

新华灵活主题混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 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.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
7.3 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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	40
7.6 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.....	40
7.7 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.....	40
7.8 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.....	40
7.9 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.....	40
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 本报告期投资基金情况.....	41
7.13 投资组合报告附注.....	41
8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 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	42
9 开放式基金份额变动	43
10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
10.2 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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	43
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.9 其他重大事件	45
11 影响投资者决策的其他重要信息	47
12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录	47
12.2 存放地点	48
12.3 查阅方式	48

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	新华灵活主题混合型证券投资基金
基金简称	新华灵活主题混合
基金主代码	519099
交易代码	519099
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 7 月 13 日
基金管理人	新华基金管理股份有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,276,077.20 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以主题投资为核心，前瞻性挖掘市场的长期主题趋势，动态把握市场阶段性的主题转换，并精选获益程度高的主题个股进行投资，在风险可控的前提下追求基金资产净值的持续、稳定增长。
投资策略	本基金以战略性与战术性资产配置策略为指导，围绕市场的长期性和阶段性投资主题进行动态配置，并精选获益程度最高的主题个股群进行重点投资。
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数收益率+ 20%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，基金资产整体的预期收益和预期风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理股份有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	齐岩	姜敏
	联系电话	010-68779688	4006800000
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		4008198866	95558
传真		010-68779528	010-85230024
注册地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
办公地址		重庆市江北区聚贤岩广场6号 力帆中心2号楼19层	北京市朝阳区光华路10号院1 号楼6-30层、32-42层
邮政编码		400010	100020
法定代表人		翟晨曦	朱鹤新

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ncfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-3,753,574.68
本期利润	-3,959,256.28
加权平均基金份额本期利润	-0.4799
本期加权平均净值利润率	-23.30%
本期基金份额净值增长率	-19.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,737,905.00
期末可供分配基金份额利润	0.9350
期末基金资产净值	16,013,982.20
期末基金份额净值	1.9350
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	158.45%

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

2、以上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（例如基金申购费赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中为分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	2.49%	1.39%	7.69%	0.86%	-5.20%	0.53%
过去三个月	-8.87%	1.52%	5.27%	1.15%	-14.14%	0.37%
过去六个月	-19.89%	1.45%	-6.88%	1.16%	-13.01%	0.29%
过去一年	-18.71%	1.64%	-10.41%	1.00%	-8.30%	0.64%
过去三年	42.59%	1.39%	17.45%	1.01%	25.14%	0.38%
自基金合同生 效起至今	158.45%	1.56%	54.40%	1.14%	104.05%	0.42%

注：1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深 300 指数率，债券投资部分的业绩比较基准选择上证国债指数收益率，复合业绩比较基准为 80%×沪深 300 指数收益率+20%×上证国债指数收益率。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华灵活主题混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2011 年 7 月 13 日至 2022 年 6 月 30 日)



注：1、本基金于 2011 年 7 月 13 日基金合同生效。

2、报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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

新华基金管理股份有限公司经中国证券监督管理委员会批复，于 2004 年 12 月 9 日注册成立。注册地为重庆市，是我国西部首家基金管理公司。

截至 2022 年 6 月 30 日，新华基金管理股份有限公司旗下管理着五十二只开放式基金，即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长混合型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业混合型证券投资基金、新华行业周期轮换混合型证券投资基金、新华中小市值优选混合型证券投资基金、新华灵活主题混合型证券投资基金、新华优选消费混合型证券投资基金、新华纯债添利债券型发起式证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、新华趋势领航混合型证券投资基金、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金、新华壹诺宝货币市场基金、新华增怡债券型证券投资基金、新华鑫益灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、新华中证环保产业指数证券投资基金、新华活期添利货币市场基金、新华增盈回报债券型证券投资基金、新华策略精选股票型证券投资基金、新华万银多元策略灵活配置混合型证券投资基金、新华稳健回报灵活配置混合型发起式证券投资基金、新华战略新兴产业灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫回报混合型证券投资基金、新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金、新华科技创新主题灵活配置混合型证券投资基金、新华增强债券型证券投资基金、新华鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、新华双利债券型证券投资基金、新华丰利债券型证券投资基金、新华外延增长主题灵活配置混合型证券投资基金、新华红利回报混合型证券投资基金、新华鑫泰灵活配置混合型证券投资基金、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金、新华安享多裕定期开放灵活配置混合型证券投资基金、新华恒稳添利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、新华鑫日享中短债债券型证券投资基金、新华聚利债券型证券投资基金、新华鼎利债券型证券投资基金、新华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、新华沪深 300 指数增强型证券投资基金、新华安享惠泽 39 个月定期开放债券型证券投资基金、新华精选成长主题 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、新华景气行业混合型证券投资基金、新华安享惠融 88 个月定期开放债券型证券投资基金、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金、新华利率债债券型证券投资基金、新华行业龙头主题股票型证券投资基金、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金、新华中证云计算 50 交易型开放式指数证券投资基金、

