-	438,891.98
应付管理人报酬		31,538.18	45,210.76
应付托管费		5,256.34	7,535.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	52,353.37	50,864.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	45,000.00	160,000.00
负债合计		3,821,243.61	1,280,560.90
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	21,609,504.23	28,860,128.62
未分配利润	7.4.7.10	3,900,572.67	5,874,128.95
所有者权益合计		25,510,076.90	34,734,257.57
负债和所有者权益总计		29,331,320.51	36,014,818.47

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.181 元，基金份额总额 21,609,504.23 份。

7.2 利润表

会计主体：华融新锐灵活配置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		888,733.39	8,847,921.20
1.利息收入		197,866.71	261,205.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	39,157.21	50,000.83
债券利息收入		26,062.24	64,012.12
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		132,647.26	147,192.90
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,953,003.43	7,587,285.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,770,917.45	6,789,030.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-21,968.91	74,298.16
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
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	204,054.89	723,956.50
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,341,995.49	994,593.21
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	79,858.74	4,836.51
减：二、费用		1,020,648.29	1,506,735.15
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	364,666.84	774,370.90
2．托管费	7.4.10.2.2	60,777.78	129,061.81

3．销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4．交易费用	7.4.7.19	502,752.28	449,890.17
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6．税金及附加		-	22.32
7．其他费用	7.4.7.20	92,451.39	153,389.95
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-131,914.90	7,341,186.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-131,914.90	7,341,186.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华融新锐灵活配置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）	28,860,128.62	5,874,128.95	34,734,257.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-131,914.90	-131,914.90
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）	-7,250,624.39	-1,841,641.38	-9,092,265.77
其中：1.基金申购款	7,102,917.61	941,680.99	8,044,598.60
2.基金赎回款	-14,353,542.00	-2,783,322.37	-17,136,864.37
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）	21,609,504.23	3,900,572.67	25,510,076.90
项目	**上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日**		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	82,435,904.78	2,857,889.76	85,293,794.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	7,341,186.05	7,341,186.05
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）	-53,575,776.16	-4,324,946.86	-57,900,723.02
其中：1.基金申购款	964,653.72	91,013.82	1,055,667.54
2.基金赎回款	-54,540,429.88	-4,415,960.68	-58,956,390.56
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）	28,860,128.62	5,874,128.95	34,734,257.57

注：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：

丁卓	赵天智	单国巍
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

华融新锐灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2015 年 1 月 28 日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[2015]132 号文）核准，由华融证券股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。经向中国证监会备案，《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,010,044,560.32 份基金份额，其中认购资金利息折合 67,004.87 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金原基金管理人为华融证券股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。本基金于 2019 年 8 月 20 日在中国证监会变更注册（证监许可[2019]1522 号文），于 2019 年 11 月 13 日公告基金份额持有人大会决议生效，于 2020 年 4 月 27 日公告变更基金管理人为华融基金管理有限公司。

本基金投资范围包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核

准上市的股票）、债券、货币市场工具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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其它品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金将基金资产的 0%-95% 投资于股票，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定及参考意见。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 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根据下列依照企业会计准则、《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

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

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主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等。

（2）金融负债分类

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

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益。

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账。

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转。

（3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账。

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

（4）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本。

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算。

（5）回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

（3）如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金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的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

（4）买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提。

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账。

（6）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账。

（7）衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账。

（8）股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

（9）公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等在费用涵盖期间按基金合同或相关公告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，本基金每年收益分配次数最多为 4 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，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，投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日经除权后的该基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，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）投资人的现金红利保留到小数点后第 2 位，由此产生的损益由基金资产承担。

（5）本基金每份基金份额享有同等分配权。

（6）法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰。

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税

额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	7,396,026.45	2,376,727.31
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：	7,396,026.45	2,376,727.31

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		15,528,979.86	15,657,190.00	128,210.14
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		15,528,979.86	15,657,190.00	128,210.14
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		21,028,639.74	24,519,784.00	3,491,144.26
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	2,045,738.63	2,024,800.00	-20,938.63
	银行间市场	-	-	-
	合计	2,045,738.63	2,024,800.00	-20,938.63
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		23,074,378.37	26,544,584.00	3,470,205.63