新华中债 1-5 年农发行债券指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王永明	本基金基金经理，新华积极价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫弘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华鑫科技 3 个月滚动持有灵活配置混合型证券投资基金基金经理、新华中小市值优选混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理。	2021-02-19	2022-06-23	24	经济学博士，历任西南证券资产管理部研究员、恒泰证券研发中心经理、上海名禹资产管理有限公司研究总监、上海尚阳投资管理有限公司投资总监。
张媛	本基金基金经理。	2021-10-21	-	13	金融学和管理学硕士，历任北京新宝集研究总监、汇安基金研究部副总监、基金经理助理，国联证券主题策略研究员。

注：1、首任基金经理，任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司作出决定之日。

2、非首任基金经理，任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末不存在基金经理同时兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华灵活主题混合型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华灵活主题混合型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理有限公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

场内交易，投资指令统一由交易部下达，并且启动交易系统公平交易模块。根据公司制度，严格禁止不同投资组合之间互为对手方的交易，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易。

场外交易中，对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易，交易部根据各投资组合经理申报的满足价格条件的数量进行比例分配。如有异议，由交易部报投资总监、督察长、金融工程部和监察稽核部，再次进行审核并确定最终分配结果。如果督察长认为有必要，可以召开风险管理委员会会议，对公平交易的结果进行评估和审议。对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易，投资组合经理以该投资组合的名义向交易部下达投资指令，交易部向银行间市场或交易对手询价、成交确认，并根据“时间优先、价格优先”的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内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成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

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

今年上半年市场呈现 V 型走势。4 月底前 A 股受地缘事件爆发、美联储启动加息、国内疫情反复等多重影响，主要指数均出现较大回撤，其中前期高景气赛道回撤居前，申万一级行业中仅煤炭

板块上涨。随着稳经济措施陆续出台，以及国内疫情逐渐企稳，4 月底市场开始强势反弹，以新能源和汽车为首的先进制造带领市场节奏并大举收付失地。

本基金在市场下跌阶段对仓位进行了一定控制，并在“能源替代”主题下配置了年初预期差较大的煤炭等传统能源，对控制回撤有所帮助。但在市场上涨阶段，产品在表现最为强势的新能源、汽车等行业上布局较少，导致产品表现落后于市场。下半年，本基金在继续围绕长期主题布局的同时，会加强顺应市场风格变化的持仓结构调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.9350 元，本报告期份额净值增长率为-19.89%，同期比较基准的增长率为-6.88%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年全球经济增长受制于高通胀和加息周期，难言乐观。国内经济继续从疫情中恢复，政策以“稳”为主，流动性在内外大环境下进一步宽松空间有限。下半年市场仍以结构性机会为主。主题策略聚焦长期趋势性变化带来的投资机会，展望下半年，我们认为能源替代仍是当前最值得关注的主题。

能源替代现阶段其最核心问题是减碳愿景下传统能源投资不足与能源转型初期对传统能源的依赖度不减反增的矛盾。今年上半年能源价格上涨并没有带动投资的明显上升，供应不足将是长期问题。短期，地缘事件引发的能源贸易格局改变，极端天气的频发等加剧能源的时间、空间错配，也对全球电力系统提出新的挑战。本基金在能源主题下继续关注旧能源、新能源的平衡发展，以及新型电力系统建设带动的机会。

其他主题方面，本基金持续关注“大国博弈”带动的军工、半导体、信创领域机会和“元宇宙”发展中的虚拟人、数字货币等机会。

本基金以长期主题趋势为基础，结合行业景气度和市场风格，持续优化组合配置。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本基金管理人设有估值小组，负责对各类投资品种的估值方法、估值模型等进行研究和论证，组织制定和适时修订估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。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，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。

4.8 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

本报告期本基金从 2022 年 1 月 4 日至 2022 年 6 月 30 日连续一百一十七个工作日，基金资产净值低于五千万元。我司将通过多方面的措施促进本基金的规模增长，具体经营计划如下：

- （一）与主要销售机构合作制定销售计划，以重点地区为主，将公司的资源向重点地区倾斜。
- （二）进一步加强与潜在销售机构的合作，拓宽渠道和客户资源。
- （三）采用新客户开发与老客户深入挖掘并重的客户开发方式。

（四）加强投资者教育，引导投资者充分认识产品的风险收益特点。综上所述，本基金为我司产品线主要组成部分。受市场环境的影响，本基金规模出现缩减。我司将在做好基金日常投资运营的同时，加大持续营销工作投入，同时探索其他方式和手段，尽力提升基金规模。

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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对新华灵活主题混合型证券投资基金 2022 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在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，新华基金管理股份有限公司在新华灵活主题混合型证券投资基金的投资运作、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 托管人对本中期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，新华基金管理股份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 2022 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：新华灵活主题混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,199,308.50	5,704,349.67
结算备付金		1,716,180.53	74,004.92
存出保证金		13,313.01	18,454.38
交易性金融资产	6.4.7.2	13,360,667.00	14,460,064.98
其中：股票投资		13,360,667.00	14,460,064.98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		11,728.23	5,730.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,330.17
资产总计		16,301,197.27	20,263,934.78
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		54,675.66	2,521.53
应付管理人报酬		19,573.13	25,912.82
应付托管费		3,262.18	4,318.81
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	209,704.10	199,018.54
负债合计		287,215.07	231,771.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	8,276,077.20	8,293,936.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.11	7,737,905.00	11,738,226.27
净资产合计		16,013,982.20	20,032,163.08
负债和净资产总计		16,301,197.27	20,263,934.78

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.9350 元,基金份额总额 8,276,077.20 份。

6.2 利润表

会计主体：新华灵活主题混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-3,786,686.68	3,030,254.98
1.利息收入		13,955.35	11,459.02
其中：存款利息收入	6.4.7.12	13,955.35	11,458.22
债券利息收入		-	0.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,595,910.36	4,693,091.54
其中：股票投资收益	6.4.7.13	-3,712,954.74	4,635,295.35
基金投资收益	6.4.7.14	-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	442.61
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	117,044.38	57,353.58
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-205,681.60	-1,676,530.62
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	949.93	2,235.04
减：二、营业总支出		172,569.60	379,324.06
1. 管理人报酬		126,586.61	152,157.49
2. 托管费		21,097.80	25,359.60
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.22	24,885.19	201,806.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,959,256.28	2,650,930.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,959,256.28	2,650,930.92
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,959,256.28	2,650,930.92

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：新华灵活主题混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,293,936.81	-	11,738,226.27	20,032,163.08
二、本期期初净资产（基金净值）	8,293,936.81	-	11,738,226.27	20,032,163.08
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,859.61	-	-4,000,321.27	-4,018,180.88
（一）、综合收益	-	-	-3,959,256.28	-3,959,256.28

总额				
(二)、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)	-17,859.61	-	-41,064.99	-58,924.60
其中: 1.基金申购款	432,790.47	-	454,998.44	887,788.91
2.基金赎回款	-450,650.08	-	-496,063.43	-946,713.51
(三)、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)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,276,077.20	-	7,737,905.00	16,013,982.20
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	9,972,948.39	-	11,070,500.81	21,043,449.20
二、本期期初净资产(基金净值)	9,972,948.39	-	11,070,500.81	21,043,449.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-480,415.24	-	2,033,805.74	1,553,390.50
(一)、综合收益总额	-	-	2,650,930.92	2,650,930.92
(二)、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)	-480,415.24	-	-617,125.18	-1,097,540.42
其中: 1.基金申购款	1,451,803.98	-	1,730,489.61	3,182,293.59
2.基金赎回款	-1,932,219.22	-	-2,347,614.79	-4,279,834.01
(三)、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)	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	9,492,533.15	-	13,104,306.55	22,596,839.70
-----------------	--------------	---	---------------	---------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：翟晨曦，主管会计工作负责人：于春玲，会计机构负责人：徐端骞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

新华灵活主题混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)系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【2011】798 号文件“关于核准新华灵活主题股票型证券投资基金募集的批复”批准,由新华基金管理股份有限公司作为发起人,于 2011 年 6 月 1 日至 7 月 8 日向社会公开募集,募集期间净认购金额为 530,360,314.99 元,认购资金在募集期间产生的利息为 85,388.20 元,并经国富浩华会计师事务所国号验字(2011)第 65 号验资报告予以验证。2011 年 7 月 13 日办理基金备案手续,基金合同正式生效。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期不限定,本基金管理人为新华基金管理股份有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《新华灵活主题混合型证券投资基金招募说明书》及《新华灵活主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,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股票(包括中小板、创业板以及其它经中国证监会核准上市的股票)、债券、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60—95%,债券投资占基金资产的比例范围为 0—40%,资产支持证券投资占基金资产净值的比例范围为 0—20%,权证投资占基金资产净值的比例范围为 0—3%,现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