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	6,000,000.00	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	5,800,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	5,800,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	2,176.64	441.58
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	114.80	244.40
应收债券利息	-	35,947.48
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-517.67	-2,213.63
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	9.50	11.40
合计	1,783.27	34,431.23

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	52,253.37	50,764.76
银行间市场应付交易费用	100.00	100.00

合计	52,353.37	50,864.76

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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	45,000.00	160,000.00
合计	45,000.00	160,000.00

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	28,860,128.62	28,860,128.62
本期申购	7,102,917.61	7,102,917.61
本期赎回（以“-”号填列）	-14,353,542.00	-14,353,542.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	21,609,504.23	21,609,504.23

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	5,480,943.53	393,185.42	5,874,128.95
本期利润	3,210,080.59	-3,341,995.49	-131,914.90
本期基金份额交易产生的变动数	-1,548,813.51	-292,827.87	-1,841,641.38
其中：基金申购款	2,021,745.53	-1,080,064.54	941,680.99
基金赎回款	-3,570,559.04	787,236.67	-2,783,322.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,142,210.61	-3,241,637.94	3,900,572.67

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	29,508.89	36,667.89
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	9,221.07	12,733.55
其他	427.25	599.39
合计	39,157.21	50,000.83

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,770,917.45	6,789,030.97
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	3,770,917.45	6,789,030.97

7.4.7.12.2 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 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
卖出股票成交总额	193,512,658.38	183,434,359.08
减：卖出股票成本总额	189,741,740.93	176,645,328.11
买卖股票差价收入	3,770,917.45	6,789,030.97

7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

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
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-21,968.91	74,298.16
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	-21,968.91	74,298.16

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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,162,479.44	24,761,561.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,143,738.63	24,314,362.82
减：应收利息总额	40,709.72	372,900.44
买卖债券差价收入	-21,968.91	74,298.16

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金投资范围无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金投资范围无贵金属投资。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金投资范围无贵金属投资。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金投资范围无贵金属投资。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——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	204,054.89	723,956.50
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	204,054.89	723,956.50

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	-3,341,995.49	994,593.21
——股票投资	-3,362,934.12	1,069,629.15
——债券投资	20,938.63	-75,035.94

——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	-3,341,995.49	994,593.21

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	9,858.74	4,836.44
其他	70,000.00	-
转换费收入	-	0.07
合计	79,858.74	4,836.51

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	502,752.28	449,715.17
银行间市场交易费用	-	175.00
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	502,752.28	449,890.17

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	-
信息披露费	-	120,000.00

证券出借违约金	-	-
其他手续费	1,200.00	-8,740.05
账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行费用	5,251.39	6,130.00
合计	92,451.39	153,389.95

7.4.7.21 分部报告

无。

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或有事项 。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华融基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
华融证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构、原基金管理人
中国华融资产管理股份有限公司	基金管理人股东的控股股东
华融瑞泽投资管理有限公司	基金管理人股东控股的公司
华融期货有限责任公司	基金管理人股东控股的公司
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

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
华融证券股份有限公司	-	-	129,757,421.62	40.40%

7.4.10.1.2 债券交易

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
华融证券股份有限公司	-	-	9,347,333.04	48.95%

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	
	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
华融证券股份有限公司	-	-	518,500,000.00	32.27%

7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

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
-	-	-	-	-
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
华融证券股份有限公司	96,370.75	40.77%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	364,666.84	774,370.90
其中：支付销售机构的客户维护费	159,920.53	459,864.33

注：①支付基金管理人的基金管理费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。

②基金管理费计算公式为：日基金管理费＝前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

③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，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	60,777.78	129,061.81

注：①支付基金托管人的基金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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

本报告期及上年度可比期间，本基金未产生销售服务费。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行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

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期内基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	7,396,026.45	29,508.89	2,376,727.31	36,667.89

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内未持有因认购新发/增发而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末，本基金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

本基金一贯的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了以合规与风险控制委员会为核心，由合规与风险控制委员会、督察长、风险管理部、法律合规/监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