本财务报表由本基金的基金管理人新华基金管理股份有限公司于 2022 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营假设为基础,按照财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定(统称“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》、《新华灵活主题混合型证券投资基金基金合同》和财务报表附注所

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的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的财务状况、经营成果和基金净值变动情况等相关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则外，本基金本报告期采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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》,本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。新金融工具准则的执行对本基金的财务状况和经营成果未产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金报告期末发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金报告期末发生差错更正。

6.4.6 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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	1,199,308.50
等于：本金	1,199,071.44
加：应计利息	237.06

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,199,308.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,765,742.26	-	13,360,667.00	594,924.74
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	12,765,742.26	-	13,360,667.00	594,924.74

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	36.46
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	184,872.45
其中：交易所市场	184,872.45
银行间市场	-
应付利息	-
审计费	24,795.19
合计	209,704.10

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,293,936.81	8,293,936.81
本期申购	432,790.47	432,790.47
本期赎回（以“-”号填列）	-450,650.08	-450,650.08

本期末	8,276,077.20	8,276,077.20
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 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	19,810,763.20	-8,072,536.93	11,738,226.27
本期利润	-3,753,574.68	-205,681.60	-3,959,256.28
本期基金份额交易产生的变动数	-66,025.35	24,960.36	-41,064.99
其中：基金申购款	918,635.69	-463,637.25	454,998.44
基金赎回款	-984,661.04	488,597.61	-496,063.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,991,163.17	-8,253,258.17	7,737,905.00

6.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,275.76
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	1,679.59
其他	-
合计	13,955.35

注：结算备付金利息收入包含结算保证金利息及存放于券商资金账户的资金利息收入。

6.4.7.13 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	80,193,370.73
减：卖出股票成本总额	83,693,553.44
减：交易费用	212,772.03
买卖股票差价收入	-3,712,954.74

6.4.7.14 基金投资收益

本基金本报告期末产生基金投资。

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期末未产生债券投资。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	117,044.38
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	117,044.38

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-205,681.60
——股票投资	-205,681.60
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-205,681.60

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	763.63
补差费收入	186.30
合计	949.93

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行汇划费	90.00
合计	24,885.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告签发日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内，本基金不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理股份有限公司	基金管理人、基金发起人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间，均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	126,586.61	152,157.49
其中：支付销售机构的客户维护费	55,030.37	66,627.54

注：基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

本报告期列示的支付销售机构的客户维护费为本期计提金额，上年度可比期间列示的支付销售机构的客户维护费为当期支付金额。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	21,097.80	25,359.60

注：基金托管费按前一日的基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间，均未与关联方进行银行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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**6.4.10.4.1 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，本基金未参与证券出借业务。

6.4.10.4.2 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，本基金未参与证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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

报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	1,199,308.50	12,275.76	1,436,093.49	10,571.81

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本报告期及上年度可比期间，本基金未参与基金投资。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间无收益分配事项。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有认购新发/增发证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至 2022 年 06 月 30 日，本基金无交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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；在银行间同业市场进行的交易通过交易对手库管理控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按短期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有按长期信用评级的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险。本基金所持大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。

除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。本报告期内，本基金资产的投资比例符合基金流动性风险管理的相关规定，流动性风险较低。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,199,308.50	-	-	-	1,199,308.50
结算备付金	1,716,180.53	-	-	-	1,716,180.53
存出保证金	13,313.01	-	-	-	13,313.01
交易性金融资产	0.00	0.00	0.00	13,360,667.00	13,360,667.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	0.00	-	-	-	0.00
债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他债权投资	-	-	-	0.00	0.00
其他权益工具投资	-	-	-	0.00	0.00
应收清算款	-	-	-	0.00	0.00
应收股利	-	-	-	0.00	0.00
应收申购款	-	-	-	11,728.23	11,728.23
递延所得税资产	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	2,928,802.04	0.00	0.00	13,372,395.23	16,301,197.27
负债					
短期借款	-	-	-	0.00	0.00
交易性金融负债	-	-	-	0.00	0.00
衍生金融负债	-	-	-	0.00	0.00
卖出回购金融资产款	0.00	-	-	-	0.00
应付清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	54,675.66	54,675.66
应付管理人报酬	-	-	-	19,573.13	19,573.13
应付托管费	-	-	-	3,262.18	3,262.18
应付销售服务费	-	-	-	0.00	0.00

应付投资顾问费	-	-	-	0.00	0.00
应交税费	-	-	-	0.00	0.00
应付利润	-	-	-	0.00	0.00
递延所得税负债	-	-	-	0.00	0.00
其他负债	-	-	-	209,704.10	209,704.10
负债总计	0.00	0.00	0.00	287,215.07	287,215.07
利率敏感度缺口	2,928,802.04	0.00	0.00	13,085,180.16	16,013,982.20
上年度末 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	5,704,349.67	-	-	-	5,704,349.67
结算备付金	74,004.92	-	-	-	74,004.92
存出保证金	18,454.38	-	-	-	18,454.38
交易性金融资产	-	-	0.00	14,460,064.98	14,460,064.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,330.17	1,330.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	5,730.66	5,730.66
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,796,808.97	0.00	0.00	14,467,125.81	20,263,934.78
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资 产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	0.00	0.00
应付赎回款	-	-	-	2,521.53	2,521.53
应付管理人报酬	-	-	-	25,912.82	25,912.82
应付托管费	-	-	-	4,318.81	4,318.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	119,010.23	119,010.23
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-

递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	80,008.31	80,008.31
负债总计	0.00	0.00	0.00	231,771.70	231,771.70
利率敏感度缺口	5,796,808.97	0.00	0.00	14,235,354.11	20,032,163.08

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，本基金无债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

在其他价格风险分析中，本基金管理人主要分析市场价格风险的影响。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	13,360,667.00	83.43	14,460,064.98	72.18
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	13,360,667.00	83.43	14,460,064.98	72.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	其他市场变量不变,沪深 300 指数上升或下降 1%		
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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	沪深 300 指数上升 1%	128,275.99	93,029.40
沪深 300 指数下降 1%	-128,275.99	-93,029.40	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	13,360,667.00
第二层次	-
第三层次	-
合计	13,360,667.00

6.4.14.2.2 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，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，确定相关股票公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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

7 投资组合报告

7.1 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	13,360,667.00	81.96
	其中：股票	13,360,667.00	81.96
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	2,915,489.03	17.89
8	其他各项资产	25,041.24	0.15
9	合计	16,301,197.27	100.00

注：结算备付金包含存放于券商结算账户中的活期存款及应收利息。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,339,990.00	27.10
C	制造业	5,827,380.00	36.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	480,200.00	3.00
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,253,577.00	14.07
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
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	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	459,520.00	2.87
S	综合	-	-
	合计	13,360,667.00	83.43

7.2.2 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。

7.3 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	000983	山西焦煤	50,000	669,500.00	4.18
2	601225	陕西煤业	30,000	635,400.00	3.97
3	000703	恒逸石化	58,000	609,580.00	3.81
4	601857	中国石油	100,000	530,000.00	3.31
5	603019	中科曙光	18,000	522,360.00	3.26
6	601088	中国神华	15,000	499,500.00	3.12
7	601985	中国核电	70,000	480,200.00	3.00
8	600348	华阳股份	30,000	463,800.00	2.90
9	600123	兰花科创	28,000	460,600.00	2.88
10	002268	卫士通	9,500	407,645.00	2.55
11	600188	兖矿能源	10,000	394,800.00	2.47
12	300036	超图软件	20,000	390,800.00	2.44
13	002230	科大讯飞	9,200	379,224.00	2.37
14	002152	广电运通	40,000	370,800.00	2.32
15	600600	XD 青岛啤	3,500	363,720.00	2.27
16	002738	中矿资源	3,800	351,918.00	2.20
17	000333	美的集团	5,500	332,145.00	2.07
18	688568	中科星图	4,800	325,248.00	2.03
19	000683	远兴能源	30,000	315,300.00	1.97
20	002466	天齐锂业	2,500	312,000.00	1.95
21	002049	紫光国微	1,600	303,552.00	1.90
22	000792	盐湖股份	10,000	299,600.00	1.87
23	002624	完美世界	20,000	287,400.00	1.79
24	688196	卓越新能	3,600	277,200.00	1.73
25	600256	广汇能源	26,000	274,040.00	1.71
26	300031	宝通科技	15,000	241,500.00	1.51
27	300474	景嘉微	3,500	239,365.00	1.49
28	300747	锐科激光	6,000	233,400.00	1.46
29	000988	华工科技	10,000	231,700.00	1.45
30	603466	风语筑	12,000	230,880.00	1.44
31	600409	三友化工	28,000	229,320.00	1.43
32	000681	视觉中国	16,000	228,640.00	1.43
33	002408	齐翔腾达	28,000	227,080.00	1.42
34	600986	浙文互联	36,000	221,760.00	1.38

35	000968	蓝焰控股	20,000	209,000.00	1.31
36	002648	卫星化学	8,000	206,800.00	1.29
37	603919	金徽酒	6,000	203,940.00	1.27
38	600583	海油工程	49,000	203,350.00	1.27
39	000807	云铝股份	20,000	197,600.00	1.23