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。

本基金的投资范围及投资比例符合法律法规的要求、监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系，对发行人及债券进行内部评级，控制可能

出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在托管行。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并设定交易额度，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	1,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	1,000.00

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持的全部证券在证券交易所上市，因此均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

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岗位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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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%。

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。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%。

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。

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办法：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；在开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	7,396,026.45	-	-	-	-	-	7,396,026.45
结算备付金	255,095.96	-	-	-	-	-	255,095.96
存出保证金	21,124.95	-	-	-	-	-	21,124.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	15,657,190.00	15,657,190.00
买入返售金融资产	6,000,000.00	-	-	-	-	-	6,000,000.00
应收利息	-	-	-	-	-	1,783.27	1,783.27
应收申购款	-	-	-	-	-	99.88	99.88

资产总计	13,672,247.36	-	-	-	-	15,659,073.15	29,331,320.51
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	3,687,095.72	3,687,095.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	31,538.18	31,538.18
应付托管费	-	-	-	-	-	5,256.34	5,256.34
应付交易费用	-	-	-	-	-	52,353.37	52,353.37
其他负债	-	-	-	-	-	45,000.00	45,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,821,243.61	3,821,243.61
利率敏感度缺口	13,672,247.36	-	-	-	-	11,837,829.54	25,510,076.90
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	2,376,727.31	-	-	-	-	-	2,376,727.31
结算备付金	543,097.77	-	-	-	-	-	543,097.77
存出保证金	25,449.35	-	-	-	-	-	25,449.35
交易性金融资产	-	-	2,023,800.00	-	1,000.00	24,519,784.00	26,544,584.00
买入返售金融资产	5,800,000.00	-	-	-	-	-	5,800,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	690,528.81	690,528.81
应收利息	-	-	-	-	-	34,431.23	34,431.23
资产总计	8,745,274.43	-	2,023,800.00	-	1,000.00	25,244,744.04	36,014,818.47
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	578,058.26	578,058.26
应付赎回款	-	-	-	-	-	438,891.98	438,891.98
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	45,210.76	45,210.76
应付托管费	-	-	-	-	-	7,535.14	7,535.14
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,864.76	50,864.76
其他负债	-	-	-	-	-	160,000.00	160,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,280,560.90	1,280,560.90

利率敏感度缺口	8,745,274.43	-	2,023,800.00	-	1,000.00	23,964,183.14	34,734,257.57

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
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 ）
	利率下降 25 个基点	-	2,889.33
	利率上升 25 个基点	-	-2,881.35

注：本报告期末未持有债券,利率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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的股票价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以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	15,657,190.00	61.38	24,519,784.00	70.59
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	2,024,800.00	5.83
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	15,657,190.00	61.38	26,544,584.00	76.42

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定沪深 300 指数变化 5%，其他市场变量均不发生变化。		
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%	752,547.27	1,233,066.14
	2.沪深 300 指数下降 5%	-752,547.27	-1,233,066.14

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

本基金非以公允价值计量的金融工具，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

（1）金融工具公允价值计量的方法

根据企业会计准则的相关规定，以公允价值计量的金融工具，其公允价值的计量可分为三个层次：

第一层次：对存在活跃市场报价的金融工具，可以相同资产/负债在活跃市场上的报价确定公允价值。

第二层次：对估值日活跃市场无报价的金融工具，可以类似资产/负债在活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值；对估值日不存在活跃市场的金融工具，可以相同或类似资产/负债在非活跃市场上的报价为依据做必要调整确定公允价值。

第三层次：对无法获得相同或类似资产可比市场交易价格的金融工具，可以其他反映市场参与者对资产/负债定价时所使用的参数为依据确定公允价值。

(2)各层次金融工具公允价值

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 15,657,190.00 元，无属于第二层次的余额，无属于第三层次的余额（2020 年 12 月 31 日：第一层次的余额为人民币 24,519,784.00 元，属于第二层次的余额为人民币 2,024,800.00 元，无属于第三层次的余额）。

(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可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金持有的以公允价值计量的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动（2020 年：无）。