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601857	中国石油	2,034,415.00	10.16
2	600989	宝丰能源	1,965,343.00	9.81
3	000983	山西焦煤	1,828,398.00	9.13
4	600188	兖矿能源	1,589,703.00	7.94
5	601225	陕西煤业	1,579,994.00	7.89
6	002624	完美世界	1,577,892.00	7.88
7	300438	鹏辉能源	1,570,722.00	7.84
8	600096	云天化	1,236,258.08	6.17
9	000933	神火股份	1,055,473.00	5.27
10	300474	景嘉微	1,004,928.00	5.02
11	000830	鲁西化工	921,503.00	4.60
12	601088	中国神华	848,450.00	4.24
13	600123	兰花科创	841,485.00	4.20
14	000858	五粮液	829,784.00	4.14
15	600282	南钢股份	823,790.00	4.11
16	600010	包钢股份	821,800.00	4.10
17	600581	八一钢铁	820,713.00	4.10
18	601969	海南矿业	818,949.00	4.09
19	601398	工商银行	815,925.00	4.07
20	601288	农业银行	814,350.00	4.07
21	600569	安阳钢铁	812,460.00	4.06
22	601328	交通银行	808,665.00	4.04
23	000708	中信特钢	808,534.00	4.04
24	601988	中国银行	808,469.00	4.04
25	600307	酒钢宏兴	804,733.00	4.02
26	000792	盐湖股份	784,530.00	3.92
27	000807	云铝股份	774,979.00	3.87
28	002738	中矿资源	762,422.00	3.81
29	002466	天齐锂业	749,843.00	3.74
30	600027	华电国际	748,250.00	3.74

31	600026	中远海能	717,244.00	3.58
32	002555	三七互娱	701,169.00	3.50
33	601168	西部矿业	694,722.00	3.47
34	603565	中谷物流	689,925.00	3.44
35	300595	欧普康视	689,737.00	3.44
36	601677	明泰铝业	674,096.00	3.37
37	300058	蓝色光标	669,690.00	3.34
38	002128	电投能源	668,179.00	3.34
39	603019	中科曙光	655,447.00	3.27
40	300662	科锐国际	645,091.00	3.22
41	688169	石头科技	641,872.00	3.20
42	300118	东方日升	637,848.00	3.18
43	000681	视觉中国	634,693.00	3.17
44	002268	卫士通	629,985.00	3.14
45	000703	恒逸石化	629,809.00	3.14
46	300031	宝通科技	614,145.00	3.07
47	601985	中国核电	606,840.00	3.03
48	002230	科大讯飞	604,301.00	3.02
49	300451	创业慧康	591,600.00	2.95
50	002156	通富微电	587,191.00	2.93
51	601001	晋控煤业	584,550.00	2.92
52	600426	华鲁恒升	567,813.00	2.83
53	002049	紫光国微	552,309.00	2.76
54	000683	远兴能源	530,960.00	2.65
55	002532	天山铝业	529,488.00	2.64
56	600926	杭州银行	524,019.00	2.62
57	601669	中国电建	493,885.00	2.47
58	000060	中金岭南	486,355.00	2.43
59	600546	山煤国际	475,946.00	2.38
60	601699	潞安环能	460,486.00	2.30
61	600021	上海电力	459,130.00	2.29
62	600251	冠农股份	457,652.00	2.28
63	600522	中天科技	457,332.00	2.28
64	002041	登海种业	456,103.00	2.28
65	688599	天合光能	456,000.00	2.28
66	002318	久立特材	455,676.00	2.27
67	688063	派能科技	452,975.00	2.26
68	000547	航天发展	451,680.00	2.25
69	603606	东方电缆	450,180.00	2.25
70	601872	招商轮船	449,820.00	2.25
71	600348	华阳股份	449,181.00	2.24
72	300087	荃银高科	447,677.00	2.23
73	601600	中国铝业	442,160.00	2.21
74	002648	卫星化学	440,527.00	2.20

75	000968	蓝焰控股	430,893.00	2.15
76	600988	赤峰黄金	428,840.00	2.14
77	600583	海油工程	427,510.00	2.13
78	600190	锦州港	424,488.00	2.12
79	300850	新强联	407,254.00	2.03
80	600812	华北制药	403,619.00	2.01

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

7.4.2 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	600989	宝丰能源	1,859,604.00	9.28
2	600188	兖矿能源	1,584,520.00	7.91
3	601225	陕西煤业	1,557,975.00	7.78
4	002624	完美世界	1,551,109.00	7.74
5	300438	鹏辉能源	1,505,916.00	7.52
6	601857	中国石油	1,475,630.00	7.37
7	600096	云天化	1,278,377.00	6.38
8	000983	山西焦煤	1,219,572.00	6.09
9	002555	三七互娱	1,139,239.00	5.69
10	000933	神火股份	1,073,659.00	5.36
11	603606	东方电缆	1,047,228.00	5.23
12	601088	中国神华	1,007,246.00	5.03
13	000830	鲁西化工	894,155.00	4.46
14	600038	中直股份	854,219.00	4.26
15	601398	工商银行	831,450.00	4.15
16	601988	中国银行	825,990.00	4.12
17	601328	交通银行	824,615.00	4.12
18	601288	农业银行	817,020.00	4.08
19	000858	五粮液	791,181.00	3.95
20	600027	华电国际	768,000.00	3.83
21	300058	蓝色光标	762,730.00	3.81
22	002756	永兴材料	749,784.00	3.74
23	600010	包钢股份	748,000.00	3.73
24	601969	海南矿业	727,200.00	3.63
25	300274	阳光电源	713,568.00	3.56
26	300014	亿纬锂能	707,660.00	3.53
27	600282	南钢股份	704,330.00	3.52
28	300118	东方日升	691,683.00	3.45
29	601388	怡球资源	685,429.00	3.42

30	000708	中信特钢	682,108.00	3.41
31	600026	中远海能	681,544.00	3.40
32	601168	西部矿业	680,412.86	3.40
33	000681	视觉中国	677,236.00	3.38
34	688169	石头科技	673,221.50	3.36
35	300474	景嘉微	670,973.32	3.35
36	600307	酒钢宏兴	659,141.00	3.29
37	603565	中谷物流	656,903.44	3.28
38	300595	欧普康视	646,815.00	3.23
39	002128	电投能源	627,135.00	3.13
40	600569	安阳钢铁	612,790.00	3.06
41	600546	山煤国际	609,200.00	3.04
42	601677	明泰铝业	602,124.00	3.01
43	600581	八一钢铁	599,550.00	2.99
44	002156	通富微电	595,438.00	2.97
45	300662	科锐国际	592,824.00	2.96
46	600123	兰花科创	585,822.00	2.92
47	601872	招商轮船	571,914.00	2.85
48	000968	蓝焰控股	569,880.00	2.84
49	000807	云铝股份	554,800.00	2.77
50	600988	赤峰黄金	550,730.00	2.75
51	600426	华鲁恒升	544,275.00	2.72
52	601001	晋控煤业	531,106.00	2.65
53	688599	天合光能	528,603.93	2.64
54	688063	派能科技	500,644.33	2.50
55	600926	杭州银行	497,749.00	2.48
56	300451	创业慧康	497,718.00	2.48
57	002738	中矿资源	495,749.00	2.47
58	000060	中金岭南	494,795.00	2.47
59	000792	盐湖股份	482,919.00	2.41
60	002531	天顺风能	480,119.00	2.40
61	600021	上海电力	478,430.00	2.39
62	002318	久立特材	469,817.00	2.35
63	688122	西部超导	469,421.00	2.34
64	603799	华友钴业	469,014.00	2.34
65	600251	冠农股份	468,000.00	2.34
66	002532	天山铝业	467,090.00	2.33
67	002371	北方华创	467,073.00	2.33
68	600522	中天科技	461,500.00	2.30
69	601669	中国电建	461,120.00	2.30
70	300122	智飞生物	448,875.00	2.24
71	002041	登海种业	445,031.00	2.22
72	002466	天齐锂业	440,008.00	2.20
73	601699	潞安环能	439,375.00	2.19

74	601985	中国核电	438,680.00	2.19
75	300087	荃银高科	417,605.00	2.08
76	601600	中国铝业	413,220.00	2.06
77	600190	锦州港	406,848.00	2.03

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	82,799,837.06
卖出股票的收入（成交）总额	80,193,370.73

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”与“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金合同中尚无股指期货的投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末尚无国债期货投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.11、“陕西煤业”的发行人陕西煤业股份有限公司于 2022 年 6 月收到上交所就其减持隆基绿能事项发出监管工作函

2、“中国石油”的发行人中国石油天然气股份有限公司于 2022 年 1 月 19 日被国家审计署在内的国务院联合调查组发布消息称：中石油下属燃料油公司自 2006 年 6 月起倒卖进口原油，累计倒卖 1.795 亿吨，共销售给 115 家地炼企业，严重扰乱油品市场秩序。

本公司对以上证券的投资决策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。

本报告期末本基金投资的其他前十名证券没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本报告期，本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 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	13,313.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	11,728.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	25,041.24