7.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.14.3 其他事项

于本报告期内，本基金存在连续二十个工作日或连续六十个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元的情况，出现该情况的时间范围为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2022 年 3 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	15,657,190.00	53.38
	其中：股票	15,657,190.00	53.38
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	6,000,000.00	20.46
	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	7,651,122.41	26.09
8	其他各项资产	23,008.10	0.08
9	合计	29,331,320.51	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	385,800.00	1.51
B	采矿业	677,520.00	2.66
C	制造业	6,816,560.00	26.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	549,120.00	2.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,236,540.00	4.85
J	金融业	-	-
K	房地产业	3,475,550.00	13.62
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,056,000.00	4.14

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,460,100.00	5.72
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	15,657,190.00	61.38

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投资股票。

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	000002	万科 A	80,000	1,580,800.00	6.20
2	002044	美年健康	186,000	1,460,100.00	5.72
3	000888	峨眉山 A	160,000	1,056,000.00	4.14
4	688111	金山办公	3,000	795,000.00	3.12
5	600383	金地集团	60,000	778,200.00	3.05
6	601155	新城控股	25,000	728,250.00	2.85
7	603587	地素时尚	36,000	689,760.00	2.70
8	300577	开润股份	30,000	685,800.00	2.69
9	600547	山东黄金	36,000	677,520.00	2.66
10	300751	迈为股份	1,000	642,300.00	2.52
11	603324	盛剑环境	10,000	586,600.00	2.30
12	003022	联泓新科	16,000	583,040.00	2.29
13	002007	华兰生物	20,000	582,800.00	2.28
14	300908	仲景食品	10,000	542,000.00	2.12
15	605318	法狮龙	30,000	457,200.00	1.79
16	300017	网宿科技	66,000	441,540.00	1.73
17	688526	科前生物	16,000	440,480.00	1.73
18	000863	三湘印象	110,000	388,300.00	1.52
19	001201	东瑞股份	10,000	385,800.00	1.51
20	002861	瀛通通讯	30,000	381,000.00	1.49
21	600059	古越龙山	30,000	366,900.00	1.44
22	000959	首钢股份	60,000	343,800.00	1.35
23	601007	金陵饭店	60,000	343,200.00	1.35
24	688580	伟思医疗	3,000	326,400.00	1.28
25	301073	君亭酒店	6,000	205,920.00	0.81

26	603558	健盛集团	16,000	188,480.00	0.74

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	000002	万科 A	4,892,561.00	14.09
2	000568	泸州老窖	3,795,934.38	10.93
3	000001	平安银行	2,790,649.00	8.03
4	002007	华兰生物	2,726,893.00	7.85
5	600703	三安光电	2,494,477.00	7.18
6	600036	招商银行	2,442,221.00	7.03
7	601166	兴业银行	2,390,700.00	6.88
8	002304	洋河股份	2,315,967.00	6.67
9	600161	天坛生物	2,229,387.00	6.42
10	002025	航天电器	2,149,704.00	6.19
11	002142	宁波银行	2,078,539.00	5.98
12	600999	招商证券	2,035,589.00	5.86
13	601398	工商银行	2,020,000.00	5.82
14	600893	航发动力	1,992,050.00	5.74
15	002475	立讯精密	1,991,096.56	5.73
16	601658	邮储银行	1,986,700.00	5.72
17	002044	美年健康	1,984,564.00	5.71
18	601939	建设银行	1,924,500.00	5.54
19	300059	东方财富	1,904,027.00	5.48
20	600383	金地集团	1,881,760.00	5.42
21	601009	南京银行	1,819,010.00	5.24
22	601628	中国人寿	1,810,857.00	5.21
23	688111	金山办公	1,698,592.11	4.89
24	600926	杭州银行	1,696,598.00	4.88
25	300724	捷佳伟创	1,611,790.00	4.64
26	000858	五粮液	1,576,837.00	4.54
27	600919	江苏银行	1,542,900.00	4.44
28	003022	联泓新科	1,541,781.00	4.44

29	600030	中信证券	1,510,380.00	4.35
30	601155	新城控股	1,483,896.00	4.27
31	600309	万华化学	1,384,843.00	3.99
32	600765	中航重机	1,380,370.00	3.97
33	600426	华鲁恒升	1,377,805.30	3.97
34	603589	口子窖	1,373,724.00	3.95
35	605009	豪悦护理	1,356,520.00	3.91
36	601318	中国平安	1,338,566.00	3.85
37	000338	潍柴动力	1,316,522.00	3.79
38	688396	华润微	1,313,654.97	3.78
39	600570	恒生电子	1,278,643.00	3.68
40	600276	恒瑞医药	1,225,654.00	3.53
41	688095	福昕软件	1,218,582.00	3.51
42	300298	三诺生物	1,191,596.00	3.43
43	300773	拉卡拉	1,189,598.00	3.42
44	002385	大北农	1,185,340.00	3.41
45	603587	地素时尚	1,150,598.00	3.31
46	688536	思瑞浦	1,146,043.30	3.30
47	000860	顺鑫农业	1,134,918.00	3.27
48	600519	贵州茅台	1,130,090.00	3.25
49	002049	紫光国微	1,104,814.20	3.18
50	601778	晶科科技	1,071,488.00	3.08
51	688388	嘉元科技	1,064,536.93	3.06
52	300577	开润股份	1,062,848.00	3.06
53	300751	迈为股份	1,051,659.00	3.03
54	603324	盛剑环境	1,043,574.00	3.00
55	300699	光威复材	1,034,278.00	2.98
56	000888	峨眉山 A	1,029,430.00	2.96
57	601601	中国太保	992,911.00	2.86
58	601995	中金公司	979,589.00	2.82
59	002920	德赛西威	967,758.00	2.79
60	300357	我武生物	950,670.00	2.74
61	688006	杭可科技	950,042.12	2.74
62	603288	海天味业	934,283.50	2.69
63	002129	中环股份	912,654.00	2.63
64	600887	伊利股份	910,586.00	2.62

65	300529	健帆生物	907,030.00	2.61
66	000768	中航西飞	901,093.00	2.59
67	002371	北方华创	895,297.00	2.58
68	000596	古井贡酒	876,677.00	2.52
69	603993	洛阳钼业	855,000.00	2.46
70	600585	海螺水泥	851,275.00	2.45
71	002422	科伦药业	818,553.00	2.36
72	600011	华能国际	791,800.00	2.28
73	603888	新华网	773,870.00	2.23
74	600456	宝钛股份	748,470.00	2.15
75	688012	中微公司	747,403.00	2.15
76	603369	今世缘	740,337.00	2.13
77	688356	键凯科技	731,852.00	2.11
78	600547	山东黄金	723,710.00	2.08
79	603558	健盛集团	720,526.00	2.07
80	002230	科大讯飞	712,230.28	2.05
81	688510	航亚科技	711,100.00	2.05
82	688179	阿拉丁	704,583.97	2.03

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	000002	万科 A	3,994,963.00	11.50
2	000568	泸州老窖	3,670,532.00	10.57
3	600519	贵州茅台	3,513,020.00	10.11
4	600036	招商银行	3,381,634.00	9.74
5	000001	平安银行	2,797,605.00	8.05
6	002304	洋河股份	2,738,930.00	7.89
7	002142	宁波银行	2,634,757.00	7.59
8	600703	三安光电	2,591,192.00	7.46
9	601398	工商银行	2,548,000.00	7.34
10	601166	兴业银行	2,458,874.00	7.08
11	002007	华兰生物	2,444,272.00	7.04
12	600030	中信证券	2,438,408.00	7.02
13	600161	天坛生物	2,358,169.52	6.79