7.13.4 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。

7.13.5 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。

7.13.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,103	7,503.24	0.00	0.00%	8,276,077.20	100.00%

8.2 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	4,966.52	0.06%

8.3 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

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份；该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为 0 份。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 7 月 13 日）基金份额总额	530,445,703.19
本报告期期初基金份额总额	8,293,936.81
本报告期基金总申购份额	432,790.47
减：本报告期基金总赎回份额	450,650.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	8,276,077.20

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期末有基金投资策略的改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本基金未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未有改聘会计师事务所的情况。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金不存在管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
华鑫证券	2	72,931,971.05	44.75%	52,986.66	44.58%	-
广发证券	1	54,137,128.02	33.21%	39,590.68	33.31%	-
长江证券	1	35,924,108.72	22.04%	26,271.54	22.10%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：本基金根据中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字[1998]29号）以及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，本基金共租用6个交易席位，其中报告期内新增2个交易席位，退租0个交易席位。新增席位为：华鑫证券上海席位、华鑫证券深圳席位。

一、交易席位的分配依据

交易席位的分配以券商实力及其所提供的研究支持为基础，主要考察点包括：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全。
- 2、具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要。
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平。

二、交易席位的选择流程

- 1、研究部根据上述标准考察后确定选用交易席位的券商。
- 2、与被选中的证券经营机构签订席位租用协议。

三、交易量的分配

交易量的分配以券商所提供的服务及研究支持为基础，主要考察点包括：

1、券商提供独立的或第三方研究报告及服务，包括宏观经济、行业分析、公司研发、市场数据、财经信息、行业期刊、组合分析软件、绩效评估、研讨会、统计信息、交易评估等，用以支持投资决策。

2、以季度为单位对经纪商通过评分的方式进行考核，由基金经理、研究员分别打分，根据经纪商给投资带来的增值确定经纪商的排名。

考核的内容包括上一季度经纪交易执行情况、提供研究报告数量、研究报告质量和及时性、受邀讲解次数及效果、主动推介次数及效果等。考核结果将作为当期交易量分配的依据，交易量大小

和评分高低成正比。

3、交易部负责落实交易量的实际分配工作。

10.8.2 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		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
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

10.9 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	新华基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-04
2	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海万得基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-11
3	新华基金管理股份有限公司关于北京分公司营业场所变更的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
4	新华基金管理股份有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证券报、公司网站、电子信披网站	2022-01-13
5	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-14
6	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年 4 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-01-21
7	新华灵活主题混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-01-21
8	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基	中国证券报、上海证券	2022-02-15

	金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	
9	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-02-24
10	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在北京汇成基金销售有限公司开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-02-25
11	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-02-25
12	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-07
13	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分公募基金增加销售机构、参加费率优惠活动并开通定期定额投资业务及基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-12
14	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分证券投资基金增加华鑫证券证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资业务及基金转换业务参加费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-12
15	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-18
16	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-03-30
17	新华灵活主题混合型证券投资基金 2021 年年度报告	公司网站、电子信披网站	2022-03-30
18	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金调整在安信证券股份有限公司定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-09
19	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海利得基金销售有限公司开展费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-15
20	新华基金管理股份有限公司旗下全部基金 1 季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-21
21	新华灵活主题混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	公司网站、电子信披网站	2022-04-21

22	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资业务、基金转换业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-04-26
23	新华基金管理股份有限公司关于新华灵活主题混合型证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2022-04-27
24	新华基金管理股份有限公司关于新华灵活主题混合型证券投资基金证券交易模式转换完成的公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2022-05-06
25	新华基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并开通相关业务及参加网上费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、电子信披网站	2022-06-09
26	新华基金管理股份有限公司新华灵活主题混合型证券投资基金基金经理变更公告	证券时报、公司网站、电子信披网站	2022-06-24
27	新华灵活主题混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-06-27
28	新华灵活主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）	公司网站、电子信披网站	2022-06-27

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准新华灵活主题股票型证券投资基金募集的文件
- （二）关于申请募集新华灵活主题股票型证券投资基金之法律意见书
- （三）新华灵活主题混合型证券投资基金托管协议
- （四）新华灵活主题混合型证券投资基金基金合同
- （五）《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》
- （六）《新华灵活主题混合型证券投资基金招募说明书》（更新）
- （七）《新华灵活主题混合型证券投资基金产品资料概要》（更新）
- （八）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- （九）基金托管人业务资格批件及营业执照

(十) 重庆市工商行政管理局关于核准新华基金管理有限公司变更公司名称、变更住所的批复

(十一) 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二二年八月三十日