14	601939	建设银行	2,206,850.00	6.35
15	002025	航天电器	2,128,684.00	6.13
16	600893	航发动力	2,115,149.00	6.09
17	002475	立讯精密	2,036,794.00	5.86
18	600999	招商证券	2,008,741.00	5.78
19	600926	杭州银行	1,971,949.00	5.68
20	300059	东方财富	1,963,333.00	5.65
21	601658	邮储银行	1,907,281.00	5.49
22	000338	潍柴动力	1,868,162.00	5.38
23	601009	南京银行	1,856,174.00	5.34
24	600276	恒瑞医药	1,852,086.00	5.33
25	601628	中国人寿	1,831,539.00	5.27
26	600383	金地集团	1,792,810.00	5.16
27	300724	捷佳伟创	1,757,958.00	5.06
28	000858	五粮液	1,741,481.00	5.01
29	600309	万华化学	1,724,010.00	4.96
30	600887	伊利股份	1,610,008.00	4.64
31	601318	中国平安	1,584,870.57	4.56
32	600426	华鲁恒升	1,576,198.00	4.54
33	600919	江苏银行	1,485,370.00	4.28
34	000538	云南白药	1,416,227.00	4.08
35	600585	海螺水泥	1,392,310.00	4.01
36	688396	华润微	1,388,768.70	4.00
37	600765	中航重机	1,378,322.00	3.97
38	603589	口子窖	1,365,175.00	3.93
39	605009	豪悦护理	1,317,091.36	3.79
40	600570	恒生电子	1,277,499.20	3.68
41	002385	大北农	1,226,022.00	3.53
42	300773	拉卡拉	1,214,520.00	3.50
43	300298	三诺生物	1,214,254.00	3.50
44	688095	福昕软件	1,207,442.35	3.48
45	688111	金山办公	1,192,836.00	3.43
46	600660	福耀玻璃	1,182,729.00	3.41
47	000333	美的集团	1,182,471.00	3.40
48	601778	晶科科技	1,181,586.00	3.40
49	688536	思瑞浦	1,167,597.37	3.36
50	600009	上海机场	1,139,554.00	3.28
51	002049	紫光国微	1,117,179.00	3.22

52	000860	顺鑫农业	1,109,017.00	3.19
53	688388	嘉元科技	1,092,296.98	3.14
54	600900	长江电力	1,087,664.00	3.13
55	300529	健帆生物	1,037,023.00	2.99
56	600741	华域汽车	1,029,452.71	2.96
57	300699	光威复材	1,005,900.04	2.90
58	688006	杭可科技	988,857.94	2.85
59	601995	中金公司	968,963.00	2.79
60	603993	洛阳钼业	966,528.00	2.78
61	603288	海天味业	958,944.77	2.76
62	601601	中国太保	950,199.80	2.74
63	000768	中航西飞	949,811.00	2.73
64	601899	紫金矿业	941,620.00	2.71
65	003022	联泓新科	934,961.00	2.69
66	002230	科大讯飞	929,128.00	2.67
67	002129	中环股份	909,541.00	2.62
68	603888	新华网	907,583.00	2.61
69	300357	我武生物	904,006.00	2.60
70	600011	华能国际	897,580.00	2.58
71	000596	古井贡酒	867,924.00	2.50
72	002422	科伦药业	848,749.00	2.44
73	601012	隆基股份	843,330.00	2.43
74	002920	德赛西威	835,444.00	2.41
75	002371	北方华创	833,949.00	2.40
76	688012	中微公司	809,496.26	2.33
77	000651	格力电器	795,955.00	2.29
78	600380	健康元	780,357.00	2.25
79	600456	宝钛股份	754,219.00	2.17
80	601336	新华保险	749,544.00	2.16
81	001979	招商蛇口	744,009.00	2.14
82	603369	今世缘	739,155.00	2.13
83	002935	天奥电子	738,565.00	2.13
84	300601	康泰生物	735,742.00	2.12
85	688179	阿拉丁	728,946.76	2.10
86	688356	键凯科技	716,685.00	2.06
87	601155	新城控股	700,918.00	2.02
88	300122	智飞生物	695,773.00	2.00
89	603939	益丰药房	695,428.00	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	184,242,081.05
卖出股票收入（成交）总额	193,512,658.38

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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投资。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未进行国债期货投资

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金未进行国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、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

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	21,124.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,783.27
5	应收申购款	99.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,008.10

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。

§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
900	24,010.56	4,614.22	0.02%	21,604,890.01	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	59,590.98	0.2800%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

截止本报告期末，本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 4 月 15 日 ）基金份额总额	1,010,044,560.32
本报告期期初基金份额总额	28,860,128.62
本报告期基金总申购份额	7,102,917.61
减:本报告期基金总赎回份额	14,353,542.00
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	21,609,504.23

§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

基金管理人于 2021 年 3 月 12 日发布《华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，丁卓先生自 2021 年 3 月 11 日起担任华融基金管理有限公司总经理，李骥先生不再担任公司总经理。

基金管理人于 2021 年 4 月 21 日发布《华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，毕子男先生自 2021 年 4 月 19 日起担任华融基金管理有限公司首席投资官。

基金管理人于 2021 年 6 月 4 日发布《华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，丁卓先生自 2021 年 6 月 2 日起代为履行华融基金管理有限公司董事长职务，冷慧卿女士不再担任公司董事长。

基金管理人于 2021 年 8 月 4 日发布《华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，杨铭海先生自 2021 年 8 月 2 日起担任华融基金管理有限公司董事长，丁卓先生不再代为履行公司董事长职务。

本基金托管人于 2021 年 5 月任命谭敦宇女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部总裁，于 2021 年 8 月任命王霄勇先生为中国农业银行股份有限公司托管业务部副总裁。

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，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

本报告期内本基金应向安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）支付审计费用为 45,000 元。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人及其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	
天风证券	1	135,770,020.54	35.95%	99,252.14	35.99%	-
中泰证券	2	106,184,611.28	28.12%	77,648.43	28.16%	-
财达证券	2	96,826,427.23	25.64%	70,776.62	25.67%	-
国泰君安	2	38,889,186.36	10.30%	28,064.82	10.18%	-
华福证券	2	-	-	-	-	-

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
天风证券	22,932.30	2.01%	629,000,000.00	65.51%	-	-
中泰证券	1,035,661.11	90.75%	217,300,000.00	22.63%	-	-
财达证券	82,586.03	7.24%	87,800,000.00	9.14%	-	-
国泰君安	-	-	26,000,000.00	2.71%	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

注：1、租用证券公司交易单元的选择标准：

（1）资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 10 亿元人民币；

（2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（3）经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证券监督管理委员会和中国人民银行处罚；

（4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；

（6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场投资策略、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求提供专门研究报告；

（7）收取的佣金率符合市场平均水平。

2、交易单元选择程序：我司根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金报告期内新增租用交易单元情况：新增财达证券交易单元 2 个、国泰君安证券交易单元 2 个、华福证券交易单元 2 个。

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	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 1 月 22 日
2	华融基金管理有限公司旗下基金 2020 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 1 月 22 日
3	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 12 日
4	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 3 月 31 日
5	华融基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 3 月 31 日
6	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 21 日
7	华融新锐灵活配置混合型证券投	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网	2021 年 4 月 22 日

	资基金 2021 年第 1 季度报告	站	
8	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 4 月 22 日
9	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 27 日
10	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 4 月 27 日
11	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 6 月 4 日
12	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 7 月 21 日
13	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 7 月 21 日
14	华融基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 4 日
15	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 8 月 31 日
16	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 8 月 31 日
17	华融基金管理有限公司关于开展网上直销和直销柜台费率优惠的公告	上海证券报、证券时报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 1 日
18	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 8 日
19	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 8 日
20	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 8 日

21	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 17 日
22	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 17 日
23	华融新锐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、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 9 月 17 日
24	华融新锐灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 10 月 27 日
25	华融基金管理有限公司旗下基金 2021 年 3 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报	2021 年 10 月 27 日
26	华融基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信建投证券为销售机构及开通相关业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 16 日
27	华融基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金投资北交所上市股票的风险提示性公告	证券时报、上海证券报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2021 年 11 月 17 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

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内未发生影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件

2、《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

3、《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

4、《华融新锐灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、基金托管人业务资格批件、营业执照

7、报告期内本基金管理人在指定媒体上披露的各项公告

13.2 存放地点

上述备查文件存放在本基金管理人或基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.hr-fund.com.cn）查阅。

华融基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日